

融通新蓝筹证券投资基金

[2014] 第一季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

报告送出日期:2014年4月19日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告中所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同的有关规定,于2014年4月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	34,144,369.50	0.39
C	制造业	3,949,565,470.15	45.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,491,523.89	0.29
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	94,263,998.11	1.09
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	775,322,162.81	8.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	80,900,000.00	0.93
L	租赁和商务服务业	123,633,817.05	1.42
M	科学研究、技术服务及地质勘查业	29,497,627.72	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	64,965,341.77	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	308,434,215.04	3.55
S	综合	-	-
	合计	5,485,797,494.04	63.21

§ 3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600587	新华医疗	345,239,158.34	3.98
2	600633	丽珠集团	308,434,215.04	3.55
3	601016	复星医药	14,302,690	0.30
4	300104	乐视网	560,773	0.24
5	600535	中航黑豹	242,803,871.55	2.80
6	002219	丽珠集团	6,000,000	0.17
7	300077	康得新	133,088,207.83	1.53
8	600887	伊利股份	3,500,874	0.41
9	300003	乐普医疗	6,099,902	0.72
10	002334	美晨科技	8,501,622	0.98
	合计	122,423,356.80	1.41	

§ 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标		报告期(2014年1月1日-2014年3月31日)
1.本期已实现收益	-	53,287,241.96
2.本期利润	-	-57,474,060.95
3.加权平均基金份额本期利润	-	-0.0453
4.期末基金份额净值	-	8,678,393,435.59
5.期末可供分配基金份额净值	-	0.7011

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2.本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平将低于列示金额;

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.24%	1.11%	-5.57%	0.90%	-0.67%	0.21%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:上图中基金业绩比较基准项目分段计算,其中2009年12月31日之前(含此日)采用“国泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”,2010年1月1日起使用新基准即“沪深300指数收益×70%+中信标普全债指数收益×30%”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期间	证券从业年限	说明
汪锐锐	本基金的基金经理,融通新蓝筹证券投资基金基金经理	2010年4月23日	-	18
吴鹏	本基金的基金经理,融通行业景气证券投资基金基金经理	2011年4月6日	-	21

注:汪锐锐长期担任基金经理,自2009年1月起,先后担任融通深证100指数基金、融通深证100指数基金、融通行业景气基金、融通行业景气基金、融通行业景气基金、融通行业景气基金基金经理,2010年3月起,担任融通行业景气基金经理,2011年4月起,担任融通行业景气基金经理。

吴鹏长期担任基金经理,自2009年1月起,先后担任融通深证100指数基金、融通深证100指数基金、融通行业景气基金、融通行业景气基金、融通行业景气基金、融通行业景气基金基金经理,2010年3月起,担任融通行业景气基金经理,2011年4月起,担任融通行业景气基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人利益的行为。基金投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易行为评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

4.3.3 报告期内公平交易制度的执行情况

本基金管理人一直坚持公平对待旗下所有投资组合的原则,并制定了相应的制度和流程,在授权、研究、决策、交易行为评估等各个环节保证公平交易制度的严格执行。报告期内,本基金管理人严格执行了公平交易的原则和制度。

4.4 报告期内公平交易专项信息披露

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4.1 报告期内本基金投资组合运作分析

2014年一季度本基金在各类指数表现分化上,上证指数下跌3.91%,深证成指下跌11.48%,中小板指下跌7.73%,创业板指上涨1.79%。板块间计算机、休闲服务、电气设备、新能源汽车、轻工制造等行业表现较好。本基金投资策略是行业景气度提升的行业和个股,重点布局了高端装备、医疗服务和计算机板块等行业,在一季度前半段时间获取了一定的超额收益,但由于三月份基金仓位不及,使得净值出现了较多的损失。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金报告期内份额净值增长率为-6.24%,同期业绩比较基准收益率为-5.57%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末本基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权证投资	5,485,797,819.04	62.95
2	股票投资	5,485,797,819.04	62.95
3	债券投资	2,023,404,021.00	23.22
4	货币市场基金投资	2,023,404,021.00	23.22
5	贵金属投资	-	-
6	黄金投资	-	-
7	买入返售金融资产	130,100,585.05	1.49
8	银行存款和结算备付金合计	1,008,162,619.01	11.57
9	其他资产	66,499,764.58	0.76
10	合计	8,713,464,808.68	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金报告期内未发生异常交易。

§ 6 开放式基金份额变动

6.1 报告期内基金的申购情况

6.1.1 申购基金金额

6.1.2 申购基金份数

6.1.3 申购费用

6.1.4 申购的基金份额

6.1.5 申购的金额

6.1.6 申购的日期

6.1.7 申购的份额

6.1.8 申购的金额

6.1.9 申购的日期

6.1.10 申购的金额

6.1.11 申购的日期

6.1.12 申购的金额

6.1.13 申购的日期

6.1.14 申购的金额

6.1.15 申购的日期

6.1.16 申购的金额

6.1.17 申购的日期

6.1.18 申购的金额

6.1.19 申购的日期

6.1.20 申购的金额

6.1.21 申购的日期