

融通通利系列证券投资基金之
融通蓝筹成长证券投资基金
2016 年第 4 季度报告

2016 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 20 日

§ 1 重要提示

融通通利系列证券投资基金由融通债券投资基金、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”）2016 年第 4 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据《融通通利系列证券投资基金基金合同》规定，于 2017 年 1 月 18 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 2016 年 10 月 1 日起至 2016 年 12 月 31 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	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 9 月 30 日
报告期末基金份额总额	689,010,366.15 份
投资目标	组合投资，资本增值，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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%
风险收益特征	力求获得超过市场平均水平的收益，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

主要财务指标	报告期(2016 年 10 月 1 日 — 2016 年 12 月 31 日)
1. 本期已实现收益	-13,173,776.33

2. 本期利润	-11,789,747.51
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0169
4. 期末基金资产净值	816,229,977.02
5. 期末基金份额净值	1.185

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要低于所列数字。

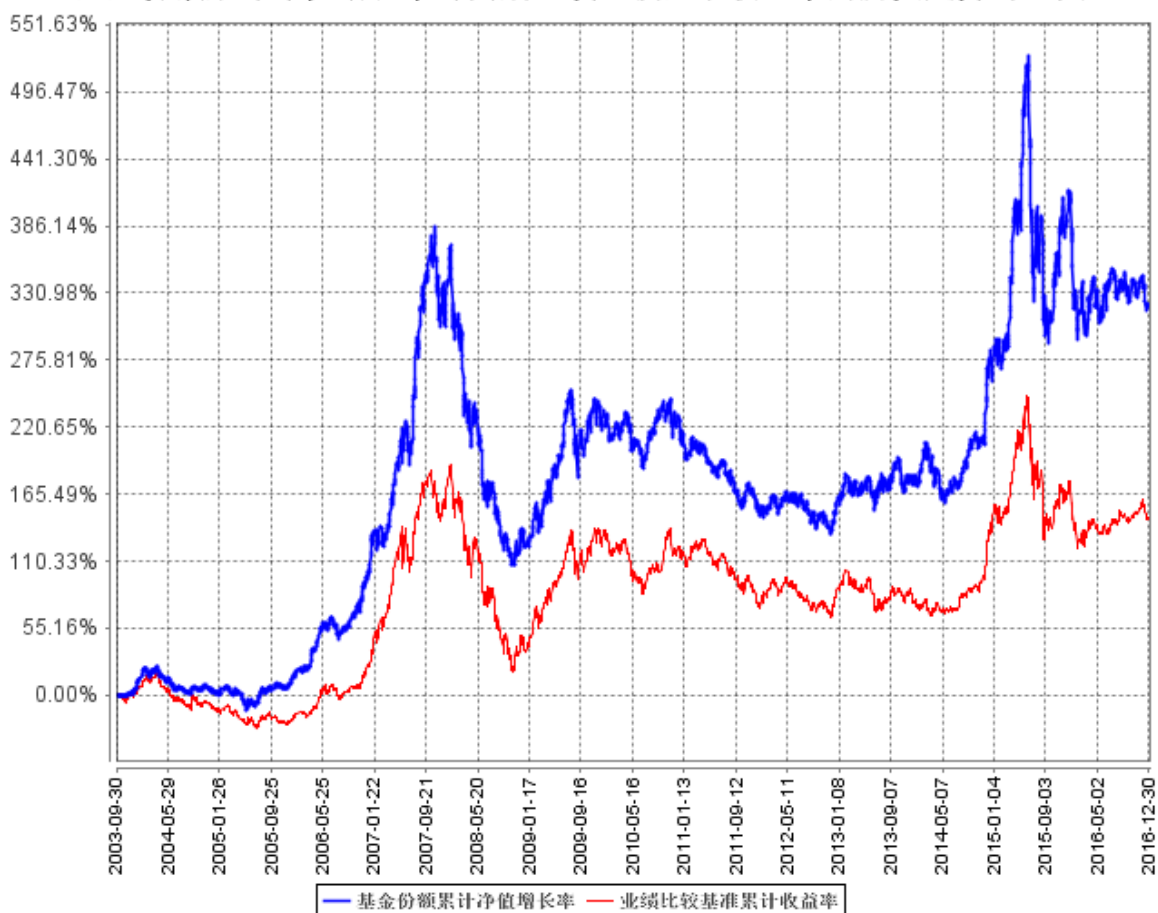
3.2 基金净值表现

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	-1.41%	0.68%	0.74%	0.54%	-2.15%	0.14%

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本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“国

泰君安指数×75%+银行间债券综合指数×25%”，2010年1月1日起至2015年9月30日（含此日）采用“沪深300指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”，自2015年10月1日起采用新基准“沪深300指数收益率×75%+中债综合全价（总值）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
		任职日期	离任日期		
薛冀颖	融通蓝筹成长证券投资基金的基金经理	2015年6月19日	-	5	薛冀颖先生，清华大学工学博士、西安电子科技大学工学学士，5年证券投资从业经历，具有基金从业资格。历任鹏华基金管理有限公司研究员。2014年9月加入融通基金管理有限公司，2015年6月19日起至今任“融通蓝筹成长证券投资基金”基金经理。

注：任免日期指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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规和本基金合同的规定，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，本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、交易和业绩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

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年四季度市场分化明显，其中上证综指冲高回落，上涨3.29%，中小板指和创业板指明

显弱势，分别下跌 4.59%和 8.74%。四季度蓝筹成长基金认为系统性风险不大，市场短期下跌空间有限，会出现明显的结构性分化，应积极寻找行业景气向上和基本面出现积极变化的领域和个股，不过市场在结构方面以险资举牌、国企改革等主题表现突出，蓝筹成长基金四季度在板块选择上没有契合市场风格，但持仓的一些个股表现相对突出，净值表现在同类型基金的中位数。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金份额净值增长率为-1.41%，同期业绩比较基准收益率为 0.74%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	475,447,967.15	57.54
	其中：股票	475,447,967.15	57.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	210,375,000.00	25.46
	其中：债券	210,375,000.00	25.46
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	132,017,956.71	15.98
8	其他资产	8,441,216.77	1.02
9	合计	826,282,140.63	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	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	14,028,000.00	1.72
C	制造业	291,268,290.24	35.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,905,425.53	0.36
E	建筑业	19,867,842.23	2.43
F	批发和零售业	14,418,732.77	1.77

G	交通运输、仓储和邮政业	3,747,458.68	0.46
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,425,338.16	5.93
J	金融业	33,916,208.00	4.16
K	房地产业	40,664,460.34	4.98
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,702,211.20	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	3,504,000.00	0.43
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	475,447,967.15	58.25

5.3 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	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000059	华锦股份	5,437,898	64,710,986.20	7.93
2	300098	高新兴	2,969,932	41,668,145.96	5.10
3	600691	阳煤化工	7,704,108	29,583,774.72	3.62
4	600240	华业资本	1,900,000	20,406,000.00	2.50
5	000711	京蓝科技	622,571	20,258,460.34	2.48
6	000422	湖北宜化	2,436,284	19,368,457.80	2.37
7	002475	立讯精密	834,323	17,312,202.25	2.12
8	601668	中国建筑	1,850,000	16,391,000.00	2.01
9	600919	江苏银行	1,550,000	14,926,500.00	1.83
10	000731	四川美丰	1,450,000	14,471,000.00	1.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	29,961,000.00	3.67
2	央行票据	-	-
3	金融债券	180,414,000.00	22.10
	其中：政策性金融债	180,414,000.00	22.10
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	210,375,000.00	25.77
----	----	----------------	-------

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	160414	16 农发 14	500,000	49,925,000.00	6.12
2	160401	16 农发 01	400,000	40,000,000.00	4.90
3	160209	16 国开 09	400,000	39,960,000.00	4.90
4	019539	16 国债 11	300,000	29,961,000.00	3.67
5	150210	15 国开 10	200,000	20,510,000.00	2.51

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体报告期内没有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。

5.11.2 本基金投资的前十名股票未超出本基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	704,266.85
2	应收证券清算款	2,663,950.71
3	应收股利	-
4	应收利息	5,030,491.63
5	应收申购款	42,507.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,441,216.77

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300098	高新兴	41,668,145.96	5.10	重大事项停牌
2	000711	京蓝科技	20,258,460.34	2.48	重大事项停牌

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	709,265,948.50
报告期期间基金总申购份额	4,107,178.23
减：报告期期间基金总赎回份额	24,362,760.58
报告期期末基金份额总额	689,010,366.15

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,860,348.02
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-

报告期期末管理人持有的本基金份额	3,860,348.02
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例 (%)	0.56

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通通利系列证券投资基金设立的文件
- (二) 《融通通利系列证券投资基金基金合同》
- (三) 《融通通利系列证券投资基金托管协议》
- (四) 《融通通利系列证券投资基金招募说明书》及其更新
- (五) 融通基金管理有限公司业务资格批件和营业执照
- (六) 报告期内在指定报刊上披露的各项公告

8.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

8.3 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 www.rtfund.com 查询。

融通基金管理有限公司
2017 年 1 月 20 日