

融通通利系列证券投资基金

2006 年年度报告

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

送出日期：2007 年 3 月 27 日

重要提示

本系列开放式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。

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本系列基金合同规定，于 2007 年 3 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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系列基金的招募说明书。

目录

一、基金简介	1
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况	2
(一) 主要财务指标	2
(二) 基金净值表现	3
(三) 收益分配情况	6
三、管理人报告	7
(一) 基金管理人及基金经理简介	7
(二) 基金运作合规性说明	7
(三) 基金经理报告	7
(四) 基金内部监察报告	9
四、托管人报告	9
五、审计报告	10
(一) 融通债券投资基金审计报告	10
(二) 融通深证 100 指数证券投资基金审计报告	10
(三) 融通蓝筹成长证券投资基金审计报告	10
六、财务会计报告	11
(一) 融通债券基金财务会计报告	12
(二) 融通深证 100 指数基金财务会计报告	19
(三) 融通蓝筹成长基金财务会计报告	27
七、投资组合报告	36
(一) 融通债券基金投资组合报告	36
(二) 融通深证 100 指数基金投资组合报告	37
(三) 融通蓝筹成长基金投资组合报告	42
八、基金份额持有人户数、持有人结构	45
九、开放式基金份额变动	46
十、重大事项揭示	46
十一、备查文件目录	50

一、基金简介

（一）基金基本情况

基金名称：融通通利系列证券投资基金。由三只子基金构成，分别是融通债券投资基金、融通深证 100 指数证券投资基金、融通蓝筹成长证券投资基金

基金简称：融通通利系列基金。其中：融通债券投资基金简称融通债券基金、融通深证 100 指数证券投资基金简称融通深证 100 指数基金、融通蓝筹成长证券投资基金简称融通蓝筹成长基金

交易代码：融通债券基金交易代码 161603；融通深证 100 指数基金交易代码 161604；融通蓝筹成长基金交易代码 161605

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

期末基金份额总额：

融通债券基金	214,732,687.42 份
融通深证 100 指数基金	533,327,971.02 份
融通蓝筹成长基金	282,241,429.58 份

基金合同存续期：不定期

（二）基金投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征

1、融通债券基金

投资目标：在强调本金安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略：以组合优化为基本策略，利用收益曲线模型和债券品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，捕捉市场出现的中短期投资机会。

业绩比较基准：全国银行间同业拆借中心编制的银行间债券综合指数。

风险收益特征：属于相对低风险的基金品种。

2、融通深证 100 指数基金

投资目标：运用指数化投资方式，通过控制股票投资组合与深证 100 指数的跟踪误差，力求实现对深证 100 指数的有效跟踪，谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为投资者带来稳定回报。

投资策略：以非债券资产 90%以上的资金对深证 100 指数的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资部分不得低于基金资产的 50%，采用复制法跟踪深证 100 指数，对于因流动性等原因导致无法完全复制深证 100 指数的情况，将采用剩余组合替换等方法避免跟踪误差扩大。

业绩比较基准：深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

本基金于 2005 年 8 月 22 日调整资产配置比例，2005 年 8 月 21 日之前（含此日）为“75%×深证 100 指数 + 25%×银行间债券综合指数”，2005 年 8 月 22 日起采用新的业绩比较基准：深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

风险收益特征：风险和预期收益率接近市场平均水平。

3、融通蓝筹成长基金

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：75%×国泰君安指数 + 25%×银行间债券综合指数。

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。

（三）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

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
 信息披露负责人：吴冶平
 电话：(0755) 26948666
 传真：(0755) 26935005
 电子信箱：wuyp@mail.rtfund.com

(四) 基金托管人概况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）
 注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
 办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
 邮政编码：100032
 法定代表人：姜建清
 信息披露负责人：蒋松云
 电话：(010) 66106912
 传真：(010) 66106904
 电子邮箱：custody@icbc.com.cn

(五) 信息披露

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》
 基金管理人互联网网址：<http://www.rtfund.com>
 报告置备地点：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层融通基金管理有限公司
 北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行资产托管部

(六) 会计师事务所

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
 注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号（邮编：200120）
 办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼（邮编：200021）
 法人代表：杨绍信
 电话：(021) 61238888
 传真：(021) 61238800
 联系人：陈兆欣
 经办注册会计师：汪棣 张立纲

(七) 注册登记机构概况

名称：融通基金管理有限公司
 办公地址：深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(单位：人民币元)

重要提示：本报告所列示的基金业绩指标不包括持有人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。

(一) 主要财务指标

项目	融通债券基金		
	2006 年度	2005 年度	2004 年度
基金本期净收益	40,491,510.68	12,110,157.58	34,408,341.13
加权平均基金份额本期净收益	0.1546	0.0404	0.0657

期末可供分配基金收益	13,973,410.06	10,271,119.09	-5,391,643.99
期末可供分配基金份额收益	0.0651	0.0342	-0.0142
期末基金资产净值	228,706,097.48	310,474,035.03	373,258,871.21
期末基金份额净值	1.065	1.034	0.986
基金加权平均净值收益率	14.87%	3.95%	6.41%
本期基金份额净值增长率	13.75%	7.93%	0.17%
基金份额累计净值增长率	25.93%	10.71%	2.57%

融通深证 100 指数基金			
项目	2006 年度	2005 年度	2004 年度
基金本期净收益	283,029,865.61	-84,686,594.90	39,808,236.22
加权平均基金份额本期净收益	0.5031	-0.0864	0.0513
期末可供分配基金收益	85,438,290.64	-166,578,246.53	-196,207,753.00
期末可供分配基金份额收益	0.1602	-0.1981	-0.1859
期末基金资产净值	713,466,684.50	674,227,284.72	859,247,739.55
期末基金份额净值	1.338	0.802	0.814
基金加权平均净值收益率	48.72%	-11.23%	5.66%
本期基金份额净值增长率	117.23%	-1.47%	-9.56%
基金份额累计净值增长率	101.71%	-7.16%	-5.76%

融通蓝筹成长基金			
项目	2006 年度	2005 年度	2004 年度
基金本期净收益	296,599,884.68	-23,262,107.99	51,217,251.47
加权平均基金份额本期净收益	0.6784	-0.0375	0.0591
期末可供分配基金收益	136,899,674.26	-41,254,024.11	-39,977,698.75
期末可供分配基金份额收益	0.4850	-0.0583	-0.0550
期末基金资产净值	473,852,597.39	728,969,096.48	687,295,605.65
期末基金份额净值	1.679	1.031	0.945
基金加权平均净值收益率	54.27%	-4.03%	5.84%
本期基金份额净值增长率	83.08%	9.10%	-0.46%
基金份额累计净值增长率	107.98%	13.59%	4.12%

(二) 基金净值表现

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

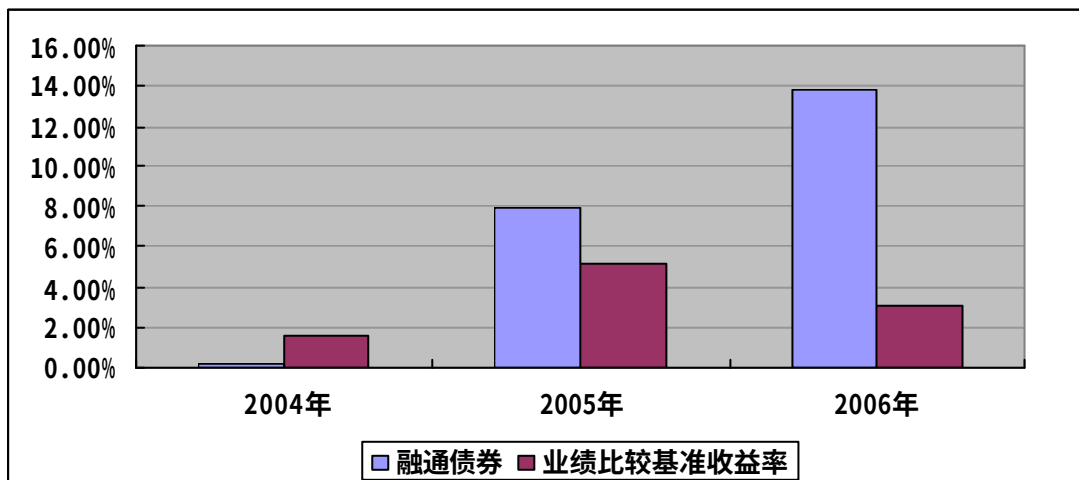
融通债券基金						
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去 3 个月	2.70%	0.13%	0.74%	0.03%	1.96%	0.10%
过去 6 个月	3.50%	0.10%	1.30%	0.06%	2.20%	0.04%
过去 1 年	13.75%	0.23%	3.07%	0.06%	10.68%	0.17%
过去 3 年	22.98%	0.23%	10.08%	0.10%	12.90%	0.12%

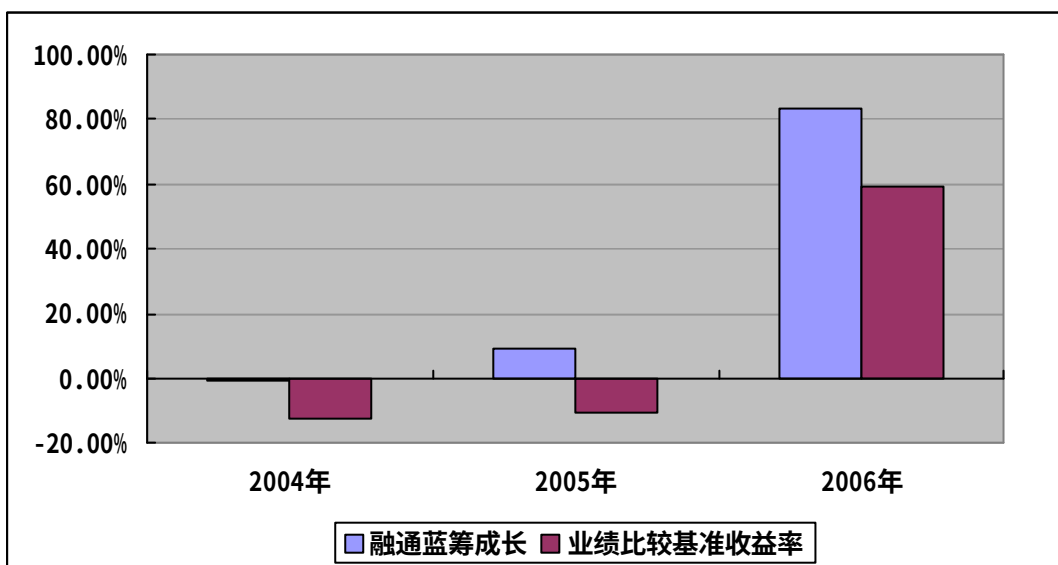
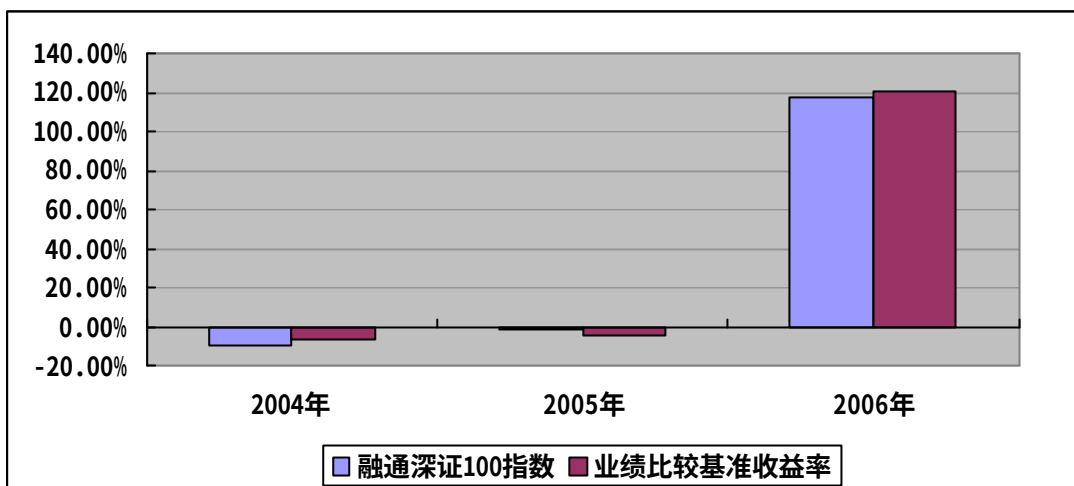
自基金合同生效起至今	25.93%	0.23%	10.96%	0.10%	14.97%	0.12%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

融通深证 100 指数基金						
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 3 个月	37.46%	1.49%	38.95%	1.47%	-1.49%	0.02%
过去 6 个月	36.90%	1.43%	39.30%	1.44%	-2.40%	-0.01%
过去 1 年	117.23%	1.48%	120.93%	1.43%	-3.70%	0.05%
过去 3 年	93.57%	1.27%	98.40%	1.22%	-4.83%	0.05%
自基金合同生效起至今	101.70%	1.23%	109.06%	20.47%	-7.36%	-19.24%

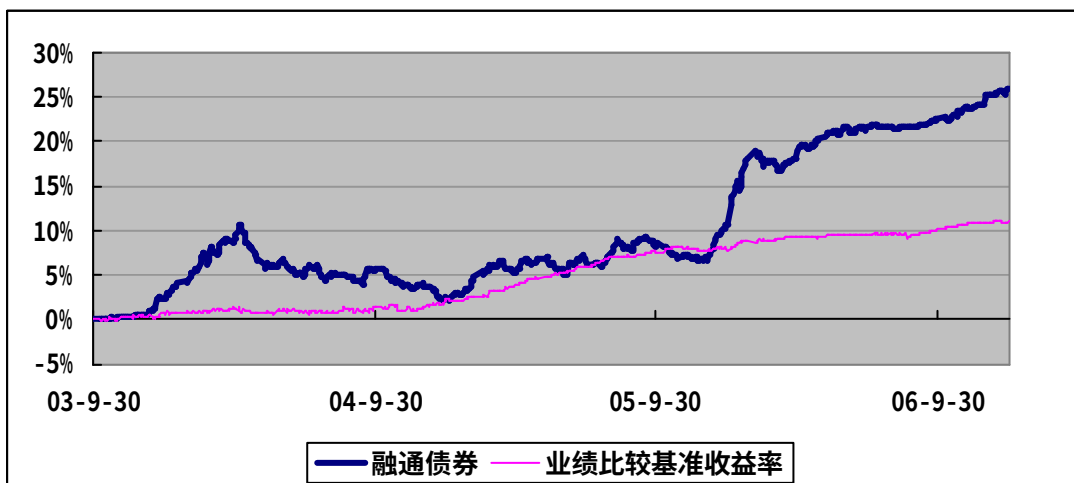
融通蓝筹成长基金						
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去 3 个月	29.35%	1.19%	19.83%	1.01%	9.52%	0.18%
过去 6 个月	26.72%	1.07%	18.87%	1.03%	7.85%	0.04%
过去 1 年	83.08%	0.99%	59.33%	1.10%	23.75%	-0.11%
过去 3 年	98.83%	0.97%	24.95%	1.07%	73.88%	-0.10%
自基金合同生效起至今	107.98%	0.93%	51.93%	1.27%	56.05%	-0.34%

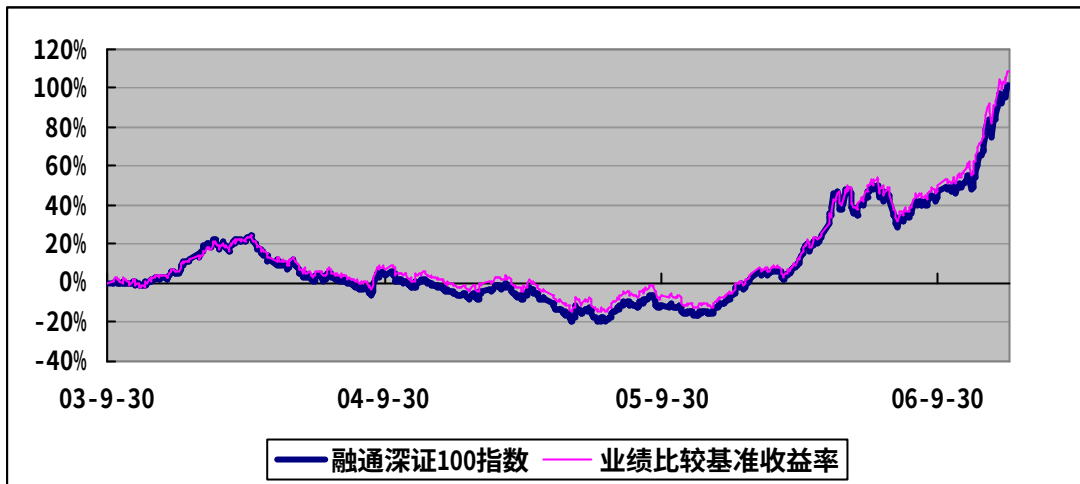
2、基金份额净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



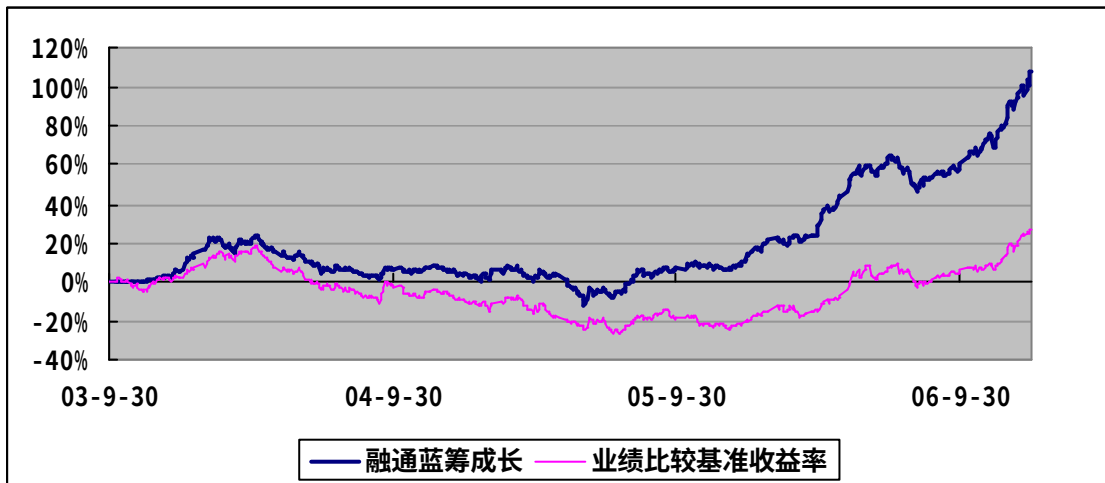


3、累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图





注：上表中深证 100 指数基金业绩比较基准项目分段计算，其中：2005 年 8 月 21 日之前（含此日）采用“75%×深证 100 指数 + 25%×银行间债券综合指数”，2005 年 8 月 22 日起使用新基准即“深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%”。



（三）收益分配情况（最近三年）

1、融通债券基金

	每 10 份基金份额分红数	收益分配总金额
2006 年度	1.040	29,928,674.43
2005 年度	0.300	8,837,348.25
2004 年度	0.410	27,378,651.43
合计	1.750	66,144,674.11

2、融通深证 100 指数基金

	每 10 份基金份额分红数	收益分配总金额
2006 年度	3.000	137,815,546.52
2005 年度	--	--
2004 年度	1.500	56,776,894.47
合计	4.500	194,592,440.99

3、融通蓝筹成长基金

	每 10 份基金份额分红数	收益分配总金额
2006 年度	1.500	68,386,283.55

2005 年度	--	--
2004 年度	1.020	81,994,082.00
合计	2.520	150,380,365.55

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理简介

1、基金管理人及管理基金的情况

融通基金管理有限公司是经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基字[2001]8 号文批准，于 2001 年 5 月 22 日成立。公司股东为：河北证券有限责任公司、陕西省国际信托投资股份有限公司、联合证券有限责任公司和华林证券有限责任公司。

截止到报告披露日，公司管理的基金共有八只，两只为封闭式基金：基金通乾和基金通宝，六只为开放式基金：融通新蓝筹基金、融通通利系列基金、融通行业景气基金、融通巨潮 100 指数基金、融通易支付货币市场基金和融通动力先锋基金，其中融通通利系列基金由融通债券基金、融通深证 100 指数基金和融通蓝筹成长基金三只子基金构成。

2、本系列基金基金经理

陶武彬先生，融通债券基金基金经理，1971 年出生，硕士学位，9 年证券从业经验。曾先后在中国化工建设深圳公司、深圳市深投投资有限公司、香港京华山一证券公司从事证券研究、投资和投资银行等工作，2001 年 1 月加入融通基金管理有限公司，历任行业研究员、研究部总监助理、融通新蓝筹基金经理助理等职。现同时担任融通易支付货币市场基金基金经理。

张野先生，融通深证 100 指数基金基金经理，1962 年出生，工商管理硕士，12 年证券从业经验。历任杭州新希望证券投资顾问有限公司董事长、总经理，融通基金管理有限公司研究员。现同时担任融通巨潮 100 指数基金基金经理。

易万军先生，融通蓝筹成长基金基金经理，1971 年出生，中国科学技术大学少年班经济管理专业本科毕业，14 年证券从业经验。历任中国科技国际信托投资公司武汉代表处股票自营负责人，鹏华基金管理公司基金交易员，上海华源集团恒盛投资管理公司投资总监，融通基金管理有限公司基金交易部总监。

期后事项说明：本基金管理人于 2007 年 3 月 2 日在《中国证券报》、《上海证券报》及《证券时报》上发布《融通基金管理有限公司关于基金经理变更的公告》，决定聘用陈晓生先生、严菲女士担任融通蓝筹成长基金的基金经理职务，免去易万军先生的基金经理职务。

陈晓生先生，1972 年生，经济学硕士，12 年证券从业经验。曾就职于中信集团中大投资管理有限公司，历任证券投资部交易员、期货业务负责人、股票投资经理助理、股票投资经理。2003 年 2 月加入融通基金管理有限公司，历任融通新蓝筹基金经理助理、机构理财部投资经理、副总监，现任机构理财部总监同时兼任日兴黄河基金融通模拟组合组合经理。

严菲女士，1978 年生，经济学硕士，4 年证券从业经验。曾先后就职于日盛嘉富证券国际上海代表处、红塔证券从事证券研究工作。2006 年 7 月加入融通基金管理有限公司任行业研究员。

(二) 基金运作合规性说明

本报告期内，本系列基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、《融通通利系列证券投资基金基金合同》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，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。

(三) 基金经理报告

1、融通债券基金经理报告

流动性过剩是影响 2006 年中国资本市场尤其是债券市场的主基调，市场参与者和货币管理当局共同关注焦点就是贸易顺差不断扩大带来的货币增速过快。虽然人民币有一定程度的升值，但仍未能阻止热钱流入的步伐，外汇占款不断增加。从资金面上看，2006 年资

金状况整体较为宽裕，下半年比上半年略有收紧。上半年银行间 7 天期回购利率基本在 1.5~2.0% 区间内波动，而下半年受宏观调控政策和新股发行等因素影响，利率波动区间上升至 2.0~3.0%。本基金全年取得了 13.75% 的收益，现金分红为 10.4%，远远超越了本基金的比较基准银行间债券指数。

回顾全年的投资过程，第一阶段是本基金在 2006 年年初，依托我们在 05 年下半年坚定买入的招商银行转债、万科转债等优质品种，取得了良好的投资收益。由于股改因素可转债存量急速萎缩，我们的投资重心转向低风险的短期融资券和短期国债品种。2006 年下半年以来，新的可转债发行，新的品种-可分离交易可转债推出，都为本基金提供了新的投资机会。我们继续在招商地产转债和分离的企业债上取得了良好的收益。

展望 2007 年，本基金以本金安全前提下提高收益率为宗旨，继续为持有人提供低风险的绝对收益。最后衷心感谢持有人对我们工作的支持和鼓励。

2、融通深证 100 指数基金经理报告

2006 年的 A 股市场走势牛气冲天，融通深证 100 指数基金的净值收益率为 117.23%，同期深证 100 指数基金基准的涨幅为 120.89%。2006 年深证 100 基金分红 5 次，每份分红 0.3 元。本基金运用指数化投资方式，通过控制股票投资权重与深证 100 指数成份股自然权重的偏离，减少基金相对比较基准的跟踪误差。年内平均日跟踪误差为 0.24%，控制在基金合同要求的 0.5% 以内。

深证 100 指数基金的日常管理主要是努力减少持续大规模申购所带来的跟踪误差。在严格遵守基金合同的前提下实现持有人利益的最大化是本基金管理的核心思想，并将此原则贯彻于基金的运作之中。根据深证 100 指数成份股的资产特征，房地产行业、黑色金属行业与消费类资产的权重较大，受到宏观调控有关政策的影响，几类大的资产的波动性较大，基于我们对宏观经济与政策、行业景气及成份股基本面的分析与研究判断，为了有效减少申购赎回对基金规模较为剧烈的影响和多次分红导致的跟踪误差偏离，对机械制造业、金融行业和大权重个股进行了基金合同允许范围内的适当增强。

展望 2007 年，我国宏观经济增速有所放缓，但仍将保持高增长、低波动的的发展态势。中国证券行业作为中国金融行业的一个子行业，仍然正处于行业成长期的初期。上市公司的治理结构更趋完善，上市公司的盈利能力还将进一步的释放，资本市场的定价权正在本土化。顺应国家政策的思路，我们认为自主创新，人民币升值和金融创新等符合未来经济发展规律和方向的热点仍然是我们的投资主线。尤其是以成长性为主题的装备制造业、生物制药与基因工程、新材料以及金融行业还将在 2007 年受到投资者的青睐。我们对 2007 年的资本市场依然保持乐观的预期！希望投资于巨潮 100 基金的持有人通过理性的投资来充分分享中国经济的持续、稳定、高速增长成果。

3、融通蓝筹成长基金经理报告

2006 年证券市场回顾及基金操作回顾

2006 年是中国股票市场有史以来最为辉煌的一年，我们经历了有股票市场以来从未有过的“只涨不跌”的牛市行情。至 12 月 29 日，上证指数年涨幅达到 130.43%，沪深 300 指数上涨 121.02%。06 年上半年有色金属、食品饮料和装备制造业表现优异，下半年银行、地产以及钢铁等行业涨幅居前，大牛市应该具有的宽度和深度在 2006 年得到很好的体现，市场热点呈现百花齐放的局面，而且板块轮动的特征较为明显。

2006 年蓝筹成长基金年度净值增长 83.08%。本基金坚持重点持有精选个股的投资策略，在市场呈现“百花齐放”的局面中，尽管部分优秀品种如安徽合力、振华港机等带来了不错的收益，但年初较为保守的运作思路，一定程度上影响了本基金全年的业绩表现。基于对行业复苏的判断，本基金第三季度开始较大力度布局钢铁股，四季度开始取得较好的收益。我们将认真总结经验教训，争取在新的一年里为持有人创造较好的回报。

2007 年市场展望及投资思路

股价向下调整的力量有两个，一是估值的压力，二是获利回吐的压力。从静态估值的角度看，06 年底的 A 股已经不便宜了，但仍然在合理的范围。而且现在的上市公司还有很好的成长性，即便当前的估值不再提高的话，基于 2007 年上市公司业绩仍然存在 20-30% 的增长水平的预期，我们认为中国股票市场 2007 年仍然存在 20%-30% 的上涨空间。鉴于我国七年期国债利率仅为 3 点多的水平，我们认为当前中国股票市场平均市盈率处于 25-35 倍之间是可以接受的水平。因此，立足 1 年期的战略布局市场依然存在很大的投资机会，

但所选品种的成长性是非常关键的因素；也就是说，目前估值下 2007 年的市场机会更可能体现为结构性的机会，成长的机会。

我们预期，2007 年牛市仍将继续，但市场将从特殊年份过渡为正常年份，与 06 年相比，市场存在两大特点：市场振荡将加剧、结构分化更加严重。一方面，市场的调整压力将逐步从获利回吐压力向部分资产估值阶段性过高过渡。另一方面，“小非”特别是“大非”在 2007 年下半年的陆续上市给市场带来压力，同时也带来新的结构分化的机会。此外，中国股票市场在市场化程度大幅提高后资源向优势企业集中，领先企业将进一步获得估值溢价。

2007 年蓝筹成长基金将更加重视资产配置，在战略配置的基础上精选个股。我们将加强对于不同资产可投资性的审视和评判，通过精选优质资产中具有特质的领先型蓝筹企业和成长企业以获得组合的长期增值。

从行业和板块方面，以金融为代表的现代服务业、内需消费行业和装备制造业这三大板块是我们长期看好的战略性资产；在周期性行业中，2007 年我们将重点关注钢铁行业和汽车行业的投资机会；在主题投资方面，我们关注 3G 及奥运主题带来的投资机会。

尊敬的持有人，诚挚感谢您一直以来给予蓝筹成长基金管理人的信任和支持！新的一年，基金管理人将努力汲取经验教训，不断提升专业水准，信守承诺、执著进取、勤勉工作，力争在控制风险并保持良好流动性的前提下，为持有人奉献良好的投资回报。

（四）基金管理人内部监察报告

本基金管理人坚持从防范运作风险、保障基金持有人利益的原则出发，建立并不断完善各项管理制度、业务流程和操作规范，通过加强内部监察稽核工作，保证有关法律法规和各项管理制度得以贯彻落实。

公司监察稽核部独立于各业务部门，按照规定的程序和方法，对各业务环节的运作情况进行合规检查与监督。06 年度的合规控制重点仍旧是基金投资和基金销售。结合对各风险点风险程度的判断和不定期评估的结果，监察稽核部门在严格做好基金投资交易的实时监控工作之外，先后对股票库出入库流程、研究报告质量控制流程、投资决策流程、场外交易管理、销售费率政策执行、延时交易控制、客户服务情况、销售费用管理等业务环节安排了专项检查。每季度，各业务部门与监察稽核部还根据中国证监会《季度监察稽核项目表》认真进行自查及复查。通过各项检查与监督工作，公司可及时发现业务过程和环节中的违规行为、内控隐患以及风险因素，并由监察稽核部督促相关部门及时、有效地落实整改措施，保障公司业务的合规、安全运营。

在做好日常监控及合规检查工作的同时，监察稽核部门也非常重视合规控制的基础建设工作，不断根据最新法律法规和监管部门的要求修改完善内控制度，不断改进监控手段，改善检查方法，提高监控效率。同时通过员工培训等活动，提高员工的内控责任意识，建设合规文化。

通过上述工作，本基金管理人有效地防范和化解了经营风险，确保了经营业务的合规稳健运行和基金资产的安全完整。

四、托管人报告

2006 年度，本托管人在对融通通利系列证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006 年度，融通通利系列证券投资基金的管理人—融通基金管理有限公司在融通通利系列证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

2006 年度，融通通利系列证券投资基金因证券市场波动或基金规模变动发生过不符合《证券投资基金运作管理办法》或基金合同中所规定的投资比例限制的情况，融通基金管理有限公司经本托管人以函件形式提示后，及时对融通通利系列证券投资基金的投资组合进行了调整。

本托管人依法对融通基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的融通通利系列证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

五、审计报告

（一）融通债券投资基金审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20176 号

融通通利系列证券投资基金下设的融通债券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的融通通利系列证券投资基金下设的融通债券投资基金(以下简称“融通债券基金”)会计报表,包括 2006 年 12 月 31 日资产负债表、2006 年度经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是融通债券基金的基金管理人融通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：1、设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制,以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；2、选择和运用恰当的会计政策；3、作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与会计报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价会计报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为,上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了融通债券基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
中国·上海市

注册会计师

注册会计师

汪 棣

张 立 纲

2007 年 3 月 19 日

（二）融通深证 100 指数证券投资基金审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20177 号

融通通利系列证券投资基金下设的融通深证 100 指数证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的融通通利系列证券投资基金下设的融通深证 100 指数证券投资基金(以下简称“融通深证 100 指数基金”)会计报表,包括 2006 年 12 月 31 日资产负债表、2006

年度经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是融通深证 100 指数基金的基金管理人融通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：1、设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；2、选择和运用恰当的会计政策；3、作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了融通深证 100 指数基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天	注册会计师	汪 棣
会计师事务所有限公司		
中国·上海市	注册会计师	张 立 纲
2007 年 3 月 19 日		

(三) 融通蓝筹成长证券投资基金审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20178 号

融通通利系列证券投资基金下设的融通蓝筹成长证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的融通通利系列证券投资基金下设的融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“融通蓝筹成长基金”)包括 2006 年 12 月 31 日资产负债表、2006 年度经营业绩表、基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是融通蓝筹成长基金的基金管理人融通基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：1、设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；2、选择和运用恰当的会计政策；3、作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会

计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了融通蓝筹成长基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天
会计师事务所有限公司
中国·上海市

注册会计师

注册会计师

汪 棣

张 立 纲

2007 年 3 月 19 日

六、财务会计报告

(一) 融通债券基金财务会计报告

1、会计报表

融通债券证券投资基金
资产负债表
二〇〇六年十二月三十一日
单位：人民币元

	附注	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		6,411,003.51	32,550,339.46
清算备付金		270,960.19	12,340.80
交易保证金		250,000.00	250,000.00
应收证券清算款		--	--
应收股利		--	--
应收利息	6 (1)	3,279,117.85	2,078,502.82
应收申购款		1,473,841.27	104,840.41
其他应收款		--	--
债券投资市值		265,201,208.93	329,254,606.65
其中：债券投资成本		264,537,220.46	324,281,992.56
买入返售证券		--	--
待摊费用		--	--
其他资产		--	--
资产总计		276,886,131.75	364,250,630.14
负债：			

应付证券清算款		1,437,967.98	23,835,378.28
应付赎回款		1,853,674.44	1,129,262.94
应付赎回费		2,110.11	1,326.51
应付管理人报酬		118,594.51	135,680.16
应付托管费		39,531.50	45,226.73
应付佣金	6 (3)	82,974.15	54,565.61
应付利息		6,568.57	6,640.44
应付收益		--	--
其他应付款	6 (5)	999,279.69	918,514.44
卖出回购证券款		43,500,000.00	27,600,000.00
预提费用	6 (6)	139,333.32	50,000.00
负债合计		48,180,034.27	53,776,595.11
持有人权益：			
实收基金	6 (7)	214,732,687.42	300,202,915.94
未实现利得	6 (8)	-5,167,662.83	-1,329,240.52
未分配收益		19,141,072.89	11,600,359.61
持有人权益合计		228,706,097.48	310,474,035.03
负债及持有人权益总计		276,886,131.75	364,250,630.14
基金份额净值		1.065	1.034

所附附注为本会计报表的组成部分

融通债券证券投资基金
经营业绩表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
一、收入		43,254,696.23	14,985,649.38
债券差价收入	6 (9)	36,429,121.76	9,459,430.74
债券利息收入		6,465,442.33	5,339,527.69
存款利息收入		168,848.12	133,063.05
买入返售证券收入		72,720.00	8,776.00
其他收入	6 (11)	118,564.02	44,851.90
二、费用		2,763,185.55	2,875,491.80
基金管理人报酬	5 (2)	1,639,399.40	1,849,486.12
基金托管费	5 (2)	546,466.51	616,495.38
卖出回购证券支出		180,046.13	6,640.44
其他费用	6 (12)	397,273.51	402,869.86
其中：信息披露费		94,333.32	113,333.33
审计费用		45,000.00	50,000.00
交易佣金		220,000.00	220,000.00
三、基金净收益		40,491,510.68	12,110,157.58
加：未实现利得		-4,308,625.62	12,010,810.35
四、基金经营业绩		36,182,885.06	24,120,967.93

所附附注为本会计报表的组成部分

融通债券证券投资基金

收益分配表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		40,491,510.68	12,110,157.58
加：期初基金净收益		11,600,359.61	11,023,164.35
加：本期损益平准金		-3,022,122.97	-2,695,614.07
可供分配基金净收益		49,069,747.32	20,437,707.86
减：本期已分配基金净收益	6 (13)	29,928,674.43	8,837,348.25
期末基金净收益		19,141,072.89	11,600,359.61

所附附注为本会计报表的组成部分

融通债券证券投资基金
净值变动表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		310,474,035.03	373,258,871.21
二、本期经营活动			
基金净收益		40,491,510.68	12,110,157.58
未实现利得		-4,308,625.62	12,010,810.35
经营活动产生的基金净值变动数		36,182,885.06	24,120,967.93
三、本期基金份额交易			
基金申购款		185,360,491.39	64,549,003.46
基金赎回款		-273,382,639.57	-142,617,459.32
基金份额交易产生的基金净值变动数		-88,022,148.18	-78,068,455.86
四、本期向持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	6 (13)	-29,928,674.43	8,837,348.25
五、期末基金净值		228,706,097.48	310,474,035.03

所附附注为本会计报表的组成部分

2、会计报表附注

(除特别说明外，金额单位为人民币元)

附注 1. 基金的基本情况

融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第 94 号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 9 月 30 日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为融通债券投资基金(以下简称“本基金”)、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。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,116,929,381.80 元，其中包括本基金 873,320,777.53 元、融通深证 100 指数证券投资基金 477,610,977.87 元和融通蓝筹成长证券投资基金 765,997,626.40 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 138 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托

管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和最近公布的融通通利系列证券投资基金更新招募说明书的有关规定,本基金的投资范围限于固定收益类金融工具,包括国内依法公开发行上市的国债、金融债和企业债(包括可转换债券)等,其中投资于债券的比例不低于基金资产总值的 80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%,持有的资产支持证券不得超过基金资产净值的 20%,并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

附注 2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

附注 3. 主要会计政策和会计估计

(1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(3) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除债券投资按市值计价外,所有报表项目均以历史成本计价。

(4) 基金资产的估值原则

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券和资产支持证券按成本估值。如有确凿证据表明银行间同业市场交易的债券及资产支持证券按上述办法进行估值不能客观反映其公允价值,基金管理人在综合考虑市场成交价、市场报价、成本价、流动性、收益率曲线等多种影响债券估值因素的基础上,根据具体情况与本基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

(5) 证券投资的成本计价方法

买入证券交易所交易的债券和资产支持证券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。基金取得资产支持证券支付的款项时,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,并将收到的本金部分冲减债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券和资产支持证券于成交日确认债券差价收入;卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(6) 收入的确认和计量

证券交易所交易的债券和资产支持证券的差价收入于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

除银行次级债之外的债券利息收入按债券票面价值与票面利率、内含票面利率或资产支持证券的预计收益率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,银行次级债利息收入按债券票面价值与全额票面利率计算的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(7) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(8) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总数。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(9) 未实现利得

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。

未实现利得平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(10) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益。

(11) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但投资人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；如当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

附注 4. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖债券的差价收入，暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。

附注 5. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
河北证券有限责任公司	基金管理人股东
陕西省国际信托投资股份有限公司	基金管理人股东
联合证券有限责任公司	基金管理人股东、基金代销机构
华林证券有限责任公司	基金管理人股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 关联方报酬

A. 基金管理人报酬

支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 1,639,399.40 元 (2005 年度 1,849,486.12 元)。

B. 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 546,466.51 元(2005 年度：616,495.38 元)。

C. 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 6,411,003.51 元(2005 年 12 月 31 日：32,550,339.46 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 156,341.15 元(2005 年度：129,936.40 元)。

(3) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本年度及上年度本基金均无与关联方进行银行间债券交易

(4) 基金各关联方投资本基金的情况

A. 基金管理人期末持有本基金的情况

截止 2006 年 12 月 31 日止，基金管理人未持有本基金份额。(2005 年 12 月 31 日：同)

B. 基金管理人的主要股东及其控制的机构在期末持有本基金的情况

截止 2006 年 12 月 31 日止，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

(2005 年 12 月 31 日：同)

附注 6. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收债券利息	3,175,808.13	2,077,003.22
应收资产支持证券利息	100,140.33	--
应收银行存款利息	3,047.49	1,494.10
应收结算备付金利息	121.90	5.50
合计	3,279,117.85	2,078,502.82

(2) 债券投资

截至 2006 年 12 月 31 日止，债券投资中包含的资产支持证券年末估值及投资成本均为 19,980,999.35 元(2005 年：无)。

(3) 应付佣金

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
上海证券有限责任公司	57,767.96	29,359.42
中信建投证券有限责任公司	25,206.19	25,206.19
合计	82,974.15	54,565.61

(4) 应付利息

截止 2006 年 12 月 31 日止，应付利息余额均为交易所卖出回购证券产生的应付利息(2005 年 12 月 31 日：同)。

(5) 其他应付款

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付债券利息收入的个人所得税	745,623.20	662,473.40
应付券商席位保证金	250,000.00	250,000.00
应付后端申购费	3,258.99	6,041.04
应付银行间交易手续费	397.50	--
合计	999,279.69	918,514.44

(6) 预提费用

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
信息披露费	94,333.32	--

审计费用	45,000.00	50,000.00
合计	139,333.32	50,000.00

(7) 实收基金

项目	2006 年度	2005 年度
期初数	300,202,915.94	378,650,515.20
加：本期申购	177,814,163.52	61,324,036.75
其中：红利再投资	21,687,289.21	6,623,785.03
减：本期赎回	263,284,392.04	139,771,636.01
期末数	214,732,687.42	300,202,915.94

(8) 未实现利得

	未实现估值增值(a)	未实现利得平准金	合计
2005 年 12 月 31 日	4,972,614.09	-6,301,854.61	-1,329,240.52
加：本年净变动数	-4,308,625.62		-4,308,625.62
加：本年申购基金份额		-2,921,858.20	-2,921,858.20
其中：红利再投资		74,773.98	74,773.98
减：本年赎回基金份额		-3,392,061.51	-3,392,061.51
2006 年 12 月 31 日	663,988.47	-5,831,651.30	-5,167,662.83

(a) 未实现估值增值均由证券交易所交易的债券投资所产生。

(9) 债券差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出及到期兑付债券结算金额	1,146,810,755.29	365,109,178.24
减：应收利息总额	10,943,627.81	4,200,177.27
减：卖出及到期兑付债券成本总额	1,099,438,005.72	351,449,570.23
债券差价收入	36,429,121.76	9,459,430.74

本基金本年度内未发生处置资产支持证券的情况。

(10) 债券利息收入

本年度债券利息收入中包含的资产支持证券利息收入为 230,341.30 元(2005 年：无)。

(11) 其他收入

本年度其他收入均为赎回基金补偿收入(2005 年：同)。本基金的赎回费率按持有期限递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。本基金的转换费总额的 25%归入转出基金的基金资产。

(12) 其他费用

项目	2006 年度	2005 年度
信息披露费	94,333.32	113,333.33
审计费用	45,000.00	50,000.00
交易所回购交易费用	3,072.14	886.53
债券托管账户维护费	26,900.00	18,650.00
交易佣金	220,000.00	220,000.00
银行费用	4,135.28	--
银行间交易费用	3,832.77	--
合计	397,273.51	402,869.86

(13) 本期已分配基金净收益

权益登记日、除权日	每 10 份基金份额分配收益	收益分配金额
2006 年度		
2006 年 5 月 24 日	0.300	8,685,635.07
2006 年 2 月 23 日	0.400	11,321,448.88
2006 年 1 月 12 日	0.340	9,921,590.48
2006 年度累计收益分配	1.040	29,928,674.43
2005 年度		
2005 年 12 月 28 日	0.300	8,837,348.25
2005 年度累计收益分配	0.300	8,837,348.25

附注 7. 本报告期末流通转让受到限制的基金资产

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 43,500,000.00 元(2005 年: 27,600,000.00 元), 于 2007 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购申报前指定用于回购质押的证券交易所交易债券, 并提交转入质押库中。在回购期内提交的质押券按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易金额。

(二) 融通深证 100 指数基金财务会计报告

1、基金会计报表

融通深证100指数证券投资基金

资产负债表

二〇〇六年十二月三十一日

单位: 人民币元

	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产:			
银行存款		14,079,572.87	1,937,458.64
清算备付金		1,484,566.70	239,415.97
交易保证金		1,250,000.00	1,500,000.00
应收证券清算款		940,440.21	2,171,988.45
应收股利		--	--
应收利息	6 (1)	132,947.93	1,209,231.35
应收申购款		3,085,651.15	187,016.83
股票投资市值		682,882,281.26	641,853,093.04
其中: 股票投资成本		520,675,521.57	677,835,767.61
债券投资市值		29,163,900.74	33,214,940.00
其中: 债券投资成本		27,183,020.42	33,396,571.83
权证投资		1,413,611.35	--
其中: 权证投资成本		581,553.65	--
买入返售证券		--	--
待摊费用		--	--
其他资产		--	--
资产总计		734,432,972.21	682,313,144.28
负债:			
应付证券清算款		--	--
应付赎回款		10,815,372.86	5,668,170.55
应付赎回费		21,468.74	10,769.93

应付管理人报酬		643,021.56	582,245.58
应付托管费		128,604.32	116,449.14
应付佣金	6 (2)	933,887.20	134,723.24
应付利息	6 (3)	460.00	--
应付收益		--	--
其他应付款	6 (4)	1,275,139.69	1,523,501.12
卖出回购证券款		7,000,000.00	--
预提费用	6 (5)	148,333.34	50,000.00
其他负债		--	--
负债合计		20,966,287.71	8,085,859.56
持有人权益：			
实收基金	6 (6)	533,327,971.02	840,805,531.25
未实现利得	6 (7)	94,700,422.84	-79,708,775.40
未分配收益		85,438,290.64	-86,869,471.13
持有人权益合计		713,466,684.50	674,227,284.72
负债及持有人权益总计		734,432,972.21	682,313,144.28
基金份额净值		1.338	0.802

所附附注为本会计报表的组成部分

融通深证100指数证券投资基金

经营业绩表

二〇〇六年度

单位：人民币元

	附 注	2006年度	2005年度
一、收入		290,287,879.62	-75,336,743.91
股票差价收入	6 (8)	263,911,407.82	-102,441,920.23
债券差价收入	6 (9)	-625,465.27	-72,341.06
权证差价收入	6 (10)	15,733,974.86	10,254,674.65
债券利息收入		662,974.56	3,501,126.69
存款利息收入		216,851.52	153,756.07
股利收入		9,606,567.90	12,948,554.84
买入返售证券收入		--	--
其他收入	6 (11)	781,568.23	319,405.13
二、费用		7,258,014.01	9,349,850.99
基金管理人报酬	5 (3)	5,801,914.31	7,572,168.56
基金托管费	5 (3)	1,160,382.91	1,514,433.76
卖出回购证券支出		126,564.00	80,210.00
其他费用	6 (12)	169,152.79	183,038.67
其中：信息披露费		94,333.32	113,333.34
审计费用		54,000.00	50,000.00
三、基金净收益		283,029,865.61	-84,686,594.90
加：未实现利得		201,184,004.11	80,371,623.51
四、基金经营业绩		484,213,869.72	-4,314,971.39

所附附注为本会计报表的组成部分

融通深证100指数证券投资基金

收益分配表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		283,029,865.61	-84,686,594.90
加：期初基金净收益		-86,869,471.13	-15,198,260.78
加：本期损益平准金		27,093,442.68	13,015,384.55
可供分配基金净收益		223,253,837.16	-86,869,471.13
减：本期已分配基金净收益	6 (13)	137,815,546.52	--
期末基金净收益		85,438,290.64	-86,869,471.13

所附附注为本会计报表的组成部分

融通深证100指数证券投资基金
净值变动表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		674,227,284.72	859,247,739.55
二、本期经营活动			
基金净收益		283,029,865.61	-84,686,594.90
未实现利得		201,184,004.11	80,371,623.51
经营活动产生的基金净值变动数		484,213,869.72	-4,314,971.39
三、本期基金份额交易			
基金申购款		1,046,677,236.72	296,967,527.69
基金赎回款		-1,353,836,160.14	-477,673,011.13
基金份额交易产生的基金净值变动数		-307,158,923.42	-180,705,483.44
四、本期向持有人分配收益：			
向基金持有人分配收益产生的净值变动数	6 (13)	-137,815,546.52	--
五、期末基金净值		713,466,684.50	674,227,284.72

所附附注为本会计报表的组成部分

2、会计报表附注

(除特别说明外，金额单位为人民币元)

附注 1. 基金的基本情况

融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第94号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起，并于2003年9月30日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为融通深证100指数证券投资基金(以下简称“本基金”)、融通债券投资基金和融通蓝筹成长证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,116,929,381.80元，其中包括本基金477,610,977.87元、融通债券投资基金873,320,777.53元和融通蓝筹成长证券投资基金765,997,626.40元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第138号

验资报告予以验证。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和最近公布的融通通利系列证券投资基金更新招募说明书的有关规定，本基金的投资范围主要为深证100指数成份股和债券，以基金非债券资产90%以上的资金对深证100指数的成份股进行股票指数化投资，其中股票指数化投资部分不得低于基金资产的50%，相对于深证100指数的日跟踪误差不超过0.5%，此外本基金持有的资产支持证券不得超过基金资产净值的20%，并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

附注 2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

附注 3. 主要会计政策和会计估计

(1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(3) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(4) 基金资产的估值原则

A. 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

B. 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

C. 权证投资

从获赠确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

D. 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

E. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 证券投资的成本计价方法

A. 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

B. 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含

债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按附注 3(5)(C)所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入;卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

C. 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

(6) 收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

(7) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

(8) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总数。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(9) 未实现利得

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。

未实现利得平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(10) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配基金净收益。

(11) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但投资人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益分配每年至少一次;如当年基金成立未满三个月,则不需分配收益。基金当期收益先弥补上一年度亏损后,方可进行当年收益分配。基金当年亏损,则不进行收益分配。基金收益分配后,基金份额净值不能低于面值。

经宣告的基金收益分配于分红除权日从持有人权益转出。

附注 4. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关

于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%(此前按 100%)计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。
- (4) 基金买卖股票于 2005 年 1 月 24 日前按照 0.2%的税率缴纳股票交易印花税,自 2005 年 1 月 24 日起减按 0.1%的税率缴纳。
- (5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注 5. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
河北证券有限责任公司	基金管理人股东
陕西省国际信托投资股份有限公司	基金管理人股东
联合证券有限责任公司(“联合证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
华林证券有限责任公司	基金管理人股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

2006 年度		
联合证券	买卖股票成交量	占全年该类交易成交量比例
买卖股票	829,170,236.70	28.60%
买卖权证	7,091,223.74	45.06%
	交易佣金	占全年佣金总量比例
联合证券	648,831.83	28.65%

2005 年度		
联合证券	买卖股票成交量	占全年该类交易成交量比例
买卖股票	366,666,121.01	36.34%
买卖债券	341,320.50	0.10%
	交易佣金	占全年佣金总量比例
联合证券	286,923.15	36.62%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 5,801,914.31 元(2005 年度 7,572,168.56 元)。

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计

提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 1,160,382.91 元(2005 年度：1,514,433.76 元)。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 14,079,572.87 元(2005 年 12 月 31 日：1,937,458.64 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 197,059.15 元(2005 年度：141,919.87 元)。

(6) 与关联方进行的银行间同业市场债券交易

本基金在本年度与关联方未通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

(7) 基金各关联方投资本基金的情况

A. 基金管理人期末持有本基金的情况

截止 2006 年 12 月 31 日止，基金管理人未持有本基金份额。(2005 年 12 月 31 日：同)

B. 基金管理人的主要股东及其控制的机构在期末持有本基金的情况

截止 2006 年 12 月 31 日止，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。

(2005 年 12 月 31 日：同)

附注 6. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收债券利息	123,597.59	1,207,393.02
应收银行存款利息	8,682.34	1,730.63
应收清算备付金利息	668.00	107.70
合计	132,947.93	1,209,231.35

(2) 应付佣金

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
长城证券有限责任公司	--	34,929.09
金通证券股份有限公司	--	22,866.67
海通证券股份有限公司	97,646.42	--
长江证券有限责任公司	241,167.00	5,289.23
联合证券有限责任公司	594,361.17	--
中信万通证券有限责任公司	712.61	79.77
五矿证券经纪有限责任公司	--	71,558.48
合计	933,887.20	134,723.24

(3) 应付利息

截至 2006 年 12 月 31 日止，应付利息余额均为交易所卖出回购证券产生的应付利息(2005 年：无)。

(4) 其他应付款

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付券商席位保证金	1,250,000.00	1,500,000.00
应付后端申购费	25,139.69	23,501.12
合计	1,275,139.69	1,523,501.12

(5) 预提费用

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
预提信息披露费	94,333.34	0.00
预提审计费用	54,000.00	50,000.00
合计	148,333.34	50,000.00

(6) 实收基金

项目	2006 年度	2005 年度
期初数	840,805,531.25	1,055,455,492.55
加：本期申购	991,010,519.03	389,236,147.80
其中：红利再投资	72,975,462.19	--
减：本期赎回	1,298,488,079.26	603,886,109.10
期末数	533,327,971.02	840,805,531.25

(7) 未实现利得

项目	未实现估值增值(a)	未实现利得平准金	合计
2005 年 12 月 31 日	-36,164,306.40	-43,544,469.00	-79,708,775.40
加：本年净变动数	201,184,004.11		201,184,004.11
加：本年申购基金份额		39,663,564.98	39,663,564.98
减：本年赎回基金份额		66,438,370.85	66,438,370.85
2006 年 12 月 31 日	165,019,697.71	-70,319,274.87	94,700,422.84

(a) 未实现估值增值按投资类别分项列示如下：

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
股票估值增值	162,206,759.69	-35,982,674.57
债券估值增值	1,980,880.32	-181,631.83
权证估值增值	832,057.70	
合计	165,019,697.71	-36,164,306.40

(8) 股票差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出股票成交总额	1,658,678,702.88	511,554,739.68
减：应付佣金总额	1,349,321.19	416,147.44
减：卖出股票成本总额	1,393,417,973.87	613,580,512.47
股票差价收入	263,911,407.82	-102,441,920.23

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付给流通股股东的现金对价共计 4,966,074.31 元(2005 年：754,192.49 元)，已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出及到期兑付债券结算总额	98,442,486.52	278,552,200.58
减：应收利息总额	3,952,949.90	6,667,461.36
减：卖出及到期兑付债券成本总额	95,115,001.89	271,957,080.28
债券差价收入	-625,465.27	-72,341.06

(10) 权证差价收入

本年度权证差价收入由卖出权证成交总额直接构成，卖出权证成本总额为零(2005 年：同)。

(11) 其他收入

项目	2006 年度	2005 年度
赎回及转换基金补偿收入(a)	778,073.43	305,345.51
新股申购手续费返还	0.00	8,909.62
债券手续费返还	3,494.80	5,150.00
合计	781,568.23	319,405.13

(a) 本基金的赎回费率按持有期限递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。本基金的转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

(12) 其他费用

项目	2006 年度	2005 年度
信息披露费	94,333.34	113,333.34
审计费用	54,000.00	50,000.00
回购交易费	2,140.69	1,555.33
债券托管账户维护费	18,000.00	18,150.00
银行费用	678.76	--
合计	169,152.79	183,038.67

(13) 本期已分配基金净收益

权益登记日、除权日	每 10 份基金份额分配收益	收益分配金额
2006 年度:		
2006 年 11 月 23 日	0.50	29,347,420.80
2006 年 10 月 19 日	0.60	34,048,554.61
2006 年 7 月 5 日	0.50	22,457,938.80
2006 年 6 月 1 日	1.20	45,279,153.48
2006 年 5 月 22 日	0.20	6,682,478.83
2006 年度累计收益分配	3.00	137,815,546.52
2005 年度:无收益分配		

附注 7. 本报告期末流通转让受到限制的基金资产

1、本基金截止 2006 年 12 月 31 日止持有以下因股权分置改革面暂时停牌的股票, 这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌:								
000423	S 阿胶	06/12/04	13.69	未知	未知	490,369	4,440,170.36	6,713,151.61
方案实施阶段停牌:								
000895	S 双汇	06/06/01	31.17	未知	未知	469,499	7,470,117.99	14,634,283.83
合计							11,910,288.35	21,347,435.44

2、流通受限制不能自由转让的债券

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 7,000,000.00 元(2005 年:无), 于 2007 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购申报前指定用于回购质押的证券交易所交易债券, 并提交转入质押库中。在回购期内提交的质押券按证券交易所规定的比例折算为标准券后, 不低于债券回购交易金额。

附注 8. 资产负债表日后事项

1、本基金管理人于 2007 年 1 月 16 日宣告 2007 年度第一次分红, 向截至 2007 年 1 月 15 日止在本基金注册登记人融通基金管理有限公司登记在册的全体持有人, 按每 10 份基金份额派发红利 3.10 元。

2、本基金管理人于 2007 年 2 月 1 日宣告 2007 年度第二次分红, 向截至 2007 年 1 月 31 日止在本基金注册登记人融通基金管理有限公司登记在册的全体持有人, 按每 10 份基金份额派发红利 1.20 元。

(三) 融通蓝筹成长基金财务会计报告

1、基金会计报表

融通蓝筹成长证券投资基金

资产负债表

二〇〇六年十二月三十一日

单位: 人民币元

	附 注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产：			
银行存款		19,802,013.26	39,452,106.31
清算备付金		891,744.97	643,737.83
交易保证金		1,098,780.49	598,780.49
应收证券清算款		12,013,083.68	--
应收股利		--	--
应收利息	6 (1)	575,064.57	3,732,145.80
应收申购款		600,335.93	228,273,450.54
其他应收款		--	--
股票投资市值		320,574,470.99	384,358,565.58
其中：股票投资成本		247,914,209.38	345,982,402.32
债券投资市值		118,439,789.52	152,742,724.80
其中：债券投资成本		117,969,689.18	152,844,412.30
权证投资		4,193,296.00	--
其中：权证投资成本		1,725,104.00	--
买入返售证券		--	--
待摊费用		--	--
其他资产		--	--
资产总计		478,188,579.41	809,801,511.35
负债：			
应付证券清算款		--	21,476,983.30
应付赎回款		1,983,765.04	57,678,503.54
应付赎回费		3,189.59	65,214.77
应付管理人报酬		628,542.36	656,763.10
应付托管费		104,757.07	109,460.53
应付佣金	6 (3)	461,409.14	289,154.75
应付利息		--	--
应付收益		--	--
其他应付款	6 (4)	1,003,985.48	506,334.88
预提费用	6 (5)	150,333.34	50,000.00
其他负债		--	--
负债合计		4,335,982.02	80,832,414.87
持有人权益：			
实收基金	6 (6)	282,241,429.58	707,196,458.84
未实现利得	6 (7)	54,711,493.55	63,026,661.75
未分配收益		136,899,674.26	-41,254,024.11
持有人权益合计		473,852,597.39	728,969,096.48
负债及持有人权益总计		478,188,579.41	809,801,511.35
基金份额净值		1.679	1.031

所附附注为本会计报表的组成部分

融通蓝筹成长证券投资基金
经营业绩表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
一、收入		306,414,034.52	-12,926,056.76
股票差价收入	6 (8)	284,825,058.02	-23,953,991.16
债券差价收入	6 (9)	-1,207,505.62	101,214.45
权证差价收入	6 (10)	11,128,596.86	--
债券利息收入		4,793,600.93	5,207,706.94
存款利息收入		510,759.97	709,344.07
股利收入		5,955,288.24	4,864,651.98
买入返售证券收入		--	--
其他收入	6 (11)	408,236.12	145,016.96
二、费用		9,814,149.84	10,336,051.23
基金管理人报酬	5 (3)	8,250,835.32	8,703,658.15
基金托管费	5 (4)	1,375,139.18	1,450,609.75
利息支出		--	--
卖出回购证券支出		18,500.00	--
其他费用	6 (12)	169,675.34	181,783.33
其中：信息披露费		94,333.34	113,333.33
审计费用		56,000.00	50,000.00
回购交易费用		--	--
三、基金净收益		296,599,884.68	-23,262,107.99
加：未实现利得		37,324,078.19	68,968,664.62
四、基金经营业绩		333,923,962.87	45,706,556.63

所附附注为本会计报表的组成部分

融通蓝筹成长证券投资基金
收益分配表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		296,599,884.68	-23,262,107.99
加：期初基金净收益		-41,254,024.11	-20,751,305.89
加：本期损益平准金		-50,059,902.76	2,759,389.77
可供分配基金净收益		205,285,957.81	-41,254,024.11
减：本期已分配基金净收益	6 (13)	68,386,283.55	--
期末基金净收益		136,899,674.26	-41,254,024.11

所附附注为本会计报表的组成部分

融通蓝筹成长证券投资基金
净值变动表
二〇〇六年度
单位：人民币元

	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		728,969,096.48	687,295,605.65
二、本期经营活动：			
基金净收益		296,599,884.68	-23,262,107.99

未实现利得	6 (7)	37,324,078.19	68,968,664.62
经营活动产生的基金净值变动数		333,923,962.87	45,706,556.63
三、本期基金份额交易：			
基金申购款		236,226,971.84	323,130,991.05
基金赎回款		-756,881,150.25	-327,164,056.85
基金份额交易产生的基金净值变动数		-520,654,178.41	-4,033,065.80
四、本期向持有人分配收益：			
向基金持有人分配收益产生的净值变动数	6 (13)	-68,386,283.55	--
五、期末基金净值		473,852,597.39	728,969,096.48

所附附注为本会计报表的组成部分

2、会计报表附注

(除特别说明外, 金额单位为人民币元)

附注 1. 基金的基本情况

融通通利系列证券投资基金(以下简称“本系列基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2003]第94号《关于同意融通通利系列证券投资基金设立的批复》核准, 由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《融通通利系列证券投资基金基金契约》(后更名为《融通通利系列证券投资基金基金合同》)发起, 并于2003年9月30日募集成立。本系列基金为契约型开放式, 存续期限不定, 目前下设三个子基金, 分别为融通蓝筹成长证券投资基金(以下简称“本基金”)、融通债券投资基金和融通深证100指数证券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集2,116,929,381.80元, 其中包括本基金765,997,626.40元、融通债券投资基金873,320,777.53元和融通深证100指数证券投资基金477,610,977.87元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第138号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为融通基金管理有限公司, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《融通通利系列证券投资基金基金合同》和最近公布的融通通利系列证券投资基金更新招募说明书的有关规定, 本基金的投资范围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, 并限定将相当比例的基金资产投资于符合蓝筹成长投资标准的投资对象, 此外本基金持有的权证市值不超过基金资产净值的3%, 持有的资产支持证券不得超过基金资产净值的20%, 并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年内的政府债券。

附注 2. 会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

附注 3. 主要会计政策和会计估计

(1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

(2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(3) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外, 所有报表项目均以历史成本计价。

(4) 基金资产的估值原则

A. 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值; 估值日无交易的, 以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市股票, 按成本估值; 由

于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

B. 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值;估值日无交易的,以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

C. 权证投资

从获赠确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止,上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值;未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

D. 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

E. 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值,本基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

(5) 证券投资的成本计价方法

A. 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价,于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

B. 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账,其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,作为应收利息单独核算,不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按附注 3(5)(C)所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入;卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

C. 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日,按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量;因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

(6) 收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认;银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(7) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(8) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总数。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(9) 未实现利得

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值和未实现利得平准金。

未实现利得平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(10) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益。

(11) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但投资人可选择现金红利或将现金红利按分红除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至少一次；如当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的基金收益分配于分红除权日从持有人权益转出。

附注 4. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% (此前按 100%) 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金买卖股票于 2005 年 1 月 24 日前按照 0.2% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2005 年 1 月 24 日起减按 0.1% 的税率缴纳。

(5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

附注 5. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
融通基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构
中国工商银行	基金托管人、基金代销机构
河北证券有限责任公司	基金管理人股东
陕西省国际信托投资股份有限公司	基金管理人股东

联合证券有限责任公司(“联合证券”)	基金管理人股东、基金代销机构
华林证券有限责任公司(“华林证券”)	基金管理人股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

2006 年度				
	买卖股票 成交量	占全年该类交易 成交量比例	交易佣金	占全年佣金 总量比例
联合证券	440,501,869.43	17.84%	344,695.42	17.37%
华林证券	49,767,633.77	2.02%	38,943.58	1.96%

2005 年度				
	买卖股票 成交量	占全年该类交易 成交量比例	交易佣金	占全年佣金 总量比例
联合证券	126,643,783.78	7.47%	99,100.13	7.22%
华林证券	271,916,056.13	16.04%	212,776.69	15.50%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人融通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 8,250,835.32 元(2005 年度 8,703,658.15 元)。

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 1,375,139.18 元(2005 年度：1,450,609.75 元)。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 19,802,013.26 元(2005 年 12 月 31 日：39,452,106.31 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 487,196.51 元(2005 年：699,582.09 元)。

(6) 与关联方进行的银行间同业市场债券交易

本基金在本年度与 2005 年度与基金托管人中国工商银行未通过银行间同业市场进行债券交易。

(7) 基金各关联方投资本基金的情况

A. 基金管理人期末持有本基金的情况

截止 2006 年 12 月 31 日止，基金管理人未持有本基金份额。(2005 年 12 月 31 日：同)

B. 基金管理人的主要股东及其控制的机构在期末持有本基金的情况

截止 2006 年 12 月 31 日止，基金管理人的主要股东及其控制的机构未持有本基金份额。(2005 年 12 月 31 日：同)

附注 6. 基金会计报表重要项目说明

(1) 交易保证

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
深圳结算保证金	1,000,000.00	500,000.00
权证交易保证金	98,780.49	98,780.49

合计	1,098,780.49	598,780.49
----	--------------	------------

(2) 应收利息

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收债券利息	566,039.62	3,714,845.68
应收银行存款利息	8,579.15	16,966.02
应收清算备付金利息	401.30	289.60
应收保证金利息	44.50	44.50
合计	575,064.57	3,732,145.80

(3) 应付佣金

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
中信建投证券有限责任公司	228,332.38	-
东方证券股份有限公司	165,972.64	-
联合证券有限责任公司	41,304.84	39,825.54
金元证券有限责任公司	22,045.57	190,259.91
齐鲁证券有限公司	3,753.71	-
招商证券股份有限公司	-	33,197.65
华林证券有限责任公司	-	14,612.32
中信万通证券有限责任公司	-	11,259.33
合计	461,409.14	289,154.75

(4) 其他应付款

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付券商席位保证金	1,000,000.00	500,000.00
应付后端申购费	3,985.48	6,334.88
合计	1,003,985.48	506,334.88

(5) 预提费用

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
审计费用	56,000.00	50,000.00
信息披露费	94,333.34	--
合计	150,333.34	50,000.00

(6) 实收基金

项目	2006 年度	2005 年度
期初数	707,196,458.84	727,273,304.40
加：本期申购	189,770,520.45	321,331,216.49
其中：红利再投资	13,912,996.69	--
减：本期赎回	614,725,549.71	341,408,062.05
期末数	282,241,429.58	707,196,458.84

(7) 未实现利得

项目	未实现估值增值(a)	未实现利得平准金	合计
2005 年 12 月 31 日	38,274,475.76	24,752,185.99	63,026,661.75
加：本年净变动数	37,324,078.19	--	37,324,078.19
加：本年申购基金份额	--	18,775,972.18	18,775,972.18
其中：红利再投资	--	1,558,705.48	1,558,705.48
减：本年赎回基金份额	--	-64,415,218.57	-64,415,218.57

2006 年 12 月 31 日	75,598,553.95	-20,887,060.40	54,711,493.55
------------------	---------------	----------------	---------------

(a) 未实现估值增值按投资类别分项列示如下：

项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
股票估值增值	72,660,261.61	38,376,163.26
债券估值增值	470,100.34	-101,687.50
权证估值增值	2,468,192.00	--
合计	75,598,553.95	38,274,475.76

(8) 股票差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出股票成交总额	1,427,548,790.50	930,639,995.47
减：卖出股票成本总额	1,141,527,155.21	953,810,796.63
减：应付佣金	1,196,577.27	783,190.00
股票差价收入	284,825,058.02	-23,953,991.16

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付给流通股股东的现金对价共计 2,056,936.94 元（2005 年：无），已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券差价收入

项目	2006 年度	2005 年度
卖出及到期兑付债券结算总额	507,474,690.68	120,431,506.25
减：卖出及到期兑付债券成本总额	489,050,453.33	116,370,210.08
减：应收利息总额	19,631,742.97	3,960,081.72
债券差价收入	-1,207,505.62	101,214.45

(10) 权证差价收入

本年度权证差价收入由卖出权证成交总额直接构成，卖出权证成本总额为零（2005 年：无）。

(11) 其他收入

项目	2006 年度	2005 年度
赎回基金补偿收入(a)	408,236.12	132,675.22
新股申购手续费返还	--	7,531.33
印花税返还	--	4,810.41
合计	408,236.12	145,016.96

(a) 本基金的赎回费率按持有期限递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。本基金的转换费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

(12) 其他费用

项目	2006 年度	2005 年度
信息披露费	94,333.34	113,333.33
审计费用	56,000.00	50,000.00
交易所回购交易费用	--	--
债券账户维护费	18,150.00	18,450.00
回购交易费	312.50	--
银行费用	829.50	--
银行间债券交易费	50.00	--
合计	169,675.34	181,783.33

(13) 本期已分配基金净收益

权益登记日、除权日	每 10 份基金份额分配收益	收益分配金额
2006 年度		
2006 年 4 月 13 日	0.50	24,428,419.85
2006 年 5 月 18 日	1.00	43,957,863.70
2006 年度累计收益分配	1.50	68,386,283.55
2005 年度：未实施收益分配		

附注 7. 本报告期末流通转让受到限制的基金资产

基金可使用以基金名义开设的股票账户，比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

股票代码	股票名称	获配日期	流通日期	申购价格	期末估值单价	数量(股)	年末成本总额	年末估值总额
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	5,000	94,400.00	94,400.00
601988	中国银行	06/06/28	07/01/05	3.08	5.43	471,570	1,452,435.60	2,560,625.10
合 计							1,546,835.60	2,655,025.10

附注 8. 资产负债表日后事项

本基金管理人于 2007 年 1 月 22 日宣告 2007 年度第一次分红，向截至 2007 年 1 月 19 日止在本基金注册登记人融通基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 8.70 元。

七、投资组合报告

(一) 融通债券基金投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目	金 额 (元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	6,681,963.70	2.41%
债券投资市值	245,220,209.58	88.56%
资产支持证券市值	19,980,999.35	7.22%
其他资产	5,002,959.12	1.81%
资产合计	276,886,131.75	100.00%

2、本报告期末按券种分类的债券投资组合

债券种类	市 值 (元)	占基金资产净值比例
国债	46,316,971.50	20.25%
可转债	22,584,391.40	9.87%
企业债	176,318,846.68	77.09%
合计	245,220,209.58	107.22%

3、本报告期末基金持有的资产支持证券情况

种类	市 值 (元)	占基金资产净值比例
资产支持证券	19,980,999.35	8.74%

4、本报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
06 浙物产 cp01	30,379,630.68	13.28%
06 华西村 CP01	29,195,755.89	12.77%
06 鲁泰 CP02	29,188,864.52	12.76%

02 国债(14)	26,552,100.00	11.61%
06 中化债	20,238,839.60	8.85%

5、本报告期末基金投资资产支持证券明细

债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
澜电 03	19,980,999.35	8.74%

6、投资组合报告附注

(1) 本报告期内基金投资的前十名证券中无发行主体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、处罚的证券；

(2) 其他资产的构成

项目	金 额 (元)
应收交易保证金	250,000.00
应收利息	3,279,117.85
应收申购款	1,473,841.27
合计	5,002,959.12

(3) 处于转股期的可转换债券明细

债券代码	债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
125959	首钢转债	12,779,158.50	5.59%
100726	华电转债	2,155,924.10	0.94%

(4) 报告期内本基金投资权证的情况

本基金为纯债券型基金。本报告期内，未发生权证投资业务。

(5) 报告期内本基金资产支持证券投资情况

名称	本期买入数量(份)	买入成本总额(元)	期末市值(元)	占基金资产净值比例
澜电 03	200,000	19,980,999.35	19,980,999.35	8.74%

(二) 融通深证 100 指数基金投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目	金 额 (元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	15,564,139.57	2.12%
股票投资市值	682,882,281.26	92.98%
债券投资市值	29,163,900.74	3.97%
权证投资市值	1,413,611.35	0.19%
其他资产	5,409,039.29	0.74%
资产合计	734,432,972.21	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

(1) 指数投资部分

行业	市 值 (元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	552,776.51	0.08%
B 采掘业	15,481,098.15	2.17%
C 制造业	377,502,171.76	52.91%
C0 食品、饮料	77,180,337.50	10.82%
C1 纺织、服装、皮毛	7,489,358.36	1.05%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	3,898,989.68	0.55%

C4 石油、化学、塑胶、塑料	31,417,628.35	4.40%
C5 电子	12,441,758.69	1.74%
C6 金属、非金属	130,644,726.21	18.31%
C7 机械、设备、仪表	79,645,579.25	11.16%
C8 医药、生物制品	31,135,425.08	4.36%
C99 其他制造业	3,648,368.64	0.51%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	19,560,194.70	2.74%
E 建筑业	4,348,302.75	0.61%
F 交通运输、仓储业	23,681,279.75	3.32%
G 信息技术业	41,781,641.24	5.86%
H 批发和零售贸易	19,421,500.30	2.72%
I 金融、保险业	39,320,262.03	5.51%
J 房地产业	111,598,873.41	15.64%
K 社会服务业	18,560,702.85	2.60%
L 传播与文化产业	3,129,845.36	0.44%
M 综合类	7,943,632.45	1.11%
合计	682,882,281.26	95.71%

(2) 积极投资部分

无

3、本报告期末股票投资明细

(1) 指数投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值的比例
1	000002	万 科 A	4,260,349	65,779,788.56	9.22%
2	000858	五 粮 液	1,474,271	33,687,092.35	4.72%
3	000001	S 深发展 A	2,299,757	33,277,483.79	4.66%
4	000063	中兴通讯	576,126	22,526,526.60	3.16%
5	000402	金 融 街	1,231,951	20,758,374.35	2.91%
6	000039	中集集团	1,074,699	20,247,329.16	2.84%
7	000069	华侨城 A	843,285	18,560,702.85	2.60%
8	000898	鞍钢股份	1,739,330	17,741,166.00	2.49%
9	000024	招商地产	567,506	16,105,820.28	2.26%
10	000895	S 双 汇	469,499	14,634,283.83	2.05%
11	002024	苏宁电器	314,932	14,297,912.80	2.00%
12	000825	太钢不锈	1,088,162	14,211,395.72	1.99%
13	000568	泸州老窖	540,578	13,698,246.52	1.92%
14	000792	盐湖钾肥	559,451	13,180,665.56	1.85%
15	000839	中信国安	535,412	12,212,747.72	1.71%
16	000623	吉林敖东	325,085	10,760,313.50	1.51%
17	000060	中金岭南	606,075	10,503,279.75	1.47%
18	000629	新 钢 钒	2,165,908	9,270,086.24	1.30%
19	000157	中联重科	368,970	8,202,203.10	1.15%
20	000527	美的电器	688,271	8,156,011.35	1.14%
21	000027	深能源 A	932,300	7,766,059.00	1.09%

22	000528	柳 工	453,740	7,758,954.00	1.09%
23	000983	西山煤电	865,587	7,747,003.65	1.09%
24	000709	唐钢股份	1,348,584	7,552,070.40	1.06%
25	000651	格力电器	629,672	7,474,206.64	1.05%
26	000729	燕京啤酒	760,310	7,428,228.70	1.04%
27	000538	云南白药	286,865	7,140,069.85	1.00%
28	000625	长安汽车	799,319	7,129,925.48	1.00%
29	000423	S 阿 胶	490,369	6,713,151.61	0.94%
30	000878	云南铜业	605,572	6,618,901.96	0.93%
31	000768	西飞国际	563,823	6,596,729.10	0.92%
32	000089	深圳机场	1,021,072	6,534,860.80	0.92%
33	000869	张 裕 A	126,591	6,306,763.62	0.88%
34	000562	宏源证券	496,939	6,042,778.24	0.85%
35	000410	沈阳机床	300,429	6,023,601.45	0.84%
36	000932	华菱管线	1,403,340	5,936,128.20	0.83%
37	000680	山推股份	720,396	5,892,839.28	0.83%
38	000088	盐 田 港	616,019	5,648,894.23	0.79%
39	000036	华联控股	1,214,663	5,636,036.32	0.79%
40	000778	新兴铸管	1,007,969	5,533,749.81	0.78%
41	000630	铜都铜业	764,000	5,164,640.00	0.72%
42	000061	农 产 品	401,850	5,123,587.50	0.72%
43	000031	中粮地产	525,371	4,843,920.62	0.68%
44	000800	一汽轿车	1,153,395	4,648,181.85	0.65%
45	000933	神火股份	412,366	4,622,622.86	0.65%
46	000970	中科三环	495,163	4,560,451.23	0.64%
47	000717	韶钢松山	1,254,578	4,516,480.80	0.63%
48	000021	长城开发	524,317	4,367,560.61	0.61%
49	000503	海虹控股	512,284	4,354,414.00	0.61%
50	000758	中色股份	527,067	4,348,302.75	0.61%
51	000006	深振业 A	306,560	4,110,969.60	0.58%
52	000900	现代投资	403,499	4,018,850.04	0.56%
53	002007	华兰生物	174,049	4,003,127.00	0.56%
54	000400	许继电气	427,420	3,957,909.20	0.55%
55	000012	南 玻 A	357,326	3,930,586.00	0.55%
56	000539	粤电力 A	695,894	3,917,883.22	0.55%
57	000488	晨鸣纸业	744,082	3,898,989.68	0.55%
58	000960	锡业股份	435,945	3,866,832.15	0.54%
59	000969	安泰科技	335,328	3,648,368.64	0.51%
60	000009	S 深宝安 A	848,515	3,589,218.45	0.50%
61	000581	威孚高科	463,467	3,587,234.58	0.50%
62	000807	云铝股份	318,751	3,397,885.66	0.48%
63	000767	漳泽电力	614,398	3,133,429.80	0.44%
64	000917	电广传媒	408,596	3,129,845.36	0.44%

65	000912	泸天化	393,218	3,126,083.10	0.44%
66	000937	金牛能源	522,059	3,111,471.64	0.44%
67	000401	冀东水泥	602,384	3,005,896.16	0.42%
68	000822	山东海化	576,291	2,789,248.44	0.39%
69	002008	大族激光	134,652	2,784,603.36	0.39%
70	000927	一汽夏利	516,007	2,781,277.73	0.39%
71	000422	湖北宜化	584,144	2,727,952.48	0.38%
72	000022	深赤湾A	148,700	2,722,697.00	0.38%
73	000601	韶能股份	727,524	2,582,710.20	0.36%
74	000959	首钢股份	751,905	2,563,996.05	0.36%
75	000429	粤高速A	569,756	2,552,506.88	0.36%
76	002022	科华生物	144,094	2,518,763.12	0.35%
77	000520	长航凤凰	753,878	2,457,642.28	0.34%
78	002025	航天电器	119,254	2,393,427.78	0.34%
79	000550	江铃汽车	179,389	2,224,423.60	0.31%
80	000619	海螺型材	295,126	2,222,298.78	0.31%
81	000916	华北高速	620,696	2,203,470.80	0.31%
82	000541	佛山照明	230,319	2,171,908.17	0.30%
83	000939	凯迪电力	270,352	2,160,112.48	0.30%
84	000636	风华高科	588,830	2,113,899.70	0.30%
85	000066	长城电脑	375,373	2,053,290.31	0.29%
86	000707	双环科技	526,167	2,052,051.30	0.29%
87	000962	东方钨业	295,022	2,023,850.92	0.28%
88	000016	深康佳A	459,814	1,912,826.24	0.27%
89	000659	珠海中富	611,318	1,907,312.16	0.27%
90	002028	思源电气	62,252	1,861,957.32	0.26%
91	000726	鲁泰A	235,492	1,853,322.04	0.26%
92	000733	振华科技	358,180	1,747,918.40	0.25%
93	000068	S三星	324,419	1,489,083.21	0.21%
94	000911	南宁糖业	151,996	1,425,722.48	0.20%
95	002046	轴研科技	85,378	1,178,216.40	0.17%
96	002001	新和成	188,985	954,374.25	0.13%
97	002027	七喜控股	126,840	621,516.00	0.09%
98	002041	登海种业	69,707	552,776.51	0.08%

(2) 积极投资部分

无

4、本报告期股票投资组合的重大变动

(1) 本期累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000002	万科A	143,242,908.58	21.25%
2	000001	S深发展A	63,356,567.02	9.40%
3	000858	五粮液	45,999,281.54	6.82%
4	000960	锡业股份	43,545,144.83	6.46%

5	000568	泸州老窖	41,766,709.33	6.19%
6	000410	沈阳机床	40,985,594.88	6.08%
7	000061	农 产 品	38,001,608.78	5.64%
8	000709	唐钢股份	36,710,163.78	5.44%
9	002024	苏宁电器	36,556,322.75	5.42%
10	000088	盐 田 港	34,036,739.90	5.05%
11	000825	太钢不锈	33,047,859.97	4.90%
12	000063	中兴通讯	31,682,236.29	4.70%
13	000898	鞍钢股份	28,748,299.59	4.26%
14	000039	中集集团	28,378,421.73	4.21%
15	000024	招商地产	27,056,396.79	4.01%
16	000060	中金岭南	24,673,253.26	3.66%
17	000792	盐湖钾肥	22,968,282.58	3.41%
18	000623	吉林敖东	21,814,121.65	3.24%
19	000069	华侨城 A	20,890,847.77	3.10%
20	000031	中粮地产	19,535,993.59	2.90%
21	000402	金 融 街	16,304,353.94	2.42%
22	000983	西山煤电	15,104,966.85	2.24%
23	000538	云南白药	14,790,499.87	2.19%

(2) 本期累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000002	万 科 A	185,249,145.29	27.48%
2	000001	S 深发展 A	83,041,185.84	12.32%
3	000063	中兴通讯	63,547,209.01	9.43%
4	000410	沈阳机床	61,442,500.64	9.11%
5	000858	五 粮 液	57,390,693.26	8.51%
6	002024	苏宁电器	46,426,141.97	6.89%
7	000568	泸州老窖	43,930,383.10	6.52%
8	000709	唐钢股份	40,600,144.09	6.02%
9	000825	太钢不锈	40,308,765.02	5.98%
10	000088	盐 田 港	39,765,952.14	5.90%
11	000069	华侨城 A	38,327,557.67	5.68%
12	000898	鞍钢股份	35,797,618.17	5.31%
13	000960	锡业股份	34,527,624.26	5.12%
14	000061	农 产 品	33,699,963.44	5.00%
15	000039	中集集团	32,379,553.31	4.80%
16	000060	中金岭南	31,608,603.15	4.69%
17	000024	招商地产	30,904,213.50	4.58%
18	000792	盐湖钾肥	30,259,868.55	4.49%
19	000402	金 融 街	28,025,659.35	4.16%
20	000031	中粮地产	26,476,669.16	3.93%

21	000983	西山煤电	20,435,386.95	3.03%
22	000538	云南白药	20,287,184.13	3.01%
23	000623	吉林敖东	18,561,639.16	2.75%
24	000839	中信国安	17,732,349.34	2.63%
25	000629	新 钢 钒	16,881,659.29	2.50%
26	000027	深能源 A	16,249,121.31	2.41%
27	000866	扬子退市	16,190,088.45	2.40%
28	000503	海虹控股	15,643,312.69	2.32%
29	000930	丰原生化	14,392,728.09	2.13%
30	000527	美的电器	13,814,182.30	2.05%
31	000089	深圳机场	13,741,247.43	2.04%

(3) 本报告期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金 额 (元)
买入股票的成本总额	1,241,223,802.14
卖出股票的收入总额	1,658,678,702.88

5、本报告期末债券投资组合

债券种类	市 值 (元)	占基金资产净值比例
国债	23,115,000.00	3.24%
可转债	3,629,874.02	0.51%
企业债	2,419,026.72	0.34%
合计	29,163,900.74	4.09%

6、本报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
02 国债(14)	23,115,000.00	3.24%
招商转债	3,629,874.02	0.51%
钢钒债 1	2,419,026.72	0.34%

7、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券中无发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券；

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中，无投资于基金合同规定备选股票库之外的股票；

(3) 其他资产的构成

项目	金 额 (元)
应收交易保证金	1,250,000.00
应收证券清算款	940,440.21
应收利息	132,947.93
应收申购款	3,085,651.15
合计	5,409,039.29

(4) 报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券；

(5) 报告期内本基金权证投资情况（年度）

权证名称	获配数量(份)	成本总额(元)	本期卖出数量(份)	卖出差价收入(元)
------	---------	---------	-----------	-----------

华菱 JTP1	1,666,176	--	1,666,176	2,619,226.12
五粮 YGC1	676,070	--	676,070.00	879,186.29
侨城 HQC1	600,176	--	600,176.00	7,090,514.68
钢钒 GFC1	738,950	--	--	--
五粮 YGP1	710,741	--	710,741.00	844,275.89
深能 JTP1	1,026,450	--	1,026,450.00	1,597,687.35
中集 ZYP1	693,690	--	693,690.00	1,803,426.91
钾肥 JTP1	275,858	--	275,858.00	899,657.62

注：本基金不允许主动投资权证业务，以上权证投资均属股权分置改革中对价支付获配部分，属被动投资。

(6) 报告期内本基金未投资资产支持证券。

(三) 融通蓝筹成长基金投资组合报告

1、本报告期末基金资产组合情况

项目	金 额 (元)	占基金资产总值比例
银行存款和清算备付金	20,693,758.23	4.33%
股票投资市值	320,574,470.99	67.04%
债券投资市值	118,439,789.52	24.77%
权证投资市值	4,193,296.00	0.88%
其他资产	14,287,264.67	2.99%
资产合计	478,188,579.41	100.00%

2、本报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市 值 (元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	--	--
B 采掘业	--	--
C 制造业	235,127,943.52	49.62%
C0 食品、饮料	--	--
C1 纺织、服装、皮毛	--	--
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	--	--
C4 石油、化学、塑胶、塑料	17,423,278.72	3.68%
C5 电子	--	--
C6 金属、非金属	200,495,324.80	42.31%
C7 机械、设备、仪表	--	--
C8 医药、生物制品	17,209,340.00	3.63%
C99 其他制造业	--	--
D 电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E 建筑业	--	--
F 交通运输、仓储业	--	--
G 信息技术业	9,737,685.49	2.06%
H 批发和零售贸易	39,513,360.00	8.34%
I 金融、保险业	30,580,077.50	6.45%

J 房地产业	5,615,404.48	1.19%
K 社会服务业	--	--
L 传播与文化产业	--	--
M 综合类	--	--
合计	320,574,470.99	67.65%

3、本报告期末股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占基金资产净值的比例
1	600022	济南钢铁	5,980,000	45,926,400.00	9.69%
2	000709	唐钢股份	8,047,808	45,067,724.80	9.51%
3	600019	宝钢股份	5,180,000	44,858,800.00	9.47%
4	000898	鞍钢股份	4,080,000	41,616,000.00	8.78%
5	600058	五矿发展	5,398,000	39,513,360.00	8.34%
6	000629	新 钢 钒	5,380,000	23,026,400.00	4.86%
7	600521	华海药业	1,271,000	17,209,340.00	3.63%
8	600030	中信证券	519,980	14,237,052.40	3.00%
9	002052	同洲电子	466,141	9,737,685.49	2.06%
10	000059	辽通化工	2,500,572	9,177,099.24	1.94%
11	002054	德美化工	903,196	8,246,179.48	1.74%
12	600036	招商银行	500,000	8,180,000.00	1.73%
13	000002	万 科 A	363,692	5,615,404.48	1.19%
14	600016	民生银行	540,000	5,508,000.00	1.16%
15	601988	中国银行	471,570	2,560,625.10	0.54%
16	601628	中国人寿	5,000	94,400.00	0.02%

4、本报告期股票投资组合的重大变动

(1) 本期累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600761	安徽合力	106,529,124.12	14.61%
2	600028	中国石化	95,456,766.55	13.09%
3	600019	宝钢股份	73,103,380.71	10.03%
4	600688	S 上石化	60,593,022.33	8.31%
5	000709	唐钢股份	55,863,973.25	7.66%
6	600058	五矿发展	51,032,119.19	7.00%
7	000001	S 深发展 A	45,356,299.11	6.22%
8	000898	鞍钢股份	44,836,270.75	6.15%
9	600022	济南钢铁	36,088,861.97	4.95%
10	600739	辽宁成大	35,668,646.39	4.89%
11	000629	新 钢 钒	35,312,950.02	4.84%
12	600900	长江电力	31,793,269.29	4.36%
13	000088	盐 田 港	31,730,412.16	4.35%
14	600420	现代制药	30,356,139.64	4.16%
15	601988	中国银行	27,353,804.65	3.75%
16	000951	中国重汽	26,352,261.59	3.62%
17	600590	泰豪科技	22,773,935.99	3.12%
18	000063	中兴通讯	19,762,204.11	2.71%
19	600309	烟台万华	19,702,015.06	2.70%

20	600030	中信证券	17,776,281.75	2.44%
21	601006	大秦铁路	17,093,984.99	2.34%
22	000878	云南铜业	16,097,464.78	2.21%
23	000933	神火股份	15,619,299.04	2.14%

(2) 本期累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600761	安徽合力	179,443,655.94	24.62%
2	600028	中国石化	151,980,955.70	20.85%
3	000951	中国重汽	133,207,521.83	18.27%
4	600320	振华港机	99,643,045.59	13.67%
5	600309	烟台万华	98,666,321.79	13.54%
6	000063	中兴通讯	80,393,609.39	11.03%
7	600420	现代制药	78,978,820.48	10.83%
8	600900	长江电力	59,461,217.47	8.16%
9	000088	盐田港	59,357,996.68	8.14%
10	600688	S 上石化	56,099,381.13	7.70%
11	600019	宝钢股份	53,131,108.81	7.29%
12	000001	S 深发展 A	46,395,246.69	6.36%
13	600739	辽宁成大	37,156,813.79	5.10%
14	000709	唐钢股份	32,070,525.09	4.40%
15	601988	中国银行	27,119,583.78	3.72%
16	000898	鞍钢股份	25,219,677.14	3.46%
17	600590	泰豪科技	24,283,151.72	3.33%
18	000629	新 钢 钒	19,173,802.96	2.63%
19	601006	大秦铁路	18,619,129.67	2.55%
20	000933	神火股份	18,483,056.61	2.54%
21	000825	太钢不锈	17,000,999.55	2.33%
22	000878	云南铜业	16,579,247.11	2.27%

(3) 本报告期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

项目	金 额 (元)
买入股票的成本总额	1,045,515,899.21
卖出股票的收入总额	1,427,548,790.50

5、本报告期末债券投资组合

债券种类	市 值 (元)	占基金资产净值比例
国债	111,454,500.00	23.52%
企业债	6,985,289.52	1.47%
合计	118,439,789.52	25.00%

6、本报告期末基金投资前五名债券明细

债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
02 国债(14)	111,454,500.00	23.52%
钢钒债 1	6,985,289.52	1.47%

7、投资组合报告附注

(1) 报告期内本基金投资的前十名证券中无发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券;

(2) 报告期内本基金投资的前十名股票中,无投资于基金合同规定备选股票库之外的

股票；

(3) 其他资产的构成如下：

项目	金 额 (元)
交易保证金	1,098,780.49
应收证券清算款	12,013,083.68
应收利息	575,064.57
应收申购款	600,335.93
合计	14,287,264.67

(4) 本报告期末基金未持有处于转股期的可转换债券；

(5) 报告期内本基金投资权证业务情况

权证名称	获配数量(份)	成本总额(元)	本期卖出数量(份)	卖出差价收入(元)
万华 HXB1	700,000	--	700,000	8,343,564.11
万华 HXP1	1,050,000	--	1,050,000	2,785,032.75
钢钒 GFC1	2,192,000	--	--	--
合计	3,942,000	--	1,750,000	11,128,596.86

注：以上权证投资均属股权分置改革中对价支付所获配部分，属被动投资。

(6) 报告期内本基金未投资资产支持证券。

八、基金份额持有人户数、持有人结构

项目	融通债券基金	融通深证 100 指数基金	融通蓝筹成长基金
持有人户数 (户)	10,058	60,410	14,418
平均每户持有基金份额 (份)	21,349.44	8,828.47	19,575.63
机构投资者持有份额 (份)	54,311,714.75	45,234,674.86	176,688,972.78
占总份额比例 (%)	25.29%	8.48%	62.60%
个人投资者持有份额 (份)	160,420,972.67	488,093,296.16	105,552,456.80
占总份额比例 (%)	74.71%	91.52%	37.40%

九、开放式基金份额变动

单位：份

项目	融通债券基金	融通深证 100 指数基金	融通蓝筹成长基金
基金合同生效日基金份额	873,462,694.11	477,689,377.16	766,073,014.14
本期期初基金份额	300,202,915.94	840,805,531.25	707,196,458.84
本期总申购份额	177,814,163.52	991,010,519.03	189,770,520.45
其中：基金分红转投资	21,687,289.21	72,975,462.19	13,912,996.69
本期总赎回份额	263,284,392.04	1,298,488,079.26	614,725,549.71
本期期末基金份额	214,732,687.42	533,327,971.02	282,241,429.58

十、重大事项揭示

- (一) 本报告期内未召开基金份额持有人大会。
- (二) 本报告期内基金管理人未发生重大人事变动

(三) 本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
 (五) 本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。
 (六) 本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员无受监管部门稽查或处罚的情形。

(七) 基金投资策略的改变

根据证监会《关于证券投资基金投资资产支持证券有关事项的通知》及基金合同的相关规定,本系列基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券,具体投资方案及相关事项请参阅 2006 年 7 月 11 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的公告。

(八) 本系列基金本报告期内实施收益分配情况:

融通债券投资基金			
公告日	权益登记日、除权日	每 10 份基金份额分红数	披露报纸
2006-1-9	2006-1-12	0.34 元	中国证券报、证券时报 上海证券报
2006-6-20	2006-2-23	0.40 元	
2006-5-11	2006-5-24	0.30 元	
融通深证 100 指数基金			
公告日	权益登记日、除权日	每 10 份基金份额分红数	披露报纸
2006-5-11	2006-5-22	0.20 元	中国证券报、证券时报 上海证券报
2006-5-26	2006-6-1	1.20 元	
2006-6-28	2006-7-5	0.50 元	
2006-10-12	2006-10-19	0.60 元	
2006-11-20	2006-11-23	0.50 元	
融通蓝筹成长基金			
公告日	权益登记日、除权日	每 10 份基金份额分红数	披露报纸
2006-4-10	2006-4-13	0.50 元	中国证券报、证券时报 上海证券报
2006-5-11	2006-5-18	1.00 元	

(九) 本系列基金聘任的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所有限公司,本年度支付的审计费用为 155000 元正,该事务所已连续提供了 4 年的审计服务。

(十) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

1、基金专用席位的选择标准和程序:

选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的标准包括以下六个方面:

- (1) 资质雄厚,信誉良好,注册资本不少于 3 亿元人民币;
- (2) 财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;
- (3) 经营行为规范,最近两年未因重大违规行为而受到中国证监会和中国人民银行处罚;

(4) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;
 (5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

(6) 研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、行业报告、市场走向分析、个股分析报告及其他专门报告,并能根据基金投资的特定要求,提供专门研究报告。

选择代理本公司所管理的基金进行证券买卖业务的证券经营机构的程序包括以下四个步骤:1) 券商服务评价;2) 拟定租用对象。由研究部根据以上评价结果拟定备选的券商;3) 上报批准。研究部将拟定租用对象上报分管副总经理批准;4) 签约。在获得批准后,按公司签约程序代表公司与确定券商签约。

2、融通债券基金席位交易情况

本基金为纯债券型基金。本年度选择了上海证券和中信建投证券席位作为本基金的专用席位交易。其交易量及佣金情况如下：

券商名称	席位数量 (个)	买卖债券成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	债券回购成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	交易佣金 (元)	占全年佣金总量比例
上海证券	1	666,112,562.00	81.04%	746,500,000.00	100.00%	111,146.20	52.64%
中信建投	1	155,813,643.53	18.96%	--	--	100,000.00	47.36%
合 计	2	821,926,205.53	100.00%	746,500,000.00	100.00%	211,146.20	100.00%

3、融通深证 100 指数基金席位交易情况

基金在本年度选择了海通证券、中信万通证券、长城证券、联合证券和五矿证券的席位作为本基金专用交易席位，原租用金通证券席位于 2006 年 1 月 10 日终止。

(1) 股票、权证成交量及佣金支付情况：

券商名称	席位数量 (个)	买卖股票成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	买卖权证成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	交易佣金 (元)	占全年佣金总量比例
海通证券	1	406,930,641.61	14.04%	1,723,634.58	10.95%	318,427.13	14.06%
中信万通	1	1,276,549.64	0.04%	--	0.00%	-2,688.58	-0.12%
长城证券	1	822,689,910.35	28.38%	6,920,690.22	43.98%	643,762.55	28.42%
长江证券	1	767,601,228.56	26.48%	--	0.00%	600,655.59	26.52%
联合证券	1	829,170,236.70	28.60%	7,091,223.74	45.06%	648,831.83	28.65%
五矿证券	1	71,501,552.14	2.47%	--	0.00%	55,950.44	2.47%
合 计	6	2,899,170,119.00	100.00%	15,735,548.54	100.00%	2,264,938.96	100.00%

(2) 债券及债券回购成交情况：

券商名称	买卖债券成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	债券回购成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例
海通证券	--	--	--	--
中信万通	144,209,297.50	100.00%	247,500,000.00	100.00%
长城证券	--	--	--	--
长江证券	--	--	--	--
联合证券	--	--	--	--
五矿证券	--	--	--	--
合 计	144,209,297.50	100.00%	247,500,000.00	100.00%

4、融通蓝筹成长基金席位交易情况

基金在本年度选择了海通证券、中信万通、联合证券、平安证券、中信建投、华林证券、招商证券、齐鲁证券、金元证券和东方证券为融通蓝筹成长基金的专用交易席位。其中东方证券席位为本年度新增交易席位，中信万通席位于 2006 年 10 月 23 日终止、平安证券席位于 2006 年 11 月 6 日终止。

(1) 股票、权证成交量及佣金支付情况：

券商名称	席位数量 (个)	买卖股票成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	买卖权证成交量 (元)	占全年该类交易成交量比例	交易佣金 (元)	占全年佣金总量比例
海通证券	1	54,600,505.95	2.21%	1,927,651.00	17.32%	43,267.87	2.18%

中信万通	1	23,697,731.61	0.96%	--	--	18,628.12	0.94%
联合证券	1	440,501,869.43	17.84%	--	--	344,695.42	17.37%
中信建投	1	372,396,251.17	15.08%	--	--	304,161.09	15.33%
华林证券	1	49,767,633.77	2.02%	--	--	38,943.58	1.96%
招商证券	2	704,854,912.67	28.55%	--	--	575,060.47	28.98%
齐鲁证券	1	4,577,669.14	0.19%	--	--	3,753.71	0.19%
金元证券	1	458,844,941.22	18.58%	9,201,808.46	82.68%	374,047.07	18.85%
东方证券	1	359,890,244.47	14.58%	--	--	281,616.14	14.19%
平安证券	1	--	--	--	--	--	--
合 计	11	2,469,131,759.43	100.00%	11,129,459.46	100.00%	1,984,173.47	100.00%

(2) 债券及债券回购成交情况：

券商名称	买卖债券 成交量（元）	占全年该类 交易成交量比例	债券回购 成交量（元）	占全年该类 交易成交量比例
海通证券	100,065,910.90	12.52%	50,000,000.00	100.00%
中信万通	78,862,439.80	9.86%	--	--
联合证券	--	--	--	--
中信建投	119,238,897.60	14.91%	--	--
华林证券	--	--	--	--
招商证券	282,008,361.10	35.27%	--	--
齐鲁证券	--	--	--	--
金元证券	219,189,022.80	27.41%	--	--
东方证券	189,659.95	0.02%	--	--
平安证券	--	--	--	--
合 计	799,554,292.15	100.00%	50,000,000.00	100.00%

(十一) 本系列基金代销机构变更情况

2006 年度本系列基金新增了如下代销机构：

公告日期	新增代销机构	信息披露报纸名称
2006-11-02	华龙证券	中国证券报、证券时报、上海证券报
2006-10-23	恒泰证券	中国证券报、证券时报、上海证券报
2006-7-27	信泰证券	中国证券报、证券时报、上海证券报
2006-7-20	第一创业证券、 东北证券、国盛证券、 宏源证券、金元证券	中国证券报、证券时报、上海证券报
2006-2-13	国都证券	中国证券报、证券时报、上海证券报

(十二) 从 2006 年 2 月 27 日起，本系列基金开通与融通易支付货币市场证券投资基金之间的基金转换业务。

具体内容请参阅 2006 年 2 月 23 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的公告。

(十三) 自 2006 年 4 月 17 日起，中国工商银行新增融通蓝筹成长证券投资基金定投业务。具体内容请参阅 2006 年 4 月 14 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的《中国工商银行关于增加基金定投业务基金产品的通告》。

(十四) 从 2006 年 5 月 22 日起，本基金管理人开通“银联通”开放式基金网上直销业务。具体内容请参阅 2006 年 5 月 22 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的公告。

(十五) 从 2006 年 11 月 21 日起，本系列基金开通与融通新蓝筹基金之间的基金转换

业务。

具体内容请参阅 2006 年 11 月 20 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的公告。

(十六) 期后事项

本基金管理人于 2007 年 2 月 3 日及 2 月 5 日发布《融通基金管理有限公司关于公司高级管理人员变更的公告》，聘任刘模林先生为公司副总经理，免去刘小山先生的副总经理职务。

十一、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》；
- (五) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》；
- (六) 融通基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- (七) 基金托管人中国工商银行业务资格批件和营业执照。

存放地点：基金管理人、基金托管人处

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

融通基金管理有限公司

2007 年 3 月 27 日