

融通新蓝筹证券投资基金 2011 年年度报告

2011 年 12 月 31 日

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

送出日期：2012 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据融通新蓝筹证券投资基金（以下简称“本基金”）基金合同规定，于 2012 年 3 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告中的财务资料已经审计。普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	5
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 审计报告	12
§ 7 年度财务报表	13
7.1 资产负债表	13
7.2 利润表	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
7.4 报表附注	16
§ 8 投资组合报告	34
8.1 期末基金资产组合情况	35
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	38
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	40
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	40
8.9 投资组合报告附注	41
§ 9 基金份额持有人信息	42

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	42
§ 10 开放式基金份额变动	42
§ 11 重大事件揭示	42
11.1 基金份额持有人大会决议	42
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	42
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
11.4 基金投资策略的改变	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	43
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
11.8 其他重大事件	46
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	46
§ 13 备查文件目录	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	融通新蓝筹证券投资基金	
基金简称	融通新蓝筹混合	
基金主代码	161601	
交易代码	161601（前端收费模式）	161602（后端收费模式）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 9 月 13 日	
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	
报告期末基金份额总额	15,444,132,290.41 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金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，重视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。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30-75%；债券投资比例浮动范围：20-55%，现金留存比例浮动范围：不低于 5%。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”
风险收益特征	在适度风险下追求较高收益。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	融通基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	涂卫东
	联系电话	(0755) 26948666
	电子邮箱	service@mail.rtfund.com
客户服务电话	400-883-8088、(0755)26948088	(010) 67595096
传真	(0755) 26935005	(010) 66275853
注册地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	518053	100033
法定代表人	田德军	王洪章

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.rtfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人处、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	融通基金管理有限公司	深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-825,966,212.74	473,284,255.94	530,247,521.09
本期利润	-3,209,099,662.85	-239,828,410.39	6,103,791,621.04
加权平均基金份额本期利润	-0.2009	-0.0132	0.2999
本期加权平均净值利润率	-25.81%	-1.59%	38.06%
本期基金份额净值增长率	-23.04%	-1.25%	48.92%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	-5,052,270,987.79	-3,935,955,202.83	-4,929,602,060.58
期末可供分配基金份额利润	-0.3271	-0.2339	-0.2604
期末基金资产净值	10,391,861,302.62	14,711,425,185.43	16,761,554,420.49
期末基金份额净值	0.6729	0.8744	0.8855
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	249.66%	354.37%	360.13%

注：（1）所述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要低于所列数字。

（2）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。

（3）期末可供分配基金份额利润=期末可供分配利润÷期末基金份额总额。其中期末可供分配利润：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分，如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分扣除未实现部分）。

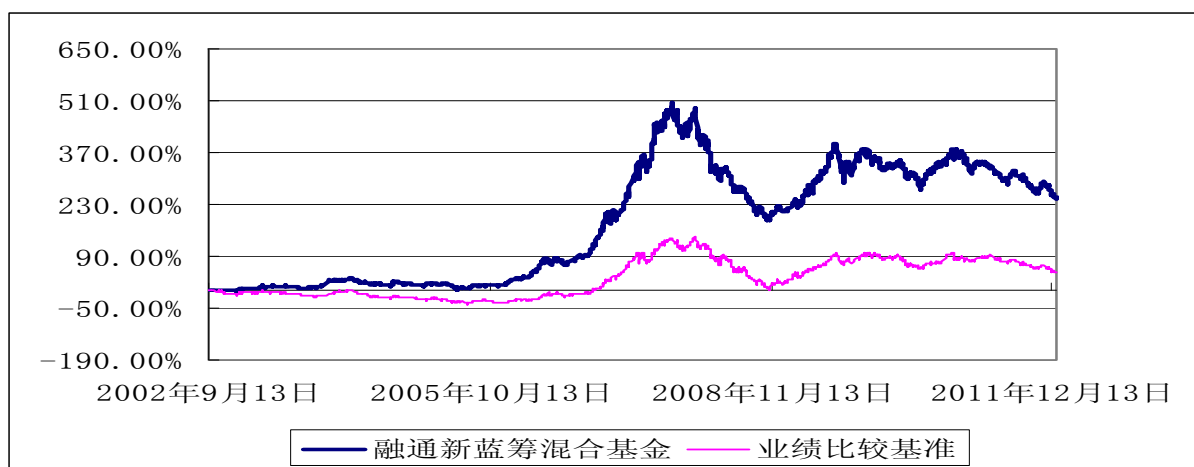
3.2 基金净值表现

3.2.1 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

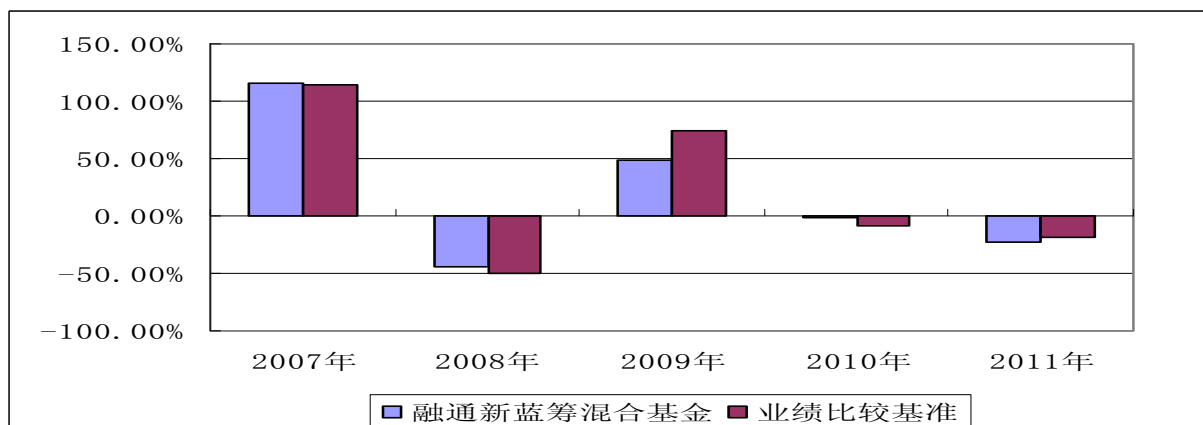
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.93%	0.99%	-6.20%	1.06%	2.27%	-0.07%
过去六个月	-13.50%	0.96%	-17.08%	1.02%	3.58%	-0.06%
过去一年	-23.04%	0.92%	-18.35%	0.98%	-4.69%	-0.06%
过去三年	13.17%	1.24%	29.92%	1.25%	-16.75%	-0.01%
过去五年	34.97%	1.45%	38.78%	1.61%	-3.81%	-0.16%
自基金合同 生效起至今	249.66%	1.25%	48.11%	1.37%	201.55%	-0.12%

注：本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 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”。

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011	-	-	-	-	-
2010	-	-	-	-	-
2009	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

融通基金管理有限公司（以下简称“本公司”）经中国证监会证监基字[2001]8号文批准，于2001年5月22日成立，公司注册资本12500万元人民币。本公司的股东及其出资比例为：新时代证券有限责任公司60%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%。

截至2011年12月31日，公司管理的基金共有十二只：一只封闭式基金，既融通通乾封闭基金；十一只开放式基金，既融通新蓝筹混合基金、融通债券基金、融通深证100指数基金、融通蓝筹成长混合基金、融通行业景气混合基金、融通巨潮100指数基金（LOF）、融通易支付货币基金、融通动力先锋股票基金、融通领先成长股票基金（LOF）、融通内需驱动股票基金和融通深证成份指数基金。其中融通债券基金、融通深证100指数基金和融通蓝筹成长混合基金同属融通通利系列证券投资基金。此外，公司还开展了特定客户资产管理业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

吴巍	本基金的基金经理、基金管理部执行总监	2011 年 4 月 6 日	-	19	硕士学位，具有证券从业资格。自 1993 年 7 月起，先后任职珠海丽珠医药集团公司药品开发工程师、中旅信证券深圳研究所行业研究员、深圳市至善投资有限公司行业研究员、宝盈基金管理有限公司行业研究员，2003 年 12 月进入融通基金管理有限公司，先后任行业研究员、研究部总监、基金管理部执行总监。
汪忠远	本基金的基金经理	2010 年 4 月 23 日	-	16	毕业于曼彻斯特大学商学院，研究生学历，具有证券从业资格。1993 年至 1997 年，任职君安证券武汉营业部投资经理；1997 年至 1999 年，任职延宁发展有限公司证券投资部经理；2001 年至 2005 年，任职深圳林奇投资顾问有限公司投资经理；2006 年加入融通基金管理有限公司，任机构理财部投资经理助理。
刘模林	本基金的基金经理、融通领先成长股票 (LOF) 基金的基金经理、公司副总经理	2004 年 7 月 21 日	2011 年 4 月 6 日	18	机械工程硕士，具有证券从业资格。历任武汉市信托投资公司证券总部研究部经理、花桥证券营业部经理；历任融通基金管理有限公司研究部策略和行业研究员、总监、机构理财部总监，基金管理部总监、公司副总经理。
张敏	本基金的基金经理	2009 年 8 月 26 日	2011 年 3 月 24 日	8	毕业于南开大学金融工程学院，金融学硕士，具有证券从业资格。2005 年 2 月至 2006 年 1 月，任中国国际期

					货有限公司行业研究员;2006年2月至2006年12月,任摩根士丹利华鑫基金(原巨田基金)管理有限公司行业研究员;2006年12月至今,历任融通基金管理有限公司研究员、基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注:任职日期和离任日期均根据基金管理人对外披露的任免日期填写;证券从业年限以从事证券业务相关工作的时间为计算标准。

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,本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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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,在投资决策和交易执行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。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期,本基金与公司管理的投资风格相似的其他基金之间的净值增长率差异未超过 5%。

基金名称	本报告期基金份额净值增长率
融通蓝筹成长混合基金	-19.03%
本基金	-23.04%

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年,为严控通胀,央行货币政策持续紧缩,国内季度GDP阶梯式下行,全年GDP增长9.2%。CPI在7月见全年高点后,随着下半年经济增速的逐步下行而如期回落,全年CPI同比上涨5.4%。

2011 年，A 股市场的走势基本同步于宏观经济，成为经济的晴雨表。上半年市场演绎周期股“纠偏”行情，水泥、工程机械、煤炭、稀土等强周期行业在需求的带动下，景气持续上行，行业指数表现较佳，但下半年随着信贷的持续紧缩，实体经济流动性日趋紧张，行业景气开始下行，使得上述板块出现深幅调整。2011 年贯穿全年表现最佳的行业是白酒和银行，前者因为业绩的高增长，后者是因为业绩快速增长同时估值安全。2011 年，上证指数全年下跌 21.68%，沪深 300 指数下跌 25%。年底，由于市场流动性持续偏紧，导致中小板、创业板指数暴跌，全年中小板指数下跌 34%和 35%。

回望 2011 年，新蓝筹基金在对宏观经济的趋势判断上未能做到“穿越”，低估了市场整体流动性的紧张，亦步亦趋导致投资方向和投资节奏上不够流畅。出于对宏观经济的担忧，2011 年新蓝筹基金低配强周期股，虽然没有经历周期股“过山车”般的折损，但在基金重仓持有的消费、新兴等成长股的配置方面，过分追求成长，忽略了因市场流动性紧缺导致的估值深度下滑。2011 年全年，新蓝筹基金的投资亮点在于大众消费品和信息设备的超配，最大的失误在于高端白酒和银行股的低配。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2011 年本基金净值下跌 23.04%，同期基金业绩基准下跌 18.35%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年，虽然上证指数已经下跌至 10 年前的位置，但我们面对的市场局面仍极其复杂。2012 年是中国经济结构调整的关键一年，市场经过深度下跌已经不乏具备中长期投资价值的股票，但市场整体的上涨还欠缺能带动经济内生良性增长的新引擎。2012 年，房地产调控仍将持续，海外经济增速放缓导致出口增速进一步下降，消费热点短期难以迅速培育，预计全年经济增速将回落至 8.5%左右。面对经济的减速，2012 年的投资机会是在于传统产业在城镇化带动下的景气恢复；还是在政策的引导下，以时间换空间，在传统产业高位调整的同时，通过制度创新，技术进步，改变增长模式，最终培育出新的经济增长点，这将贯穿全年的始终。如果是前者，A 股市场将会有估值修复的机会，如果能过渡到后者，A 股将充满机会。

虽历经曲折，2012 年新蓝筹基金仍将坚持自身偏重成长的投资风格。投资于快速成长的行业，追求持续为股东带来超额回报的公司，是本基金始终追求的方向。我们认为中国经济增长的长期动能并未衰竭，民生投资、消费升级、人力资本、技术创新、制度红利等，都将引领中国步入一个崭新的增长阶段。2012 年的市场将是传统与新兴博弈的一年，我们希望新蓝筹基金在更加注重风险意识的同时，通过坚定的投资理念和鲜明的风格来回报持有人。最后，衷心感谢基金持有人

对我们的信任。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

基金管理人坚持一切从保护基金持有人利益出发，继续致力于内控制度与机制的完善，加强合规控制与风险防范，确保基金运作符合法律法规和基金合同的要求。公司监察稽核部门通过合规审核、实时监控及专项检查等方法，对基金运作和公司管理进行独立的监察稽核，及时发现风险隐患，提出整改建议，并督促跟踪业务部门进行整改。

在专项稽核方面，公司监察稽核部门针对不同业务环节的风险特点，制定年度检查计划，并结合对各风险点风险程度的实时判断和评估，按照不同的检查频率，对投资决策、研究支持、交易执行、基金销售、后台运营、信息披露及员工职业操守管理等方面的重点业务环节进行专项检查，检查有关业务执行的合规性和风险控制措施的有效性，检查项目覆盖了相关业务的主要风险点。本报告期内，特别加大了对投资管理人员管控措施、投资决策流程及决策依据、交易执行及后台运作风险等敏感、重点项目的关注，确保基金运作的稳健合规。本基金管理人全年未发生合规及风险事故。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照《融通基金管理有限公司证券投资基金估值业务原则和程序》进行，公司设立由研究部、金融工程小组、登记清算部和监察稽核部指定人员共同组成的估值委员会，通过参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历，估值委员会成员不包含基金经理。

估值委员会定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订须经公司总经理办公会议审批后方可实施。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性。其中研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价，金融工程小组负责估值方法的研究、价格的计算及复核，登记清算部进行具体的估值核算并计算每日基金净值，每日对基金所投资品种的公开信息、基金会计估值方法的法规等进行搜集并整理汇总，供估值委员会参考，监察稽核部负责基金估值业务的事前、事中及事后的审核工作。基金经理不参与估值决定，参与估值流程各方之间亦不存在任何重大利益冲突，截至报告期末公司未与外部估值定价服务机构签约。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至 2011 年 12 月 31 日, 本基金每基金份额可供分配利润为-0.3271 元, 根据基金合同的约定, 本报告期不进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期, 本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 对本基金的投资运作方面进行了监督, 未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内, 本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20589 号

融通新蓝筹证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的融通新蓝筹证券投资基金(以下简称“融通新蓝筹混合基金”)的财务报表, 包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是融通新蓝筹混合基金的基金管理人 融通基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括:

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 并使其实现公允反映;

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述融通新蓝筹混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了融通新蓝筹混合基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天

注册会计师 薛 竞

会计师事务所有限公司

注册会计师 王 灵

中国 · 上海市

2012 年 3 月 22 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：融通新蓝筹证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,076,652,895.07	1,215,353,415.67
结算备付金		12,490,192.94	26,832,432.47
存出保证金		4,840,033.06	4,054,560.64
交易性金融资产	7.4.7.2	9,255,827,438.16	13,423,033,010.64

其中：股票投资		7,087,809,438.16	10,350,928,010.64
基金投资		-	-
债券投资		2,168,018,000.00	3,072,105,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	49,500,274.25	-
应收证券清算款		-	79,786,873.81
应收利息	7.4.7.5	31,527,683.70	53,335,709.96
应收股利		-	-
应收申购款		251,862.75	1,316,400.73
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		10,431,090,379.93	14,803,712,403.92
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2011年12月31日	2010年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		12,599,895.18	48,986,049.66
应付赎回款		2,012,679.73	5,064,279.26
应付管理人报酬		13,700,913.97	19,143,875.34
应付托管费		2,283,485.67	3,190,645.88
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,023,205.13	12,281,570.09
应交税费		1,967,377.38	1,967,377.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,641,520.25	1,653,420.88
负债合计		39,229,077.31	92,287,218.49
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	15,444,132,290.41	16,824,044,593.73
未分配利润	7.4.7.10	-5,052,270,987.79	-2,112,619,408.30
所有者权益合计		10,391,861,302.62	14,711,425,185.43
负债和所有者权益总计		10,431,090,379.93	14,803,712,403.92

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6729 元，基金份额总额 15,444,132,290.41 份。

7.2 利润表

会计主体：融通新蓝筹证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-2,945,248,877.94	93,613,104.79
1. 利息收入		103,448,941.90	102,118,965.70
其中：存款利息收入	7.4.7.11	9,556,720.77	11,716,244.97
债券利息收入		89,200,760.89	90,402,720.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		4,691,460.24	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益		-668,214,738.66	700,548,342.47
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-711,996,466.52	644,756,885.28
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-12,892,616.30	2,584,306.16
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	56,674,344.16	53,207,151.03
3. 公允价值变动收益	7.4.7.16	-2,383,133,450.11	-713,112,666.33
4. 汇兑收益		-	-
5. 其他收入	7.4.7.17	2,650,368.93	4,058,462.95
减：二、费用		263,850,784.91	333,441,515.18
1. 管理人报酬		186,922,494.68	226,193,591.82
2. 托管费		31,153,749.16	37,698,931.95
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	45,200,868.56	68,984,671.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	573,672.51	564,320.33
三、利润总额		-3,209,099,662.85	-239,828,410.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润		-3,209,099,662.85	-239,828,410.39

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：融通新蓝筹证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
----	--

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	16,824,044,593.73	-2,112,619,408.30	14,711,425,185.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,209,099,662.85	-3,209,099,662.85
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,379,912,303.32	269,448,083.36	-1,110,464,219.96
其中：1. 基金申购款	125,239,435.56	-27,198,246.79	98,041,188.77
2. 基金赎回款	-1,505,151,738.88	296,646,330.15	-1,208,505,408.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	15,444,132,290.41	-5,052,270,987.79	10,391,861,302.62
	上年度可比期间		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	18,929,585,073.11	-2,168,030,652.62	16,761,554,420.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-239,828,410.39	-239,828,410.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-2,105,540,479.38	295,239,654.71	-1,810,300,824.67
其中：1. 基金申购款	214,041,725.17	-36,253,508.31	177,788,216.86
2. 基金赎回款	-2,319,582,204.55	331,493,163.02	-1,988,089,041.53
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	16,824,044,593.73	-2,112,619,408.30	14,711,425,185.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

 奚星华

基金管理公司负责人

 颜锡廉

主管会计工作负责人

 刘美丽

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

融通新蓝筹证券投资基金（简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）

证监基金字[2002]41 号文件《关于同意融通新蓝筹证券投资基金设立的批复》核准发售，基金合同生效日为 2002 年 9 月 13 日，合同生效日基金规模为 2,218,864,742.31 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的管理人为融通基金管理有限公司，本基金的注册登记人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）。

本基金的投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的股票、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。对“新蓝筹”企业的投资不少于股票投资的 80%，同时将根据市场状况调整投资组合，把握投资机会，实现组合的进一步优化。根据本基金的基金管理人于 2010 年 2 月 6 日发布的《融通基金公司关于变更旗下部分基金业绩比较基准的公告》，本基金业绩比较基准变更为：沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后

的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(b)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
活期存款	1,076,652,895.07	1,215,353,415.67
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计：	1,076,652,895.07	1,215,353,415.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	7,892,057,140.87	7,087,809,438.16	-804,247,702.71	
债券	交易所市场	85,209,479.70	85,984,000.00	774,520.30
	银行间市场	2,078,753,423.70	2,082,034,000.00	3,280,576.30
	合计	2,163,962,903.40	2,168,018,000.00	4,055,096.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计		10,056,020,044.27	9,255,827,438.16	-800,192,606.11
项目	上年度末 2010年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	8,749,196,536.94	10,350,928,010.64	1,601,731,473.70	
债券	交易所市场	85,209,479.70	82,000,000.00	-3,209,479.70
	银行间市场	3,005,686,150.00	2,990,105,000.00	-15,581,150.00
	合计	3,090,895,629.70	3,072,105,000.00	-18,790,629.70
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	11,840,092,166.64	13,423,033,010.64	1,582,940,844.00	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	49,500,274.25	-
合计	49,500,274.25	-
项目	上年度末 2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	-	-
合计	-	-

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	227,461.61	236,517.67
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	6,182.67	10,330.43
应收债券利息	31,256,846.69	53,088,807.74
应收买入返售证券利息	37,123.10	-
应收申购款利息	-	-
其他	69.63	54.12

合计	31,527,683.70	53,335,709.96
----	---------------	---------------

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,012,225.35	12,279,020.09
银行间市场应付交易费用	10,979.78	2,550.00
合计	5,023,205.13	12,281,570.09

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,500,000.00	1,500,000.00
应付赎回费	7,020.25	18,920.88
预提费用	134,500.00	134,500.00
合计	1,641,520.25	1,653,420.88

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,824,044,593.73	16,824,044,593.73
本期申购	125,239,435.56	125,239,435.56
本期赎回	-1,505,151,738.88	-1,505,151,738.88
本期末	15,444,132,290.41	15,444,132,290.41

注：本年申购包含基金转入的份额及金额；本年赎回包含基金转出的份额及金额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,935,955,202.83	1,823,335,794.53	-2,112,619,408.30
本期利润	-825,966,212.74	-2,383,133,450.11	-3,209,099,662.85
本期基金份额交易产生的变动数	336,593,619.65	-67,145,536.29	269,448,083.36
其中：基金申购款	-31,237,474.84	4,039,228.05	-27,198,246.79
基金赎回款	367,831,094.49	-71,184,764.34	296,646,330.15

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,425,327,795.92	-626,943,191.87	-5,052,270,987.79

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
活期存款利息收入	9,353,663.32	11,485,160.24
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	198,845.91	225,602.72
其他	4,211.54	5,482.01
合计	9,556,720.77	11,716,244.97

注：其他包括申购款利息收入（2011年度：1,996.93元；2010年度：3,683.95元）以及权证保证金利息收入（2011年度：2,214.61元；2010年度：1,798.06元）。

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出股票成交总额	14,931,890,553.84	23,156,664,258.51
减：卖出股票成本总额	15,643,887,020.36	22,511,907,373.23
买卖股票差价收入	-711,996,466.52	644,756,885.28

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	4,392,968,158.83	4,349,364,987.17
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	4,282,763,526.30	4,295,798,835.00
减：应收利息总额	123,097,248.83	50,981,846.01
债券投资收益	-12,892,616.30	2,584,306.16

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益/损失。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	56,674,344.16	53,207,151.03
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	56,674,344.16	53,207,151.03

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-2,383,133,450.11	-713,112,666.33
——股票投资	-2,405,979,176.41	-681,396,866.33
——债券投资	22,845,726.30	-31,715,800.00
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-2,383,133,450.11	-713,112,666.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
基金赎回费收入	2,425,368.93	3,988,465.30
印花税返还	-	69,972.65
其他	225,000.00	25.00
合计	2,650,368.93	4,058,462.95

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 40% 归入基金资产。

2、2011 年“其他”项为债券兑付手续费返还。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
交易所市场交易费用	45,182,518.56	68,971,208.58
银行间市场交易费用	18,350.00	13,462.50
合计	45,200,868.56	68,984,671.08

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
审计费用	130,000.00	130,000.00
信息披露费	400,000.00	400,000.00
银行费用	25,672.51	16,320.33
债券帐户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	573,672.51	564,320.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准日，本基金无需要作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
新时代证券有限责任公司（“新时代证券”）	基金管理人股东、基金代销机构
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
新时代证券	649,945,803.55	2.19	343,618,288.19	0.76

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
新时代证券	552,453.80	2.23	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例(%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例(%)
新时代证券	292,076.62	0.78	221,182.35	1.80

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。权证交易不计佣金。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	186,922,494.68	226,193,591.82
其中：支付销售机构的客户维护费	40,142,320.39	48,507,051.39

注：支付基金管理人融通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至 2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,153,749.16	37,698,931.95

注：支付基金托管人 中国建设银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	-	-	150,000,000.00	60,462.53	-	-
上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	280,679,876.36	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，基金管理人主要股东及其控制的机构均未持有本基金份额。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	1,076,652,895.07	9,353,663.32	1,215,353,415.67	11,485,160.24

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

1、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；

2、本基金本报告期及上年度可比期间均未买入管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601336	新华保险	2011 年 12 月 9 日	2012 年 3 月 16 日	新股网下申购	23.25	27.87	69,953	1,626,407.25	1,949,590.11	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2011 年 12 月 30 日	公司整体改制	34.09	2012 年 1 月 4 日	34.75	2,649	43,409.56	90,304.41	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因从事交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

基金管理人奉行建设全面风险管理体系、风控优先的政策，在董事会下设立合规与审计委员会，负责检查公司合规运作的状况及合规控制的有效性，并对公司的合规控制提出相关要求；在管理层层面设立风险控制委员会，负责建立健全公司的风险管理制度并组织实施，审定公司的业务风险管理政策，审定公司内控管理组织实施方案，审定公司的业务授权方案，审定基金资产组

合的风险状况评价分析报告，审定公司各项风险与内控状况评价报告，审定业务风险损失责任人的责任，审定重大业务可行性风险论证，协调突发性重大风险事件的处理；各业务部门在执行业务事项时需遵守相关法律法规，遵守公司业务管理制度，具有根据业务特点控制业务风险的职责。业务人员是风险控制环节的第一责任人，部门负责人是控制业务风险管理的第一责任人，对部门风险控制措施的实施情况进行管理；风险管理小组由投资经理、金融工程人员和研究员组成，负责制定相关业务风险的识别和度量方法，指导业务部门实施风险的管理和控制，并定期出具投资组合风险报告，进行投资风险分析与绩效评估；督察长和监察稽核部负责监察公司各业务部门在相关法律法规、规章制度和业务流程执行方面的情况，确保既定的风险控制措施得到有效的贯彻执行，发现内控缺失和管理漏洞，提出改进要求和建议，并报告法规和制度的执行情况。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2011 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券（2010 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,076,652,895.07	-	-	-	1,076,652,895.07
结算备付金	12,490,192.94	-	-	-	12,490,192.94

存出保证金	140,741.00	-	-	4,699,292.06	4,840,033.06
交易性金融资产	1,799,815,000.00	282,219,000.00	85,984,000.00	7,087,809,438.16	9,255,827,438.16
买入返售金融资产	49,500,274.25	-	-	-	49,500,274.25
应收利息	-	-	-	31,527,683.70	31,527,683.70
应收申购款	74,452.02	-	-	177,410.73	251,862.75
资产总计	2,938,673,555.28	282,219,000.00	85,984,000.00	7,124,213,824.65	10,431,090,379.93
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	12,599,895.18	12,599,895.18
应付赎回款	-	-	-	2,012,679.73	2,012,679.73
应付管理人报酬	-	-	-	13,700,913.97	13,700,913.97
应付托管费	-	-	-	2,283,485.67	2,283,485.67
应付交易费用	-	-	-	5,023,205.13	5,023,205.13
应交税费	-	-	-	1,967,377.38	1,967,377.38
其他负债	-	-	-	1,641,520.25	1,641,520.25
负债总计	-	-	-	39,229,077.31	39,229,077.31
利率敏感度缺口	2,938,673,555.28	282,219,000.00	85,984,000.00	7,084,984,747.34	10,391,861,302.62
上年度末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,215,353,415.67	-	-	-	1,215,353,415.67
结算备付金	26,832,432.47	-	-	-	26,832,432.47
存出保证金	140,741.00	-	-	3,913,819.64	4,054,560.64
交易性金融资产	2,990,105,000.00	-	82,000,000.00	10,350,928,010.64	13,423,033,010.64
应收证券清算款	-	-	-	79,786,873.81	79,786,873.81
应收利息	-	-	-	53,335,709.96	53,335,709.96
应收申购款	783,710.81	-	-	532,689.92	1,316,400.73
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,233,215,299.95	-	82,000,000.00	10,488,497,103.97	14,803,712,403.92
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	48,986,049.66	48,986,049.66
应付赎回款	-	-	-	5,064,279.26	5,064,279.26
应付管理人报酬	-	-	-	19,143,875.34	19,143,875.34
应付托管费	-	-	-	3,190,645.88	3,190,645.88
应付交易费用	-	-	-	12,281,570.09	12,281,570.09
应交税费	-	-	-	1,967,377.38	1,967,377.38
其他负债	-	-	-	1,653,420.88	1,653,420.88
负债总计	-	-	-	92,287,218.49	92,287,218.49
利率敏感度缺口	4,233,215,299.95	-	82,000,000.00	10,396,209,885.48	14,711,425,185.43

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值。为便于同本报告期数据进行比较，对 2010 年 12 月 31 日的交易性金融资产已按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以重分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2011 年 12 月 31 日）	上年度末 （2010 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	7,483,978.23	5,108,582.20
	2. 市场利率上升 25 个基点	-7,391,226.64	-5,051,514.20

7.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围为 30%-75%；债券投资比例浮动范围为 20%-55%；权证投资比例浮动范围为 0-3%；现金留存比例浮动范围不低于 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 12 月 31 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,087,809,438.16	68.21	10,350,928,010.64	70.36
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,087,809,438.16	68.21	10,350,928,010.64	70.36

7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 (2011 年 12 月 31 日)	上年度末 (2010 年 12 月 31 日)
	1. 沪深 300 指数上升 5%	420,870,382.76	441,342,755.56
2. 沪深 300 指数下降 5%	-420,870,382.76	-441,342,755.56	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 7,173,703,133.75 元，属于第二层级的余额为 2,082,124,304.41 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 10,324,419,545.64 元，第二层级 3,098,613,465.00 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 比较期间财务报表

本公司 2010 年度财务报表由另一家会计师事务所审计，并出具无保留意见审计报告。比较期间财务报表的部分项目已按本年度财务报表的披露方式进行了重分类。

(3) 除公允价值和比较期间财务报表外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,087,809,438.16	67.95
	其中：股票	7,087,809,438.16	67.95
2	固定收益投资	2,168,018,000.00	20.78
	其中：债券	2,168,018,000.00	20.78
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	49,500,274.25	0.47
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,089,143,088.01	10.44
6	其他各项资产	36,619,579.51	0.35
7	合计	10,431,090,379.93	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,564,788.48	0.04
B	采掘业	186,731,286.80	1.80
C	制造业	5,044,090,636.74	48.54
C0	食品、饮料	1,256,068,828.44	12.09
C1	纺织、服装、皮毛	66,349,045.21	0.64
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	28,973,278.80	0.28
C4	石油、化学、塑胶、塑料	307,861,299.25	2.96
C5	电子	20,930,000.00	0.20
C6	金属、非金属	241,339,170.50	2.32
C7	机械、设备、仪表	1,494,351,809.06	14.38
C8	医药、生物制品	1,628,217,205.48	15.67
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-

E	建筑业	13,462,831.80	0.13
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	836,133,951.77	8.05
H	批发和零售贸易	122,034,685.51	1.17
I	金融、保险业	241,768,590.11	2.33
J	房地产业	235,221,943.96	2.26
K	社会服务业	128,294,189.26	1.23
L	传播与文化产业	117,457,144.13	1.13
M	综合类	158,049,389.60	1.52
	合计	7,087,809,438.16	68.21

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	47,185,840	964,006,711.20	9.28
2	000538	云南白药	10,976,690	581,764,570.00	5.60
3	600166	福田汽车	70,199,960	407,861,767.60	3.92
4	600267	海正药业	9,179,897	291,645,327.69	2.81
5	600993	马应龙	15,644,891	270,500,165.39	2.60
6	600585	海螺水泥	13,000,000	203,450,000.00	1.96
7	002073	软控股份	12,899,928	195,175,910.64	1.88
8	300079	数码视讯	7,562,101	186,783,894.70	1.80
9	002230	科大讯飞	4,800,564	168,019,740.00	1.62
10	000009	中国宝安	14,499,944	158,049,389.60	1.52
11	601699	潞安环能	7,389,956	156,371,468.96	1.50
12	601318	中国平安	4,500,000	154,980,000.00	1.49
13	600498	烽火通信	5,500,794	149,071,517.40	1.43
14	000550	江铃汽车	7,281,998	145,567,140.02	1.40
15	000651	格力电器	8,000,000	138,320,000.00	1.33
16	000895	双汇发展	1,950,000	136,402,500.00	1.31
17	600143	金发科技	10,099,907	130,591,797.51	1.26
18	000423	东阿阿胶	2,763,497	118,692,196.15	1.14
19	002281	光迅科技	3,433,576	111,041,847.84	1.07
20	002255	海陆重工	3,446,612	107,637,692.76	1.04
21	600587	新华医疗	3,200,990	100,190,987.00	0.96
22	300104	乐视网	3,300,449	93,633,738.13	0.90
23	002007	华兰生物	3,500,000	87,535,000.00	0.84
24	000024	招商地产	4,830,166	86,942,988.00	0.84
25	000661	长春高新	2,472,466	86,536,310.00	0.83

26	300158	振东制药	2,812,421	85,216,356.30	0.82
27	600422	昆明制药	5,557,927	82,535,215.95	0.79
28	600499	科达机电	9,000,880	82,448,060.80	0.79
29	002177	御银股份	7,300,840	80,309,240.00	0.77
30	600519	贵州茅台	411,073	79,460,410.90	0.76
31	600048	保利地产	7,500,000	75,000,000.00	0.72
32	600485	中创信测	6,724,791	71,888,015.79	0.69
33	600141	兴发集团	4,200,911	71,793,568.99	0.69
34	000069	华侨城 A	9,499,793	67,828,522.02	0.65
35	600694	大商股份	1,900,760	63,257,292.80	0.61
36	300101	国腾电子	2,000,000	63,100,000.00	0.61
37	601601	中国太保	2,900,000	55,709,000.00	0.54
38	000826	桑德环境	2,000,831	50,420,941.20	0.49
39	600859	王府井	1,550,895	49,799,238.45	0.48
40	600378	天科股份	4,540,017	42,176,757.93	0.41
41	000400	许继电气	2,109,838	40,825,365.30	0.39
42	600439	瑞贝卡	5,800,000	38,570,000.00	0.37
43	600779	水井坊	1,709,715	36,006,597.90	0.35
44	600261	阳光照明	2,038,548	35,124,182.04	0.34
45	600967	北方创业	2,069,461	34,746,250.19	0.33
46	000063	中兴通讯	1,991,172	33,650,806.80	0.32
47	600392	太工天成	3,000,000	30,480,000.00	0.29
48	600348	阳泉煤业	1,999,988	30,359,817.84	0.29
49	300124	汇川技术	550,000	29,810,000.00	0.29
50	600030	中信证券	3,000,000	29,130,000.00	0.28
51	300207	欣旺达	1,699,935	27,538,947.00	0.27
52	002285	世联地产	2,307,213	26,117,651.16	0.25
53	600750	江中药业	820,416	23,792,064.00	0.23
54	300261	N 雅本	1,499,972	22,934,571.88	0.22
55	601566	九牧王	1,000,861	21,428,434.01	0.21
56	600425	青松建化	1,799,930	21,329,170.50	0.21
57	002528	英飞拓	1,400,000	20,930,000.00	0.20
58	300251	光线传媒	300,000	18,216,000.00	0.18
59	600376	首开股份	1,800,000	17,262,000.00	0.17
60	600218	全柴动力	1,199,949	16,787,286.51	0.16
61	000639	西王食品	582,231	16,768,252.80	0.16
62	600600	青岛啤酒	499,905	16,736,819.40	0.16
63	000969	安泰科技	1,000,000	16,560,000.00	0.16
64	002465	海格通信	709,899	16,441,260.84	0.16

65	002292	奥飞动漫	600,000	15,078,000.00	0.15
66	002146	荣盛发展	1,699,921	14,959,304.80	0.14
67	000002	万科A	2,000,000	14,940,000.00	0.14
68	000527	美的电器	1,200,000	14,688,000.00	0.14
69	002511	中顺洁柔	588,783	13,895,278.80	0.13
70	002325	洪涛股份	679,941	13,462,831.80	0.13
71	002386	天原集团	1,500,165	13,336,466.85	0.13
72	600560	金白天正	1,000,900	11,480,323.00	0.11
73	000887	中鼎股份	1,000,000	11,280,000.00	0.11
74	601888	中国国旅	382,948	10,044,726.04	0.10
75	002123	荣信股份	500,000	8,165,000.00	0.08
76	600527	江南高纤	1,026,204	7,101,331.68	0.07
77	600590	泰豪科技	1,037,840	6,974,284.80	0.07
78	600809	山西汾酒	105,916	6,687,536.24	0.06
79	600500	中化国际	1,000,000	6,390,000.00	0.06
80	002029	七匹狼	179,904	6,350,611.20	0.06
81	600031	三一重工	499,910	6,268,871.40	0.06
82	600352	浙江龙盛	1,000,000	5,720,000.00	0.06
83	002376	新北洋	299,940	5,656,868.40	0.05
84	600088	中视传媒	400,529	5,607,406.00	0.05
85	002447	壹桥苗业	150,952	4,564,788.48	0.04
86	300024	机器人	250,000	4,432,500.00	0.04
87	300041	回天胶业	150,000	2,836,500.00	0.03
88	600337	美克股份	299,902	2,588,154.26	0.02
89	601336	新华保险	69,953	1,949,590.11	0.02
90	600315	上海家化	2,649	90,304.41	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	887,366,371.42	6.03
2	600585	海螺水泥	671,670,706.99	4.57
3	600031	三一重工	389,141,550.74	2.65
4	000009	中国宝安	332,464,524.72	2.26
5	600141	兴发集团	301,992,175.59	2.05
6	600016	民生银行	291,739,639.39	1.98
7	600348	阳泉煤业	264,623,778.28	1.80

8	600015	华夏银行	258,085,065.27	1.75
9	000024	招商地产	253,876,309.75	1.73
10	600887	伊利股份	244,006,451.59	1.66
11	002073	软控股份	239,770,151.14	1.63
12	000538	云南白药	237,307,145.07	1.61
13	600458	时代新材	230,029,905.72	1.56
14	601601	中国太保	229,458,245.37	1.56
15	601699	潞安环能	224,502,680.81	1.53
16	000423	东阿阿胶	222,848,682.55	1.51
17	600048	保利地产	209,679,452.02	1.43
18	000550	江铃汽车	206,838,381.46	1.41
19	300079	数码视讯	204,001,126.79	1.39
20	600498	烽火通信	203,670,015.15	1.38

注：“买入金额”是指买入股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	652,158,283.99	4.43
2	002007	华兰生物	615,285,372.54	4.18
3	600585	海螺水泥	528,385,928.39	3.59
4	000009	中国宝安	440,962,845.04	3.00
5	600031	三一重工	337,864,469.93	2.30
6	002069	獐子岛	334,526,642.75	2.27
7	600415	小商品城	314,762,373.59	2.14
8	600016	民生银行	288,442,443.17	1.96
9	000926	福星股份	288,234,483.95	1.96
10	000423	东阿阿胶	285,922,790.44	1.94
11	000538	云南白药	284,620,674.37	1.93
12	600570	恒生电子	282,735,102.77	1.92
13	000651	格力电器	282,506,958.75	1.92
14	600499	科达机电	282,163,446.45	1.92
15	300124	汇川技术	257,182,720.20	1.75
16	600166	福田汽车	242,312,527.38	1.65
17	600015	华夏银行	227,523,381.15	1.55
18	002024	苏宁电器	213,145,441.43	1.45
19	600141	兴发集团	212,175,587.39	1.44

20	600887	伊利股份	210,566,127.10	1.43
----	--------	------	----------------	------

注：“卖出金额”是指卖出股票成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	14,786,747,624.29
卖出股票收入（成交）总额	14,931,890,553.84

注：表中“买入股票成本（成交）总额”及“卖出股票收入（成交）总额”均指成交金额，即成交单价乘以成交数量，相关交易费用不考虑。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	85,984,000.00	0.83
2	央行票据	599,136,000.00	5.77
3	金融债券	1,482,898,000.00	14.27
	其中：政策性金融债	1,482,898,000.00	14.27
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	2,168,018,000.00	20.86

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101088	11 央行票据 88	4,800,000	463,824,000.00	4.46
2	110222	11 国开 22	2,500,000	249,825,000.00	2.40
3	110242	11 国开 42	2,400,000	240,528,000.00	2.31
4	110234	11 国开 34	2,000,000	200,040,000.00	1.93
5	110409	11 农发 09	2,000,000	199,800,000.00	1.92

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金投资的前十名证券之一的中国宝安的发行主体于 2011 年 6 月 15 日公告称于日前收到了深交所的处分通知，公司存在对子公司网站刊登信息把关不严、接待投资者调研工作不规范等信息披露方面的问题。公告表示，深交所认为，贝特瑞网站上曾有“贝特瑞拥有近 2.68 亿吨储量、适合于锂离子二次电池用的优质石墨矿产资源，可以确保原料供给稳定、持续”的陈述。而中国宝安以公告形式披露公司目前没有石墨矿。在是否拥有石墨矿的问题上，中国宝安表述和贝特瑞网站上的表述不一致。中国宝安没有对子公司贝特瑞对外披露的信息进行有效管理和严格审查，造成公司股价异动，市场影响恶劣。深交所决定，对中国宝安给予通报批评，并对其营运总裁贺德华、营运总裁兼董事会秘书娄兵给予通报批评的处分。

该事件发生后，投资研究部门讨论认为，上述事件对该公司盈利的负面影响未改变我们的基本预期，其影响在可控范围内。公司投资决策委员会同意对该证券进行重点投资。本基金在该证券上的投资决策流程符合法规和公司制度的规定。

除此之外，本基金投资的前十名证券中其他证券的发行主体报告期内没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 本基金投资的前十名股票中，无投资于基金合同规定备选股票库之处的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,840,033.06
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	31,527,683.70
5	应收申购款	251,862.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	36,619,579.51

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
759,441	20,336.18	58,669,155.04	0.38%	15,385,463,135.37	99.62%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,135,627.96	0.0074%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002年9月13日）基金份额总额	2,218,864,742.31
本报告期期初基金份额总额	16,824,044,593.73
本报告期基金总申购份额	125,239,435.56
减：本报告期基金总赎回份额	1,505,151,738.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,444,132,290.41

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

11.2.1 基金管理人的重大变动

(1) 自 2011 年 3 月 24 日起，张敏先生不再担任本基金的基金经理，刘模林先生、汪忠远先生继续担任本基金的基金经理，共同管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 3 月 26 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上刊登的相关公告。

(2) 经公司董事会审议并经中国证监会核准，奚星华先生担任公司总经理职务，颜锡廉先生（Allen Yan）担任公司副总经理职务，涂卫东先生担任公司督察长职务。经公司董事会审议并报中国证监会备案，吴冶平先生辞去公司督察长职务。

具体内容请参阅 2011 年 3 月 26 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

(3) 自 2011 年 4 月 6 日起, 刘模林先生不再担任本基金的基金经理, 增聘吴巍先生担任本基金的基金经理, 与汪忠远先生共同管理本基金。

具体内容请参阅 2011 年 4 月 6 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》上刊登的相关公告。

(4) 经公司董事会审议通过并报中国证监会备案, 同意刘模林先生辞去公司副总经理职务。

具体内容请参阅 2011 年 10 月 22 日在《证券时报》上刊登的相关公告。

11.2.1.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

中国建设银行股份有限公司 2011 年 2 月 9 日发布公告, 经中国建设银行研究决定, 聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作), 其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

中国建设银行股份有限公司 2011 年 1 月 31 日发布任免通知, 解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

中国建设银行股份有限公司 2011 年 10 月 24 日发布任免通知, 聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

在本报告期内没有涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金的投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人于本期将为本基金提供审计服务的原安永华明会计师事务所更换为普华永道中天会计师事务所有限公司, 上述事项已经托管人同意, 并报中国证监会备案, 公告日期 2011 年 10 月 20 日。

本基金本报告期应支付的审计费用为人民币 130,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内, 基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投	1	4,204,549,141.76	14.16%	3,416,225.34	13.78%	-
广发证券	1	3,040,306,619.66	10.24%	2,584,261.92	10.43%	-
华创证券	1	2,856,516,582.94	9.62%	2,428,034.07	9.80%	-
平安证券	2	2,415,808,661.69	8.13%	1,985,294.59	8.01%	-
长江证券	1	2,122,921,736.16	7.15%	1,724,890.30	6.96%	-
恒泰证券	1	1,479,561,207.34	4.98%	1,257,617.39	5.07%	-
高华证券	1	1,259,122,132.05	4.24%	1,070,258.45	4.32%	-
华宝证券	1	1,212,118,767.61	4.08%	1,030,291.25	4.16%	-
东方证券	1	1,108,116,909.19	3.73%	941,901.53	3.80%	-
华泰联合证券	1	1,037,070,116.54	3.49%	842,624.29	3.40%	-
中银国际	1	1,017,155,018.37	3.42%	864,578.06	3.49%	-
兴业证券	1	1,010,048,167.20	3.40%	858,530.28	3.46%	-
世纪证券	1	932,599,058.83	3.14%	792,706.65	3.20%	-
中信证券	1	919,227,846.72	3.09%	746,876.76	3.01%	-
瑞银证券	1	847,392,054.37	2.85%	720,282.66	2.91%	-
中金公司	1	800,893,193.08	2.70%	650,730.42	2.63%	-
国信证券	1	733,517,313.27	2.47%	595,988.10	2.40%	-
财达证券	1	670,403,408.85	2.26%	569,841.41	2.30%	-
新时代证券	1	649,945,803.55	2.19%	552,453.80	2.23%	-
方正证券	1	569,309,930.50	1.92%	462,568.58	1.87%	-
申银万国	1	420,101,356.95	1.41%	357,084.79	1.44%	-
银河证券	1	175,844,832.14	0.59%	149,467.33	0.60%	-
安信证券	2	134,284,270.20	0.45%	109,106.66	0.44%	-
国泰君安	1	84,596,423.91	0.28%	71,906.64	0.29%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
第一创业	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面：

- (1) 资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚；
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的
需要，并能为本基金提供全面的信息服务；
- (6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询
服务，包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告，并能根据
基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

2、选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步
骤：

- (1) 券商服务评价；
- (2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商；
- (3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准；
- (4) 签约。在获得批准后，按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

3、交易单元变更情况

本报告期内，新增招商证券、恒泰证券、华宝证券、方正证券交易单元各一个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交 金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	成交 金额	占当期权证 成交总额的比例
东方证券	-	-	843,200,000.00	79.20%	-	-
恒泰证券	-	-	221,500,000.00	20.80%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

兴业证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
第一创业	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	披露日期
1	融通新蓝筹混合证券投资基金基金经理离任公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-3-26
2	关于融通旗下开放式基金参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-3-30
3	融通新蓝筹证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-4-6
4	关于新增恒泰长财证券有限责任公司代理融通旗下开放式基金销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-5-16
5	关于融通旗下开放式基金在天相投资顾问有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-5-31
6	关于融通旗下部分开放式基金继续参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-6-29
7	2011 年度融通基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-10-20

8	关于融通旗下部分开放式基金继续参加深圳发展银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-12-30
9	关于融通旗下部分开放式基金参加平安银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-12-30
10	关于融通旗下开放式基金参加中国工商银行“2012 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报、证券日报、管理人网站	2011-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

2011 年 10 月 28 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告, 根据国家金融工作的需要, 郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司 (“本行”) 董事会 (“董事会”) 提出辞呈, 请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定, 郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2012 年 1 月 16 日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自 2012 年 1 月 16 日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

§ 13 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通新蓝筹证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》及其定期更新
- (五) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》
- (六) 融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程
- (七) 基金托管人中国建设银行业务资格批件和营业执照

存放地点: 基金管理人、基金托管人处

查阅方式: 投资者可在营业时间免费查阅, 也可按工本费购买复印件, 或登陆本基金管理人网站 <http://www.rtfund.com> 查询。