

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  
2017 年第 3 季度报告

2017 年 9 月 30 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 10 月 26 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”）2017 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 10 月 23 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 2017 年 7 月 1 日起至 2017 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	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	638,720,200.60 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（2017年7月1日—2017年9月30日）
1. 本期已实现收益	71,789,657.62
2. 本期利润	48,766,171.08
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0747
4. 期末基金资产净值	812,167,108.54
5. 期末基金份额净值	1.272

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。

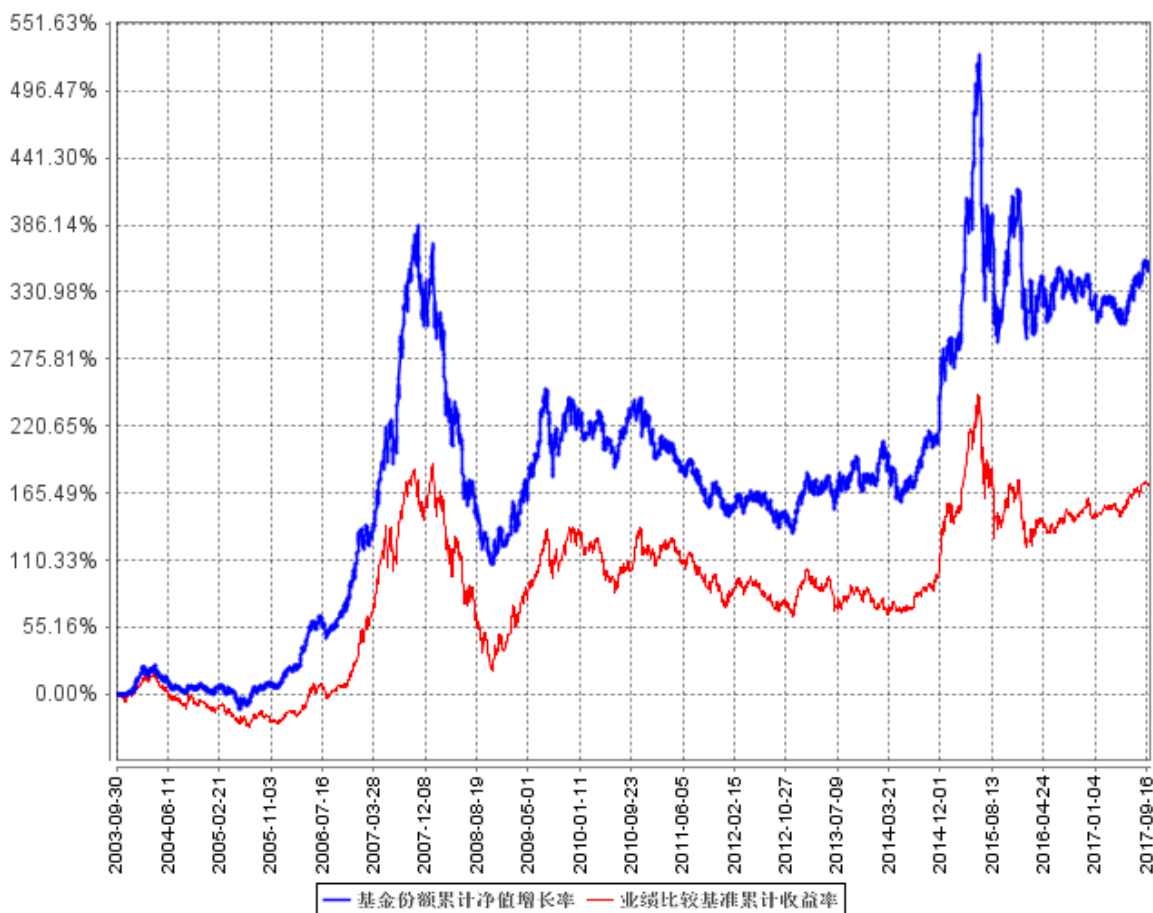
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	6.27%	0.74%	3.44%	0.44%	2.83%	0.30%

### 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	本基金的基金经理	2015-06-19	-	6	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，6 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，现任融通蓝筹成长混合基金的基金经理。

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

2017 年三季度市场各板块基本都有一定幅度的上涨，其中上证综指上涨 4.9%，深证综指上涨 4.78%，创业板指上涨 2.69%。三季度蓝筹成长基金在继续持一些优质蓝筹和成长股的同时，增加了一定比例周期股的配置。主要在于认为中国经济展现出较强的韧性，房地产的销售下滑幅度不大，但同时房地产库存下降较快，这样地产投资会相对较好，另外供给侧改革已见到明显成效。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.272 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.27%，业绩比较基准收益率为 3.44%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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	507,662,290.47	61.09
	其中：股票	507,662,290.47	61.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	209,706,000.00	25.23
	其中：债券	209,706,000.00	25.23
	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	108,851,521.44	13.10
8	其他资产	4,827,814.94	0.58
9	合计	831,047,626.85	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	16,771,418.24	2.07
B	采矿业	13,124,451.44	1.62
C	制造业	287,387,511.36	35.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	31,093.44	0.00
E	建筑业	7,007,707.72	0.86
F	批发和零售业	28,909,342.15	3.56
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	17,893,258.60	2.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,124,038.87	3.83
J	金融业	80,801,907.04	9.95
K	房地产业	8,269,089.21	1.02
L	租赁和商务服务业	11,143,600.00	1.37
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,014,000.00	0.62
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.01

R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	-	-
	合计	507,662,290.47	62.51

### 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	002640	跨境通	1,241,210	28,882,956.70	3.56
2	002866	传艺科技	778,857	24,845,538.30	3.06
3	002061	*ST 江化	1,909,984	23,034,407.04	2.84
4	000063	中兴通讯	750,000	21,225,000.00	2.61
5	601318	中国平安	383,994	20,797,115.04	2.56
6	601628	中国人寿	685,000	19,001,900.00	2.34
7	600754	锦江股份	569,849	17,893,258.60	2.20
8	002696	百洋股份	833,984	16,771,418.24	2.07
9	000568	泸州老窖	281,600	15,797,760.00	1.95
10	002466	天齐锂业	218,000	15,323,220.00	1.89

### 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	39,980,000.00	4.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	169,726,000.00	20.90
	其中：政策性金融债	169,726,000.00	20.90
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	209,706,000.00	25.82

### 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	170401	17 农发 01	1,100,000	109,846,000.00	13.53
2	170204	17 国开 04	600,000	59,880,000.00	7.37
3	019563	17 国债 09	400,000	39,980,000.00	4.92

### 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 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

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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、处罚的情形。

江山化工：2017 年 8 月 28 日，浙江江山化工股份有限公司（以下简称“公司”）收到江山市环境保护局（以下简称“市环保局”）《行政处罚决定书》（江环罚字[2017]33 号），责令公司停止违法排放污染物行为，并处以人民币壹拾贰万元罚款的行政处罚。现将有关情况公告如下：2017 年 8 月 14 日，市环保局对公司进行现场调查时发现公司各生产线满负荷正常生产，废水处理设施、热电锅炉烟气处理设施、有机废气锅炉正在运转，经对公司外排废水、外排热电锅炉烟气、厂界无组织废气监督监测，其外排废水达标，热电锅炉烟气烟尘、厂界无组织废气恶臭浓度超标。违反了《中华人民共和国大气污染防治法》第十八条之规定，责令公司停止违法排放污染物行为，并处以人民币壹拾贰万元罚款的行政处罚。

江山化工 8 月 28 号收到市环保局 12 万元的行政处罚，根据公司公告和后续调研，公司大部分环保处理包括外排废水等均达标，热电锅炉烟气烟尘、厂界无组织废气轻微超标，目前已经改正，江山目前主业聚碳酸酯行业格局较好，国内目前大量依赖进口，未来公司产品进口替代的潜在空间较大。另外公司收购浙江交工，也是质地较优质的资产，并承诺了未来相对较高的业绩增速。总体而言公司具有较好的成长性，结合目前的估值来看具有投资价值。



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	598,270.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,208,790.26
5	应收申购款	20,754.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,827,814.94

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	665,026,012.53
报告期期间基金总申购份额	5,411,017.04
减：报告期期间基金总赎回份额	31,716,828.97
报告期期间基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	638,720,200.60

§ 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（%）	0.60

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](http://www.rtfund.com) 查询。

融通基金管理有限公司

2017 年 10 月 26 日