融通新蓝筹证券投资基金

更新招募说明书摘要

（2009年第2号）

重要提示

融通新蓝筹证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]41号文核准公开发售。核准日期为2002年7月25日。本基金为契约型开放式基金，基金合同生效日为2002年9月13日。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为2009年9月13日，有关财务数据和净值表现截止日为2009年6月30日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日

2002年9月13日

二、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

设立日期：2001年5月22日

法定代表人：孟立坤

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

电话：（0755）26948041

联系人：李英华

注册资本：12500万元人民币

目前公司股东及出资比例为：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%。

（二）主要人员情况

1、董事会成员

董事长孟立坤先生，工学博士，现任新时代证券有限责任公司董事，历任河北证券有限责任公司北京营业部总经理、公司总裁助理（副总裁级）。

独立董事曹凤岐先生，教授，现任北京大学光华管理学院教授、北京大学金融与证券研究中心主任、国务院学位委员会学科评议组成员、中国金融学会常务理事、北京市金融学会副会长。历任北京大学经济系讲师；北京大学经济学院副教授、教授。

独立董事林义相先生，经济学博士，现任天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。历任法国储蓄与信托银行股票投资分析师；中国证券监督管理委员会高级专家、研究信息部副主任、证券交易监控系统负责人；华夏证券有限公司副总裁，2001年至今，任职天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。

独立董事强力先生，教授。现任西北政法学院教授、经济法系副主任、经济法学硕士研究生导师、金融证券法研究中心主任。

董事冯国安先生，工商管理硕士，现任日兴资产管理有限公司基金经理。历任花旗银行东京分行投资分析员；香港东方汇理资产管理公司基金经理；香港花旗银行私人银行部客户经理；2005年至今，任职日兴资产管理有限公司中国基金的投资与调研团队主管。

董事Allen Yan（颜锡廉）先生，工商管理硕士，现任日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。历任美国富达投资公司财务分析员；日本富达投资公司财务经理；2006年至今，任职日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。

董事马金声先生，高级经济师，现任新时代证券有限责任公司董事长。历任中国人民银行办公厅副主任、主任，金银管理司司长；中国农业发展银行副行长；国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长；华林证券有限责任公司党委书记。2006年至今，任新时代证券有限责任公司董事长。

董事吕秋梅女士，工商管理硕士，现任融通基金管理有限公司总经理。历任国信证券有限公司总裁助理；鹏华基金管理有限公司副总经理。2001年至今，历任融通基金管理有限公司常务副总经理、总经理。

董事吴冶平先生，经济学硕士，现任融通基金管理有限公司督察长。历任中国银行深圳国际信托咨询公司证券发行部项目经理；深圳市安信财务顾问有限公司上市策划部经理；华夏证券有限公司深圳分公司企业购并部经理；国信证券有限公司投资银行总部副总经理、公司研究部总经理；鹏华基金管理有限公司监事、研究部总监、基金经理助理。2001年至今，历任融通基金管理有限公司监察稽核部总监、督察长。

2、监事

监事程燕春先生，高级经济师，现任融通基金管理有限公司上海分公司总经理。历任中国建设银行南昌市分行城北支行行长；中国建设银行基金托管部市场处负责人。2001年至今，历任融通基金管理有限公司总经理助理、上海分公司总经理。

3、总经理及其他高级管理人员

总经理吕秋梅女士，同上。

副总经理刘模林先生，机械工程硕士。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；融通基金管理有限公司研究策划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，现同时担任融通领先成长股票基金（LOF）基金经理和融通新蓝筹混合基金基金经理。

副总经理秦玮先生，工学硕士。历任中国工商银行深圳分行格兰信息咨询公司总经理助理、鹏华基金管理有限公司行政部总监；2002年至今，历任融通基金管理有限公司登记清算部总监、总经理助理。

督察长吴冶平先生，同上。

4、本基金基金经理

（1）现任基金经理情况

刘模林先生，简历同上。在任职本基金基金经理前，刘模林先生担任通宝证券投资基金基金经理。

张敏先生，研究生学历。2005年毕业于南开大学金融工程学院。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，任融通基金管理有限公司行业研究员、基金经理助理。

（2）历任基金经理情况

自2002年9月13日至2004年7月20日期间，由詹凌蔚先生担任本基金基金经理。

自2004年7月21日起至2007年9月27日期间，由刘模林先生担任本基金基金经理。

自2007年9月28日起至2009年7月22日期间，由刘模林先生与戴春平先生共同担任本基金基金经理。

自2009年7月23日起至2009年8月25日期间，由刘模林先生担任本基金基金经理。

自2009年8月26日起至今，由刘模林先生与张敏先生共同担任本基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人：郭树清

成立时间：2004年09月17日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号

联系人：尹东

联系电话：（010）6759 5003

中国建设银行股份有限公司拥有悠久的经营历史，其前身“中国人民建设银行”于1954年成立，1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立，承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行（股票代号：HK0939）于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市，是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日，中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后建设银行的已发行股份总数为：233,689,084,000股（包括224,689,084,000股H股及9,000,000,000股A股）。

2008年，中国建设银行的综合盈利能力和资产质量继续同业领先，截止2008年12月31日，中国建设银行实现净利润926.4亿元，较上年增长34%；平均资产回报率为1.3%，平均股东权益回报率为20.7%，分别较上年提高0.16个百分点和1.18个百分点，居全球银行业最好水平；每股盈利为0.4元，比上年增长0.10元；总资产达到75,554.52亿元，较上年增长14.51%；资产质量稳步上升，不良贷款颓和不良贷款率实现双降，信贷资产质量持续改善，不良贷款率为2.21%，较上年下降0.39个百分点；拨备水平充分，拨备覆盖率为131.58%，较上年提升27.17个百分点。

中国建设银行在中国内地设有1.4万余个分支机构，并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行，在伦敦、纽约、悉尼设有代表处，纽约分行、伦敦子银行正式获颁营业执照。中国建设银行在香港拥有建行亚洲和建银国际两家全资子公司。全行已安装运行自动柜员机（ATM）31,896台，居全球银行业首位。

2008年，中国建设银行在英国《金融时报》公布的「全球500强」中列第20位；在美国《财富》杂志公布的全球企业500强中由上年的第230位上升至第171位；被《福布斯（亚太版）》评为“亚太地区最佳上市公司50强”；被《银行家》杂志评为“中国商业银行竞争力（财务指标）第一名”和“最佳商业银行”；被美国《环球金融》杂志 评为“最佳公司贷款银行”和“最佳按揭贷款银行”；荣获香港上市公司商会“公司管治卓越奖”、《亚洲银行家》杂志“零售风险管理卓越奖”、中国民政部颁发的“中华慈善奖－最具爱心内资企业奖”和香港《财资》杂志“中国最佳境外客户境内托管银行奖”等奖项。

中国建设银行总行设投资托管服务部，下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资托管团队、涉外资产核算团队、养老金托管服务团队、养老金托管市场团队、上海备份中心等12个职能处室，现有员工130余人。2008年，中国建设银行一次性通过了根据美国注册会计师协会（AICPA）颁布的审计准则公告第70号（SAS70）进行的内部控制审计，安永会计师事务为此提交了“业内最干净的无保留意见的报告”，中国建设银行成为取得国际同业普遍认同并接受的SAS70国际专项认证的托管银行。

2、主要人员情况

罗中涛，投资托管服务部总经理，曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作，对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部，对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

3、基金托管业务经营情况

截止到2009年6月30日，中国建设银行已托管华夏兴华封闭、华夏兴和封闭、嘉实泰和封闭、国泰金鑫封闭、国泰金盛封闭、融通通乾封闭、银河银丰封闭等7只封闭式证券投资基金，以及华夏成长混合、融通新蓝筹混合、博时价值增长混合、华宝兴业宝康配置混合、华宝兴业宝康消费品股票、华宝兴业宝康债券、博时裕富指数、长城久恒平衡混合、银华保本增值混合、华夏现金增利货币、华宝兴业多策略股票、国泰金马稳健混合、银华－道琼斯88指数、上投摩根中国优势混合、东方龙混合、博时主题行业股票（LOF）、华富竞争力优选混合、华宝兴业现金宝货币、上投摩根货币、华夏红利混合、博时稳定价值债券、银华价值优选股票、上投摩根阿尔法股票、中信红利股票、工银货币、长城消费增值股票、华安上证180ETF、上投摩根双息平衡混合、泰达荷银效率优选混合（LOF）、华夏中小板ETF、交银稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华富货币、工银精选平衡混合、鹏华价值优势股票（LOF）、中信稳定双利债券、华安宏利股票、上投摩根成长先锋股票、博时价值增长贰号混合、海富通风格优势股票、银华富裕主题股票、华夏优势增长股票、信诚精萃成长股票、工银稳健成长股票、信达澳银领先增长股票、诺德价值优势股票、工银增强收益债券、国泰金鼎价值混合、富国天博创新股票、融通领先成长股票（LOF）、华宝兴业行业精选股票、工银红利股票、泰达荷银市值优选股票、长城品牌优选股票、交银蓝筹股票、华夏全球股票（QDII）、易方达增强回报债券、南方盛元红利股票、交银增利债券、工银添利债券、宝盈资源优选股票、华安稳定收益债券、兴业社会责任股票、华宝兴业海外中国股票（QDII）、海富通中国海外股票（QDII）、宝盈增强收益债券、鹏华丰收债券、博时特许价值股票、华富收益增强债券、信诚盛世蓝筹股票、东方策略成长股票、中欧新蓝筹混合、汇丰晋信2026周期混合、信达澳银精华配置混合、大成强化收益债券、交银环球精选股票（QDII）、长城稳健增利债券、华商盛世成长股票、信诚三得益债券、长盛积极配置债券、鹏华盛世创新股票（LOF）、华安核心股票、富国天丰强化债券、光大保德信增利收益债券、诺德灵活配置混合、东吴优信稳健债券、银华增强收益债券、东方稳健回报债券、华富策略精选混合、长城双动力股票、上投摩根中小盘股票、华商收益增强债券、泰达荷银品质生活股票、光大保德信均衡精选股票、银河行业优选股票、海富通领先成长股票、诺德增强收益债券、工银瑞信沪深300指数、信诚经典优债债券、国泰双利债券、民生加银品牌蓝筹混合、信达澳银稳定价值债券、中欧稳健收益债券、万家精选股票、浦银安盛精致生活混合、长盛同庆可分离交易股票、富国优化增强债券、长城景气行业龙头混合等108只开放式证券投资基金。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构：

（1）融通基金管理有限公司深圳投资理财中心

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

邮政编码：518053

联系人：卢钟

电话：（0755）26948064

传真：（0755）26935005

客户服务中心电话：400-883-8088（免长途通话费用）、（0755）26948088

（2）融通基金管理有限公司北京分公司

地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座1241-1243室

邮编：100140

联系人：宋雅萍

电话：（010）66190975

传真：（010）88091635

（3）融通基金管理有限公司上海分公司

地址：上海市浦东南路588号浦发大厦27层I、J单元

邮编：200120

联系人：林文兵

电话：（021）38424882

传真：（021）38424884

2、代销机构：

（1）中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街25号

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

（2）交通银行股份有限公司

注册地址：上海市仙霞路18号

法定代表人：蒋超良

联系人：王玮

电话：（021）58781234

传真：（021）58408842

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

（3）深圳发展银行

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：蓝德彰

联系人：周勤

电话：（0755）82088888转8811

传真：（0755）82080714

客户服务电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

（4）招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：秦晓

联系人：朱小姐、刘小姐

电话：（0755）83195834、83195771

传真：（0755）83195049

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

（5）国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：（021）62580818转213

传真：（021）62583439

客户服务电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

（6）中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：黎晓宏

联系人：权唐

电话：（010）65186758

传真：（010）65182261

客户服务电话：400-8888-108（免长途费）

网址：www.csc108.com

（7）国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

办公地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：何如

联系人：林建闽

电话：（0755）82130833转2181

传真：（0755）82133302

客户服务电话：800-810-8868

网址：www.newone.com.cn

（9）联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

办公地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、24、25层

法定代表人：马国强

联系人：盛宗凌

电话：（0755）82493561

传真：（0755）82492187

客户服务电话：400-8888-555，（0755）25125666

网址：www.lhzq.com

（10）长江证券股份有限公司

联系地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：（021）63219781

传真：（021）51062920

联系人：李良

（11）东吴证券有限责任公司

注册地址：江苏省苏州市十梓街298号

办公地址：江苏省苏州市十梓街298号

法定代表人：吴永敏

联系人：方晓丹

电话：（0512）65581136

传真：（0512）65588021

客户服务电话：（0512）96288

网址：www.dwzq.com.cn

（12）广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场36、37、41和42楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

电话：（020）87555888

传真：（020）87557985

客户服务电话：（020）87555888转各营业网点

网址：www.gf.com.cn

（13）中国银河证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：朱利

联系人：郭京华

电话：（010）66568587

传真：（010）66568536

客户服务电话：（010）68016655

网址：www.chinastock.com.cn

（14）中信证券股份有限公司

注册地址：深圳市湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址：北京朝阳区新源南路6号京城大厦

法定代表人：王东明

联系人：陈忠

电话：（010）84864818转63266

传真：（010）84865560

客户服务电话：（010）84864818转63266

网址：www.ecitic.com

（15）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东大道720号20楼

办公地址：上海市巨鹿路756号

法定代表人：王益民

联系人：盛云

电话：（021）62568800转3019

客户服务电话：（021）962506

网址：www.dfzq.com.cn

（16）山西证券有限责任公司

注册地址：山西省太原市迎泽大街282号

办公地址：山西省太原市府西街69号

法定代表人：吴晋安

联系人：邹连星、刘文康

电话：（0351）8686766、（0351）8686708

客户服务电话：（0351）8686868

网址：www.i618.com.cn

（17）中信金通证券有限责任公司

注册地址：杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人：刘军

电话：（0571）85783750

联系人：龚晓军

（18）中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市东海路28号

法定代表人：史洁民

联系人：李钢

电话：（0532）85023905

传真：（0532）85023905

客户服务热线：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

（19）渤海证券有限责任公司

注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号

办公地址：天津市河西区宾水道3号

法定代表人：张志军

联系人：徐焕强

电话：（022）28451883

传真：（022）28451892

客户服务热线：（022）28455588

网址：www.ewww.com.cn

（20）万联证券有限责任公司

注册地址：东风东路836号东峻广场3座34-35楼

法定代表人：陆慧奎

联系人：徐松

电话：（020）87693617

传真：（020）87691530

网址：www.wlzq.com.cn

（21）民生证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区朝外大街16号中国人寿大厦1901室

法人代表：岳献春

联系人：杨甦华

电话：（010）85252564

传真：（010）85252655

客户服务电话：（0371）7639999

网址：www.mszq.com

（22）长城证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17楼

法定代表人：魏云鹏

联系人：高峰

电话：（0755）83516094

传真：（0755）83516199

客户服务电话：（0755）82288968

网址：www.cc168.com.cn

（23）光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔15-16楼

法定代表人：王明权

联系人：刘晨

电话：（021）68816000转1587

传真：（021）68817271

客户服务电话：（021）68816770

网址：www.ebscn.com

（24）平安证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区八卦三路平安大厦3楼

法定代表人：杨秀丽

联系人：余江

电话：（0755）82440136、82450826

传真：（0755）82433794

客户服务电话：95511、（0755）82440136

网址：www.pa18.com

（25）华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市阜南路166号

法定代表人：汪永平

联系人：唐泳

电话：（0551）5161671

传真：（0551）5161672

客户服务电话：（0551）5161671

网址：www.hazq.com或www.huaans.com.cn

（26）国联证券有限责任公司

注册地址：无锡市县前东街8号

法定代表人：范炎

联系人：袁丽萍

电话：（0510）2831662

传真：（0510）2831589

客户服务电话：（0510）2588168

网址：www.glsc.com.cn

（27）金元证券有限责任公司

联系地址：深圳市深南大道4001号时代金融中心17层

法定代表人：陆涛

联系人：张萍

电话：（0755）83025022

传真：（0755）83025625

网址：www.jyzq.cn

（28）国都证券有限责任公司

联系地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人：王少华

联系人：马泽承

电话：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（29）第一创业证券有限责任公司

联系地址：深圳市笋岗路中民时代广场b座25楼

法定代表人：刘学民

联系人：梁少珍

电话：（0755）25832493

传真：（0755）25831718

网址：www.firstcapital.com.cn

（30）东北证券有限责任公司

联系地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：李树

联系人：高新宇

电话：（0431）5096710

传真：（0431）5680032

网址：www.nesc.cn

（31）国盛证券有限责任公司

联系地址：江西省南昌市永叔路15号信达大厦10-13楼

法定代表人：管荣升

联系人：万齐志

电话：（0791）6289771

传真：（0791）6289395

网址：www.gsstock.com

（32）宏源证券股份有限公司

联系地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦b座6层

法定代表人：汤世生

联系人：张智红

电话：（010）62267799转6416

传真：（010）62294470

网址：www.ehongyuan.com.cn

（33）信泰证券有限责任公司

联系地址：南京市长江路88号

法定代表人：钱凯法

联系人：舒萌菲

电话：（025）84784782

传真：（025）84784830

网址：www.thope.com

（34）恒泰证券有限责任公司

联系地址：呼和浩特市新城区东风路111号

法定代表人：刘汝军

联系人：魏华

电话：（0471）4961259

传真：（0471）4961259

网址：www.cnht.com.cn

（35）华龙证券有限责任公司

联系地址：甘肃省兰州市静宁路138号

法定代表人：李晓安

联系人：王宝国

电话：（0931）4890068

传真：（0931）4890515

网址：www.hlzqgs.com

（36）上海银行

联系地址：上海市中山东二路585号

法定代表人：陈辛

联系人：张洁

电话：（021）63371293

传真：（021）63370777

网址：www.bankofshanghai.com

（37）兴业证券股份有限公司

联系地址：福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

联系人：杨盛芳

电话：（021）68419393

传真：（021）68419867

网址：www.xyzq.com.cn

（38）中国工商银行

联系地址：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

联系人：田耕

电话：（010）66107900

传真：（010）66107914

网址：www.icbc.com.cn

（39）海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：（021）23219275

联系人：李笑鸣

（40）中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

传真：（010）66594946

客服电话：95566

网址：www.boc.cn

（41）中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路甲4号

法定代表人：董文标

联系电话：95568

联系人：吴杰

（42）北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街17号北京银行大厦

法定代表人：阎冰竹

联系电话：（010）66223248

联系人：（010）66223248

联系人：杨永杰

（43）新时代证券有限责任公司

注册地址：北京市海淀区成府路298号方正大厦二层

法定代表人：李文义

电话：（010）66423531

联系人：戴荻

（44）安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路2222号安联大厦34层、28层A02单元

法定代表人：牛冠兴

电话：（0755）82825555

联系人：李瑾

（45）中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

电话：（010）65541585

联系人：李博

（46）中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

电话：（010）68098778

联系人：李伟

（47）西部证券股份有限公司

注册地址：西安市东新街232号陕西信托大厦16－17层

法定代表人：刘建武

电话：（029）87406172

联系人：黄晓军

（48）方正证券有限责任公司

办公地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段华侨国际大厦22－24层

法定代表人：雷杰

电话：（0571）87782047

联系人：邢铁英

（49）深圳平安银行股份有限公司

办公地址：深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：孙建一

电话：（0755）25859591

联系人：霍兆龙

（50）国元证券有限责任公司

注册地址：合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：95578

联系人：程维

（51）华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：翟鸿祥

电话：（010）85238423

联系人：陈宇

（52）上海证券有限责任公司

办公地址：上海市银城中路168号

法定代表人：陈辛

电话：（021）68475888

联系人：张萍

（53）天相投资顾问有限公司

办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层

法定代表人：林义相

电话：（010）66045577

联系人：林爽

（54）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：95597

联系人：李金龙

（二）注册登记人

名称：融通基金管理有限公司

注册地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦13、14层

邮政编码：518053

法定代表人：孟立坤

经营范围：基金管理业务；发起设立基金。

存续期间：50年

组织形式：有限责任公司

注册资本：12500万元

电话：（0755）26948075

联系人：杜嘉

（三）律师事务所和经办律师

名称：康达律师事务所

注册地址：北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦703室

办公地址：北京市朝阳区建国门外大街19号国际大厦703室

法定代表人：佛洋

经办律师：娄爱东、杜玉兰

电话：（010）85262828

传真：（010）85262826

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称：安永华明会计师事务所

注册地址：北京朝阳区北大街6号北海万泰大厦802—807

办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城东三办公楼16层

法定发表人：葛明

经办注册会计师：李地、樊淑华

电话：（010）58153000

传真：（010）85188298

五、基金名称

融通新蓝筹证券投资基金

六、基金类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

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，为基金份额持有人获取长期稳定的投资收益。

八、基金的投资方向

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、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于“新蓝筹”组合的股票资产将不低于股票总资产的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。

九、基金的投资策略

（一）决策依据

1、国家宏观经济环境；

2、国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定；

3、货币政策、利率走势；

4、地区及行业发展状况；

5、上市公司研究；

6、证券市场的走势。

（二）决策程序

本基金管理人内部设立基金管理部、研究策划部、基金交易部、监察稽核部、投资决策委员会和风险控制委员会，进行基金资产的投资和风险控制。基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下：

1、研究策划部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告，并在此基础上进行投资论证，作出投资建议提交给基金经理，并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

2、基金经理根据研究策划部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布，形成资产配置提案报投资决策委员会。

3、投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案，形成资产配置计划书。

4、基金经理根据投资决策委员会的决策，制定相应的投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

5、基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划，并以投资指令的形式下达至基金交易部。

6、基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

7、风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督，投资组合方案执行完毕，基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

（三）投资组合

投资组合的原则是追求收益性、流动性和安全性的有机结合。结合本基金的“新蓝筹”投资理念，本基金投资组合在保持基金资产流动性的条件下，将以获取资本增值为主。

本基金可投资于国债、金融债、企业债（包括可转债）和权证，以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动，使得基金收益表现更加稳定；同时满足基金资产对流动性的要求。

本基金的投资组合必须符合以下规定：

1、本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%，本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；

2、本基金持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；

3、本基金持有的全部权证，其市值不超过基金资产净值的3%；

4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

5、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有的同一权证不得超过该权证流通量的10%。本基金在任何交易日买入权证的总金额，不超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

6、基金建仓期：自基金开始运作之日起，将在六个月内达到上述第（1）条、“投资范围”中关于投资于新蓝筹企业的比例规定以及“投资策略”中关于股票投资比例浮动范围、债券投资比例浮动范围、现金留存比例浮动范围的有关规定；

7、本基金可投资于资产支持证券：

A、持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例不得超过该资产支持证券规模的10%。

B、投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例不得超过基金资产净值的10%。

C、与基金管理人管理的其它基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%。

D、本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过该基金资产净值的20%。

E、因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第B项和第D项规定的比例，基金管理人将在10交易日内调整完毕。

F、投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。

G、基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出。

8、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致投资组合超出上述比例不在限制之内，但基金管理人应在法规规定的期限内进行调整，以达到上述标准。

（四）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%。

1、资产配置

贯彻“自上而下”的投资策略，结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互补的股票资产和债券资产的投资比例。

2、行业资产配置

在“新蓝筹”投资理念的指导下，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，确定股票资产在不同行业的投资比例。

3、债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质，综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素；另一方面考虑宏观经济数据，包括通货膨胀率、商品价格和GDP增长等因素。

4、股票选择

股票投资中将以“新蓝筹”资本增值型投资为主导，把企业的未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。致力于建立完善的数理统计体系，利用数理分析方法检验不同的投资方法和投资思路，对市场运行特征进行跟踪，确保基金投资决策的科学性。同时重视对趋势的把握，顺势而为，灵活操作。

“新蓝筹”企业的主要选择标准是：

（1）行业发展状况良好，企业处于成长阶段或成熟阶段的早期，企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力；过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于6%或者GDP增长率；

（2）企业成长性较好，市场竞争能力强，主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性；

（3）企业盈利能力较强，主营业务盈利水平较高；财务管理能力较强，现金收支安排有序，资产盈利水平较高；

（4）企业财务状况良好，具备一定的规模优势和较好的抗风险能力；

（5）企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势，有良好的市场知名度和较好的品牌效应，处于行业龙头地位；

（6）企业管理层开拓进取，具备企业家素质，建立了科学的管理和组织架构。

5、权证投资策略

（1）投资策略

根据权证作为衍生品种本身的特性和作用，公司在基金投资权证上主要运用以下投资策略：基于标的证券未来合理估值范围分析及权证定量分析基础上的头寸保护策略及跨式权证投资策略；基于权证杠杆比率及Delta对冲比率分析基础上的权证替换投资策略；基于Black-Scholes等权证合理定价分析方法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。

（2）风险控制措施

1）实行投资授权控制，确保权证投资的审慎性。

2）实行投资流程控制，在充分研究的基础上参与权证的投资。权证投资必须有公司内部研究报告的支持，研究报告需包含权证标的证券的投资价值分析以及权证投资价值金融工程定量分析。

3）公司监察稽核部依据相关管理规定对权证投资管理过程的合规性进行检查。

6、资产支持证券的投资策略及风险控制措施

A、投资策略

在确保与基金投资目标相一致的前提下，可本着谨慎和风险可控的原则，为取得与承担风险相称的收益，投资于资产支持证券。

a、买入持有策略

可在与投资目标一致的前提下，买入并持有资产支持证券，以获取相应的利息收入。

b、利率预期策略

根据对利率趋势、提前还款率等的预期，预测资产支持证券收益率的变化趋势，从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

c、信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估，分析预期违约率和违约损失率的变化趋势，评估其信用利差是否合理，并预测其变化趋势，通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

d、相对价值策略

通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标，将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较，确定其是否具有相对价值，从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

B、风险控制措施

a、通过严格的投资流程控制投资风险，基金经理及有关人员必须严格执行公司投资授权制度。

b、在投资资产支持证券时，首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议，基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限，参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告，充分评估资产支持证券的风险收益特征，确定具体投资方案，在严格控制风险的前提下，谨慎进行投资。

c、基金交易部负责具体的交易执行，同时履行一线监控的职责，监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

d、固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估，密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素，并在投资中进行相应操作，以规避信用风险的上升。

e、固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型，并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素，并评估其对资产支持证券持有期收益的影响，并进行相应的投资操作。

f、基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排，并考虑其对基金资产流动性的影响，分散投资，确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

g、基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素，并评估其对资产支持证券投资价值的影响，并进行相应的投资决策。

h、将不断完善内部控制制度及相应技术手段，使基金相关操作以谨慎安全的方式进行，确保基金及持有人利益得到保障。

i、将严格审查所投资资产支持证券的法律文件，确保各业务环节都有适当的法律保障。

十、基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的比较基准是“国泰君安指数”。国泰君安指数于1997年底开始编制，是国内较早的同时反映两个市场的统一指数。该指数采用流通股加权的方式计算，涵盖所有在上海、深圳上市的A股上市公司，具有较好的连续性和可比性。

十一、基金的风险收益特征

在适度风险下追求较高收益。

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董