

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

2024 年第 1 季度报告

2024 年 3 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：2024 年 4 月 19 日

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”）2024 年第 1 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 2024 年 4 月 17 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 2024 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	融通蓝筹成长混合	
基金主代码	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	322,231,725.62 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	
下属分级基金的基金简称	融通蓝筹成长混合 A/B	融通蓝筹成长混合 C
下属分级基金的交易代码	161605	019971
下属分级基金的前端交易代码	161605	-
下属分级基金的后端交易代码	161655	-
报告期末下属分级基金的份额总额	322,220,393.94 份	11,331.68 份

§ 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（2024 年 1 月 1 日-2024 年 3 月 31 日）	
	融通蓝筹成长混合 A/B	融通蓝筹成长混合 C
1. 本期已实现收益	-9,604,499.29	-743.84
2. 本期利润	14,653,817.82	2,964.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0453	0.1432
4. 期末基金资产净值	440,232,621.31	15,440.88
5. 期末基金份额净值	1.366	1.363

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)扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

融通蓝筹成长混合 A/B

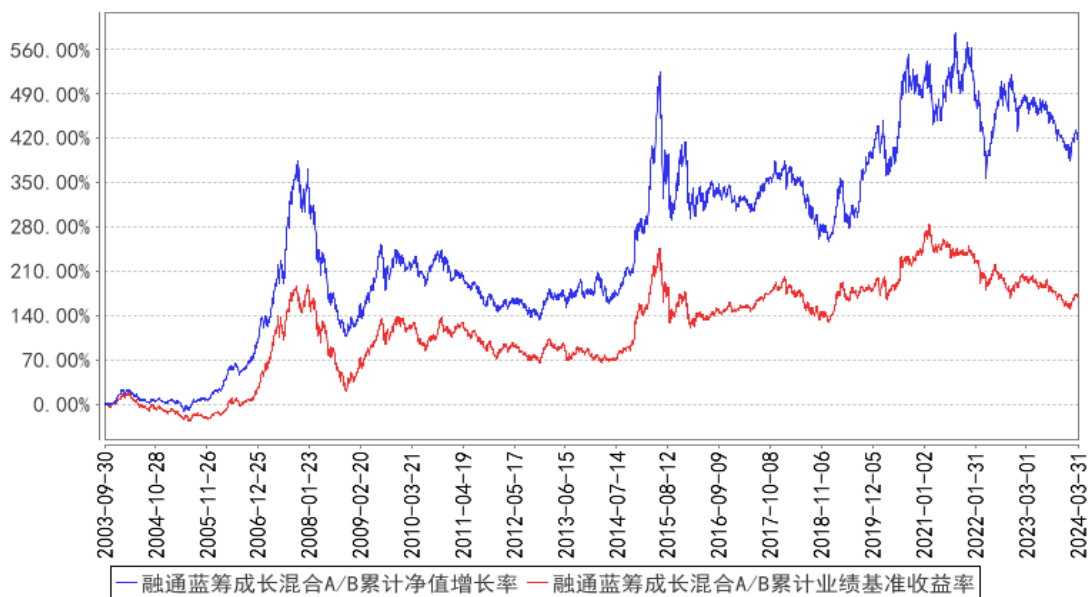
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.41%	0.90%	2.72%	0.77%	0.69%	0.13%
过去六个月	-3.37%	0.75%	-2.49%	0.68%	-0.88%	0.07%
过去一年	-8.40%	0.72%	-8.79%	0.67%	0.39%	0.05%
过去三年	-5.60%	1.07%	-21.69%	0.79%	16.09%	0.28%
过去五年	19.91%	1.19%	-3.40%	0.88%	23.31%	0.31%
自基金合同 生效起至今	428.22%	1.25%	170.47%	1.20%	257.75%	0.05%

融通蓝筹成长混合 C

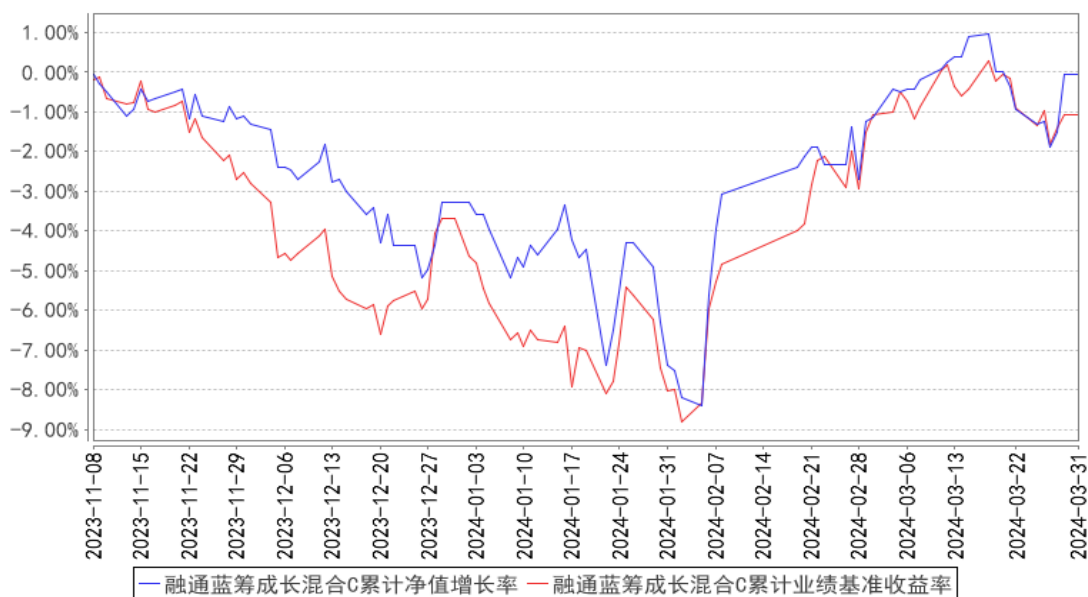
阶段	净值增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	3.34%	0.89%	2.72%	0.77%	0.62%	0.12%
自基金合同 生效起至今	-0.06%	0.76%	-1.06%	0.69%	1.00%	0.07%

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

融通蓝筹成长混合A/B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



融通蓝筹成长混合C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：1、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%”。

2、本基金于2023年11月7日增设C类份额，该类份额首次确认日为2023年11月8日，故本基金C类份额的统计区间为2023年11月8日至本报告期末。

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		
关山	本基金的基金经理、研究部副总监	2023 年 2 月 18 日	-	18 年	关山女士，金融学硕士，18 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。2006 年 3 月加入融通基金管理有限公司，历任纺织服装行业研究员、餐饮旅游行业研究员、轻工制造行业研究员、消费行业研究组组长、融通跨界成长灵活配置混合型证券投资基金基金经理、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、融通消费升级混合型证券投资基金基金经理、融通互联网传媒灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现任研究部副总监、融通新消费灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通新区新经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理、融通动力先锋混合型证券投资基金基金经理、融通消费升级混合型证券投资基金基金经理、融通蓝筹成长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

2024 年 1 季度市场经历了大幅震荡行情，年初对于整个经济预期非常悲观，随着政策的逐步呵护，市场表现出快速的修复。由于整个情绪的扰动，市场对于红利类资产及主题类资产相对偏好，表现出以石油煤炭和 AI 低空经济的较大涨幅。

我们组合延续上年度配置思路，在服装，黄金珠宝，家电等板块有较多的配置。接下来将进入年报及 1 季报密集披露期，我们也将根据报表信息对于相关公司的变化进行重点甄别。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末融通蓝筹成长混合 A/B 基金份额净值为 1.366 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.41%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%；

截至本报告期末融通蓝筹成长混合 C 基金份额净值为 1.363 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.34%，同期业绩比较基准收益率为 2.72%。

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	317,197,365.50	71.49
	其中：股票	317,197,365.50	71.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	111,855,129.43	25.21
	其中：债券	111,855,129.43	25.21
	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	12,825,700.31	2.89
8	其他资产	1,814,631.98	0.41
9	合计	443,692,827.22	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	14,408,410.00	3.27
B	采矿业	2,489,184.00	0.57
C	制造业	216,008,377.13	49.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	23,745,753.28	5.39
G	交通运输、仓储和邮政业	11,515,808.77	2.62
H	住宿和餐饮业	4,123,224.00	0.94
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,226,422.70	1.64
J	金融业	2,206,080.00	0.50
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,097.60	0.00
M	科学研究和技术服务业	1,868,710.58	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	20,829,601.64	4.73
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,141,657.80	1.40
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,631,038.00	1.51
S	综合	-	-
	合计	317,197,365.50	72.05

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	002154	报喜鸟	3,875,400	23,058,630.00	5.24
2	000333	美的集团	350,000	22,477,000.00	5.11
3	002832	比音勒芬	697,899	20,371,671.81	4.63
4	600612	老凤祥	190,700	16,308,664.00	3.70
5	600398	海澜之家	1,493,100	13,437,900.00	3.05
6	600916	中国黄金	1,004,500	11,310,670.00	2.57
7	600887	伊利股份	369,000	10,295,100.00	2.34
8	003006	百亚股份	544,100	9,184,408.00	2.09
9	600054	黄山旅游	745,235	9,106,771.70	2.07
10	000858	五粮液	58,700	9,011,037.00	2.05

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	111,855,129.43	25.41
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
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	111,855,129.43	25.41

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	230016	23 付息国债 16	900,000	91,009,401.64	20.67
2	200017	20 付息国债 17	100,000	10,544,540.98	2.40
3	200006	20 付息国债 06	100,000	10,301,186.81	2.34

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是否出现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的发行主体本期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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

无。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	57,033.34
2	应收证券清算款	1,750,521.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,076.94
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,814,631.98

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

项目	融通蓝筹成长混合 A/B	融通蓝筹成长混合 C
----	--------------	------------

报告期期初基金份额总额	324,565,386.58	730.46
报告期期间基金总申购份额	1,858,284.99	53,072.16
减:报告期期间基金总赎回份额	4,203,277.63	42,470.94
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	322,220,393.94	11,331.68

§ 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

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,或登录本基金管理人网站

<http://www.rtfund.com> 查阅。

融通基金管理有限公司

2024 年 4 月 19 日