

融通蓝筹成长证券投资基金

[2010]第三季度报告

基金管理人:融通基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2010年10月28日

§1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通深证100指数证券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金共同构成。本报告为融通通利系列证券投资基金之子基金融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)2010年第3季度报告。

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

基金经理承认以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金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2010年7月1日起至2010年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 融通蓝筹成长混合

交易代码 161605

前端交易代码 161605

后端交易代码 161655

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2003年5月30日

报告期末基金份额总额 2,113,131,156.70份

投资目标 银行存款、货币市场基金、债券、股票等金融工具，为持有人获取长期稳定的投资收益。

投资策略 在对市场趋势判断的前提下，重仓仓位选择和行业配置，同时更

重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×75%+中债新全债指数收益率×25%

风险收益特征 力求获得超过标的平均水平的收益，承担相应的风险。

基金管理人 融通基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)

主要财务指标

1.本期已实现收益 8,695,509.95

2.本期利润 368,983,390.21

3.加权平均基金份额本期利润 0.1707

4.期末基金份额净值 2,789,704,974.09

5.期末基金资产净值 1,320

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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 14.78% 0.88% 11.07% 0.99% 3.71% -0.11%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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:上表中基金业绩比较基准项目分段计算,其中:2009年12月31日(含此日)之前采用泰基君安指数×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指数收益率×75%+中债新全债指数收益率×25%”。

§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限 证券从业年限 说明

陈晓生 基金经理 2007年3月2日 - 15 经济学硕士,具有证券投资从业资格,现就职于中海集团中心投资管理有限公司,历任证券投资部交易助理,股票投资经理,助理总经理,股票投资经理。2003年2月至今,历任融通蓝筹成长基金经理助理,助理总经理,股票投资经理,助理总经理,机构理财部股权投资经理。副总监。

严非 基金经理 2007年3月2日 - 7 经济学硕士,具有证券投资从业资格,现就职于中海集团中心投资管理有限公司,历任融通蓝筹成长基金经理助理,助理总经理,股票投资经理,助理总经理,机构理财部股权投资经理。副总监。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

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、《融通通利系列证券投资基金管理合同》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基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易行为等各个环节严格执行公平交易原则的严格执行。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 投资组合与其他投资基金风格相似的基金组合之间的业绩比较

本基金报告期未发生公平交易行为。

4.3.3 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基金的原则,并制定了相应的制度和流程,在投资决策和交易行为等各个环节保证公平交易原则的严格执行。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。

4.3.4 投资组合与公司旗下其他投资基金的业绩表现

注:本基金报告期份额净值增长率为14.78%,同期业绩比较基准收益率为11.07%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

基金简称 融通深证100指数

交易代码 161604

前端交易代码 161604

后端交易代码 161654

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2003年5月30日

报告期末基金份额总额 12,868,582,979.74份

投资策略 运用指数化投资方式,通过控制股票投资组合与深证100指数的跟踪误差,力求实现深证100指数的超额收益。

业绩比较基准 深证100指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%

风险收益特征 风险和预期收益率接近市场平均水平

基金管理人 融通基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

§2 基金产品概况

单位:人民币元 报告期(2010年7月1日-2010年9月30日)

主要财务指标

1.本期已实现收益 341,138.06

2.本期利润 3,041,825,127.68

3.加权平均基金份额本期利润 0.2323

4.期末基金份额净值 15,987,385,705.32

5.期末基金资产净值 14,748%

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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)

过去三个月 22.97% 1.39% 23.15% 1.36% -0.18% 0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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: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所列数字。

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(%) 净值增长率差(%) 业绩比较基准(%) 业绩比较基准收益率差(%) ①-(③) ②-(④)