

融通新蓝筹证券投资基金

2021 年第 3 季度报告

2021 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 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规定，于 2021 年 10 月 22 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 2021 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通新蓝筹混合
基金主代码	161601
前端交易代码	161601
后端交易代码	161602
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
报告期末基金份额总额	1,278,335,769.93 份
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%；权证投资比例浮动范围：0%-3%；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%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金，低于股票型基金，属于中高预期收益和预期风险水平的投资品种。
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

§ 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（2021 年 7 月 1 日-2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	8,066,148.52
2. 本期利润	-209,424,838.98
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1607
4. 期末基金资产净值	1,583,426,879.27
5. 期末基金份额净值	1.2387

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。

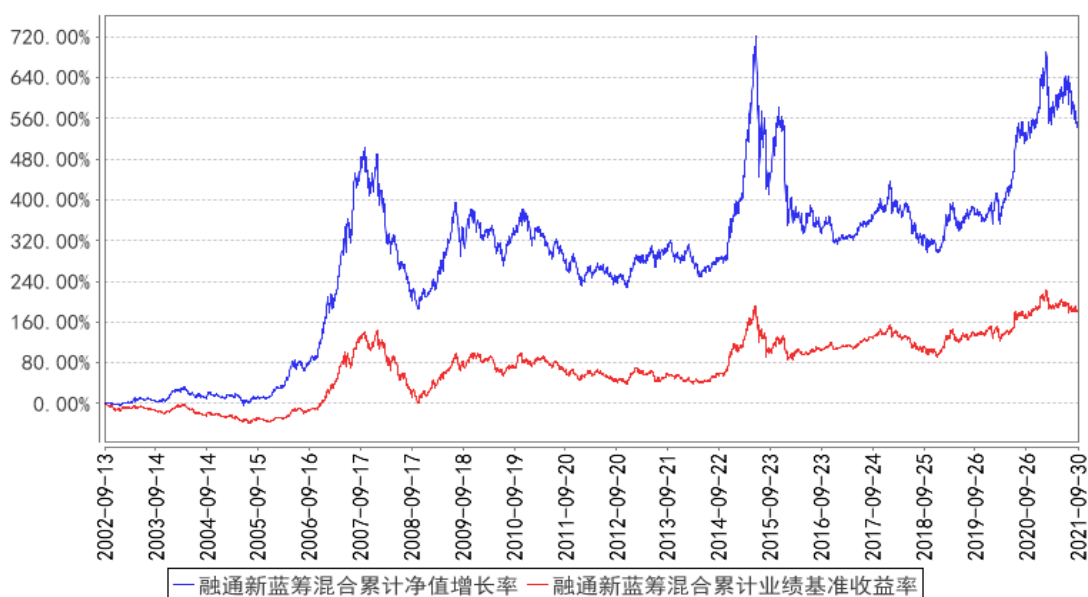
3.2 基金净值表现

3.2.1 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	-11.50%	1.35%	-4.90%	0.90%	-6.60%	0.45%
过去六个月	-2.91%	1.26%	-2.27%	0.82%	-0.64%	0.44%
过去一年	4.69%	1.33%	5.43%	0.91%	-0.74%	0.42%
过去三年	51.31%	1.24%	32.99%	1.01%	18.32%	0.23%
过去五年	48.10%	1.09%	38.12%	0.89%	9.98%	0.20%
自基金合同 生效起至今	552.66%	1.26%	183.66%	1.23%	369.00%	0.03%

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

融通新蓝筹混合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：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 日至 2015 年 9 月 30 日期间采用“沪深 300 指数收益率×75%+中信标普全债指数收益率×25%”，2015 年 10 月 1 日起使用新基准即“沪深 300 指数收益率×75%+中债综合全价（总值）指数收益率×25%”。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
何龙	本基金的基金经理、组合投资部副总监	2020 年 1 月 2 日	-	9 年	何龙先生，武汉大学金融学硕士，9 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2012 年 7 月加入融通基金管理有限公司，历任金融行业研究员、策略研究员、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通新区域新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通研究优选混合型证券投资基金基金经理，现任组合投资部副总监、融通领先成长混合型证券投资基金 (LOF) 基金经理、融通红利机会主题精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通通益混合型证券投资基金基金经理、融通稳健添盈灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通价值趋势混合型证券投资基金基金经

					理、融通核心趋势混合型证券投资基金基金经理。
蒋秀蕾	本基金的基金经理、权益投资部总经理	2021 年 2 月 18 日	-	14 年	蒋秀蕾先生，中国药科大学药物化学硕士，14 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 7 月至 2007 年 10 月任朗生医药(深圳)有限公司职员，2007 年 10 月至 2008 年 8 月就职于招商证券股份有限公司研发中心任研究员，2008 年 8 月至 2009 年 1 月就职于深圳嘉联融丰投资有限公司任投资经理，2009 年 2 月至 2016 年 9 月就职于融通基金管理有限公司任行业研究员、行业研究组组长、融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理、融通健康产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理，2016 年 9 月至 2017 年 11 月就职于新疆前海联合基金管理有限公司任投资经理。2017 年 12 月再次加入融通基金管理有限公司，现任权益投资部总经理、融通医疗保健行业混合型证券投资基金基金经理、融通新蓝筹证券投资基金基金经理、融通创新动力混合型证券投资基金基金经理。

注：任免日期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、基金业务相关的工作时间为计算标准。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 3 季度，A 股市场继续周期类资产为主的结构性情行，消费类资产尤其是医药板块由于受到政策影响回调较多。

本基金按照基金合同的要求，坚持“白马+成长”的核心投资策略，根据市场形势及时调整持仓结构，聚焦个股持仓，3 季度以来及时调整组合结构，在积极布局新能源、医药、半导体和高端制造赛道核心资产的基础上，适当增加了军工和周期类资产的配置比例。本基金目标为长期配置满足未来人类高质量发展需求的消费品行业，具备科技核心竞争力的高端制造业，符合国家碳中和战略目标的高端制造业，能通过这次疫情真正能走出国门的高端制造业。

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 1.2387 元；本报告期基金份额净值增长率为-11.50%，业绩比较基准收益率为-4.90%。

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	1,045,989,319.94	65.70
	其中：股票	1,045,989,319.94	65.70
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	374,924,609.10	23.55
	其中：债券	374,924,609.10	23.55
	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	166,285,726.07	10.45
8	其他资产	4,756,923.75	0.30
9	合计	1,591,956,578.86	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	12,350.52	0.00
B	采矿业	18,770,000.00	1.19
C	制造业	857,153,113.66	54.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,299,875.22	0.40
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	61,969.47	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,620,955.91	2.82
J	金融业	10,827,000.00	0.68
K	房地产业	16,134,500.00	1.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	91,972,191.09	5.81
N	水利、环境和公共设施管理业	104,882.94	0.01
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	8,952.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,045,989,319.94	66.06

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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	300122	智飞生物	710,000	112,882,900.00	7.13
2	603259	药明康德	600,080	91,692,224.00	5.79
3	600031	三一重工	3,000,016	76,320,407.04	4.82
4	300274	阳光电源	500,000	74,190,000.00	4.69
5	300750	宁德时代	140,700	73,970,211.00	4.67
6	002812	恩捷股份	140,066	39,235,287.92	2.48
7	601100	恒立液压	431,954	36,534,669.32	2.31
8	688536	思瑞浦	55,948	35,700,978.28	2.25
9	002466	天齐锂业	349,500	35,502,210.00	2.24
10	300782	卓胜微	100,000	35,200,000.00	2.22

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	374,924,609.10	23.68
	其中：政策性金融债	374,924,609.10	23.68
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	374,924,609.10	23.68

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	210206	21 国开 06	2,650,000	265,159,000.00	16.75
2	190207	19 国开 07	1,000,000	100,480,000.00	6.35
3	018006	国开 1702	92,110	9,285,609.10	0.59

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

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

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

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本期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

1、本基金投资的前十名证券中的 19 国开 07、21 国开 06，其发行主体为国家开发银行。

根据发布的相关公告，该证券发行主体因违规经营、未依法履行职责，多次受到监管机构的处罚。

投资决策说明：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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	286,482.81
2	应收证券清算款	40,459.96
3	应收股利	-
4	应收利息	4,354,585.53
5	应收申购款	75,395.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,756,923.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,334,213,284.36
报告期期间基金总申购份额	5,959,213.88
减：报告期期间基金总赎回份额	61,836,728.31
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,278,335,769.93

§ 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

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

9.3 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
<http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2021 年 10 月 26 日