

融通通利系列证券投资基金
2007 年半年度报告

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 8 月 29 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。本半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根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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、主要财务指标和基金净值表现	2
(一) 主要财务指标	2
(二) 基金净值表现	3
三、管理人报告	5
(一) 基金管理人及基金经理简介	5
(二) 基金运作合规性声明	5
(三) 基金经理报告	5
四、托管人报告	7
五、财务会计报告 (未经审计)	7
(一) 融通债券基金财务会计报告	8
(二) 融通深证 100 指数基金财务会计报告	13
(三) 融通蓝筹成长基金财务会计报告	19
六、投资组合报告	26
(一) 融通债券基金投资组合报告	26
(二) 融通深证 100 指数基金投资组合报告	27
(三) 融通蓝筹成长基金投资组合报告	35
七、基金份额持有人户数、持有人结构	41
八、开放式基金份额变动 (单位: 份)	42
九、重大事项揭示	42
十、备查文件目录	45

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	252,622,599.74 份
融通深证 100 指数基金	8,467,753,295.46 份
融通蓝筹成长基金	4,476,772,562.33 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 $\times 95\%$ + 银行同业存款利率 $\times 5\%$ 。

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： $75\% \times$ 国泰君安指数 $+ 25\% \times$ 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：吴治平
 联系电话：(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》、《上海证券报》、《证券时报》
 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) 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、主要财务指标和基金净值表现

重要提示：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。

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

项目	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日		
	融通债券基金	融通深证 100 指数基金	融通蓝筹成长基金
基金本期净收益	24,786,629.55	930,480,046.30	1,203,684,051.40
加权平均基金份额本期净收益	0.1064	0.2933	0.1955
期末可供分配基金收益	43,656,299.13	657,850,637.81	1,333,013,941.81

期末可供分配基金份额收益	0.1728	0.0777	0.2978
期末基金资产净值	296,278,898.87	13,047,744,277.82	5,809,786,504.14
期末基金份额净值	1.173	1.541	1.298
基金加权平均净值收益率	9.35%	19.85%	17.53%
本期基金份额净值增长率	10.14%	85.57%	45.18%
基金份额累计净值增长率	38.70%	274.30%	201.93%

(二) 基金净值表现

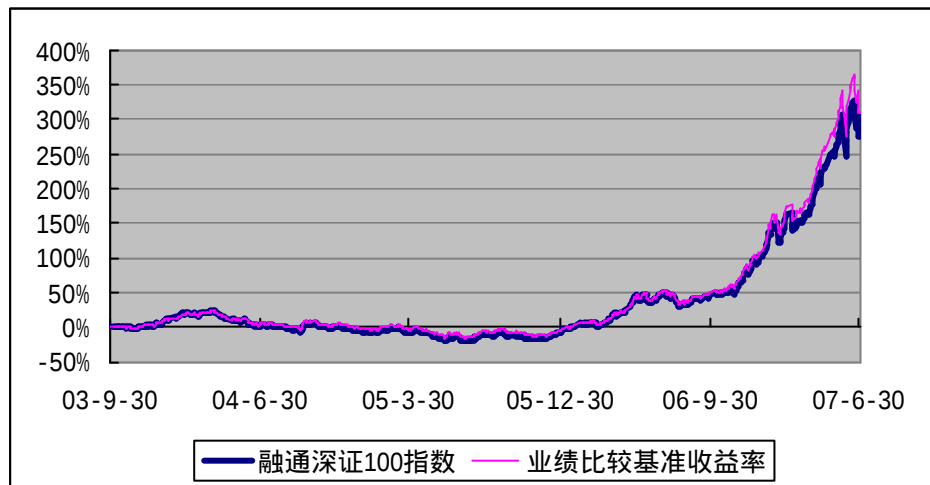
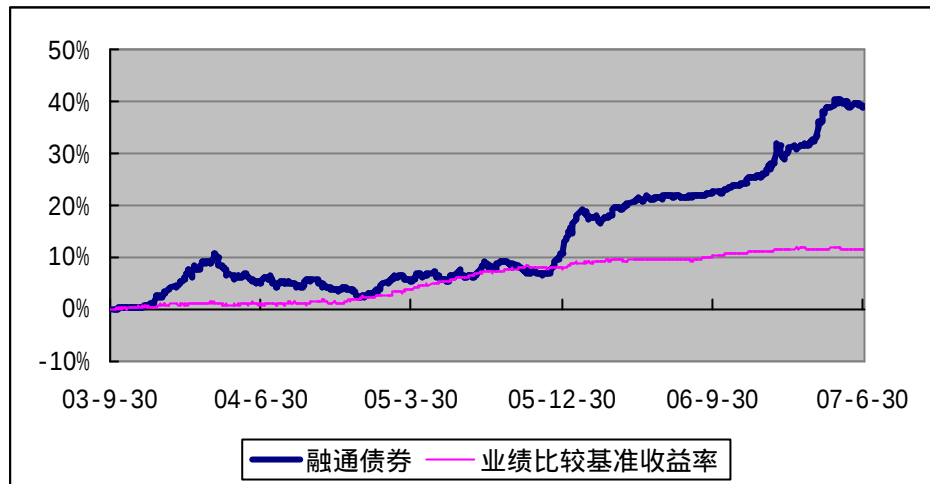
1、基金历史各阶段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

融通债券基金						
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去 1 个月	-0.76%	0.18%	0.20%	0.05%	-0.96%	0.13%
过去 3 个月	4.92%	0.29%	0.21%	0.07%	4.71%	0.22%
过去 6 个月	10.14%	0.31%	0.53%	0.07%	9.61%	0.24%
过去 1 年	13.99%	0.23%	1.84%	0.06%	12.15%	0.17%
过去 3 年	32.01%	0.24%	10.52%	0.09%	21.49%	0.15%
自基金合同生效起至今	38.70%	0.24%	11.56%	0.10%	27.14%	0.14%
融通深证 100 指数基金						
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去 1 个月	-2.71%	3.14%	-2.06%	3.13%	-0.65%	0.01%
过去 3 个月	41.95%	2.50%	46.29%	2.53%	-4.34%	-0.03%
过去 6 个月	85.57%	2.49%	96.63%	2.50%	-11.06%	-0.01%
过去 1 年	154.05%	2.02%	173.90%	2.02%	-19.85%	0.00%
过去 3 年	271.19%	1.56%	298.17%	1.53%	-26.98%	0.03%
自基金合同生效起至今	274.30%	1.46%	311.07%	1.44%	-36.77%	0.02%

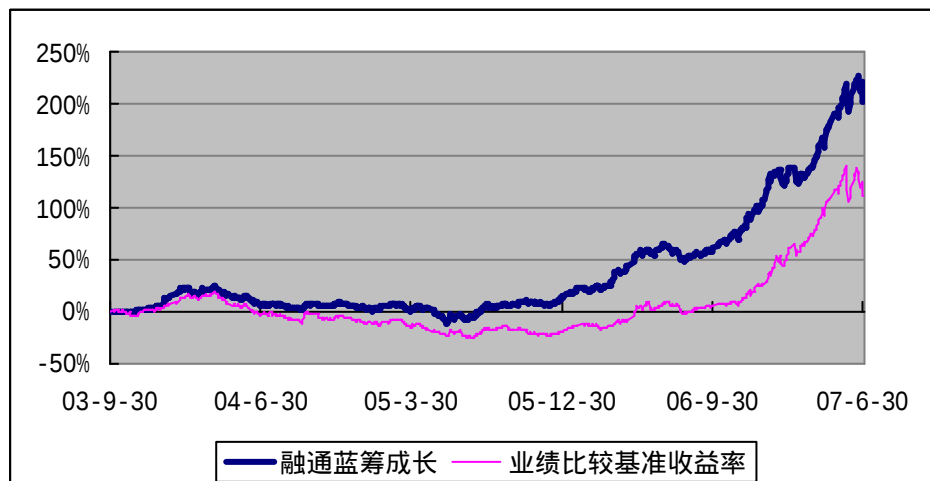
注：本基金于 2005 年 8 月 22 日调整资产配置比例，2005 年 8 月 21 日之前（含此日）为“75%×深证 100 指数 + 25%×银行间债券综合指数”，2005 年 8 月 22 日起采用新的业绩比较基准：深证 100 指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。

融通蓝筹成长基金						
阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去 1 个月	-1.74%	1.89%	-6.40%	2.47%	4.66%	-0.58%
过去 3 个月	26.14%	1.75%	22.29%	2.01%	3.85%	-0.26%
过去 6 个月	45.18%	1.66%	66.04%	1.90%	-20.86%	-0.24%
过去 1 年	83.96%	1.39%	97.38%	1.52%	-13.42%	-0.13%
过去 3 年	188.45%	1.10%	120.38%	1.27%	68.07%	-0.17%
自基金合同生效起至今	201.93%	1.06%	110.87%	1.21%	91.06%	-0.15%

2、基金累计净值增长率与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“ $75\% \times \text{深证 100 指数} + 25\% \times \text{银行间债券综合指数}$ ”，2005 年 8 月 22 日起使用新基准即“ $\text{深证 100 指数收益率} \times 95\% + \text{银行同业存款利率} \times 5\%$ ”。



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、日兴资产管理有限公司(Nikko Asset Management Co., Ltd.)和新时代证券有限责任公司。

截止到 2007 年 6 月底,公司管理的基金共有八只,一只封闭式基金:基金通乾,七只开放式基金: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、融通动力先锋基金和融通领先成长基金,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。

陈晓生先生,融通蓝筹成长基金基金经理,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、融通动力先锋基金基金经理、同时兼任日兴黄河基金融通模拟组合组合经理。

严菲女士,融通蓝筹成长基金基金经理,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

2007 年上半年本基金净值从 1.065 增长到 1.173 元,增长幅度为 10.14%,本基金的比较基准银行间债券指数上涨仅 0.53%,基金业绩远远胜出比较基准。更有代表性的交易所债券指数甚至在整个 07 年上半年下跌了 0.89%。(指数数据来自北方之星软件)

作为不能参与股票投资包括新股申购的纯债券基金,在 2007 年股票市场大牛的背景下,在 CPI 不断攀高导致加息压力不断增大的环境中,基金操作难度日益加大。基金管理人本着理性尽责的原则,确定两个投资方向:(1)以交易所可分离交易可转债为主要投资标的,因这批债券的到期收益率普遍在 5%以上,而且发债主体均为大型国有企业集团,信誉卓著,我们买入持有至少可获取一个较高的利息收益,可以为基金持有人带来年化 3%以上稳定的回报;(2)发挥基金经理选股选券能力的长项,在控制总体可转债仓位背景下,对我们可以投资的可转债中的优质品种做重点投资。上半年在钢铁和电力类转债上获得了不错的赢利。其他国债和金融债方面,主要是根据基金合同要求做配置性投资。

展望 2007 年下半年的债券市场，一种可能性是商业银行加大投资债券比例导致债券市场逆转，另一种概率更大的可能是在 CPI 走高和央行加息压力下债券市场继续疲软。我们的目标是为投资者提供资金安全性的同时，争取一个高于银行定期存款的投资回报。阶段性投资策略继续以交易所 3-5 年的分离交易企业债为重点，同时寻求流动性好、基本面优良、强制赎回压力小的可转债投资机会。

衷心感谢持有人对本基金的关爱和信任，基金经理将继续本着理性、尽责的专业精神，为持有人资产的安全和增值而努力。

2、融通深证 100 指数基金经理报告

2007 年上半年证券市场继续大幅度上涨，上证综合指数上涨 42.8%，但是从年初到 5 月底，证券市场的热点转移到低价微利股及题材股，进入 6 月份以后出现了两次较大幅度的调整，许多前期上涨较快的题材股遭遇深幅回调，但是就上半年整体情况来看，低价题材类个股的整体上涨幅度还是远远超出大盘蓝筹类个股。根据申万研究所提供的数据，低价股和微利股指数上半年累计涨幅均超过 120%，而同期上证 50 指数只上涨 61.52%。

由于深证 100 指数成份股的风格特点和行业特点：深证 100 指数的成份股的整体业绩增长超出其他跨市场的指数；房地产、黑色金属、消费类资产与有色金属资产是本基金的核心资产；大盘蓝筹股权重相对其他指数权重较小，风格特点接近于低价股指数。在这些因素的共同作用下，深证 100 指数在 2007 年上半年涨幅超出其他跨市场指数和大盘蓝筹指数的表现，上半年融通深证 100 指数基金复权净值增长率 85.57%，同期沪深 300 指数增长 84.42%，上证 50 指数增长 61.52%。在基金的实际运作中，由于上半年融通深证 100 指数基金资产份额有大幅度的增加，从 5 亿份到增加到近 85 亿份，持续申购带来的整体仓位偏差和一些重要权重个股停牌导致的个股仓位偏差带来一定的负贡献。

2007 年上半年的证券市场在是否存在泡沫的争论中上行，但是从行业的角度来看证券市场的发展，我们依然坚信目前证券市场还处于行业成长期的初期。虽然近期投资者担心流动性会收紧、信贷投放会放缓、甚至可能还会有其他的宏观调控政策的出台，但是这些情况的出现都不能动摇我们对行业发展的判断。虽然目前整个市场的估值水平已经考虑了一定幅度的企业成长性溢价，在成交量萎缩的情况下，6、7 月份指数还出现了一定幅度的调整，但我们认为这种情况只不过是“成长期的烦恼”。指数保持一定幅度的震荡调整对证券市场的长期稳定发展是非常有益的。随着宏观经济结构的进一步改善和上市公司治理结构的完善，上市公司赢利能力还将进一步释放，从 7 月份以来的上市公司预增情况就可以清晰地看出这一点。所以 A 股指数整体估值水平相对其他成熟市场保持一定的溢价是较为合理的。下半年，我们依然将紧紧抓住上市公司业绩持续提高这一主线。整体上市和资产注入以及公司治理结构改善、自主创新及国际产业转移、人民币长期持续升值、股指期货和金融创新、奥运会和重大政策调整带来的区域经济发展等将是我们最关注的热点。

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。2007 年上半年本基金分红 4 次，累计分红每基金份额 0.61 元。本基金运用指数化投资方式，竭力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，减少基金相对深证 100 指数的跟踪误差，力求最终实现对深证 100 指数的有效跟踪。6 月 29 日本基金股票投资部分的日跟踪误差为 0.25%，上半年平均日跟踪误差为 0.23%，严格控制在基金合同规定的 0.5% 的范围以内。

3、融通蓝筹成长基金经理报告

第一、2007 年上半年证券市场回顾

2007 年上半年中国股票市场尽管延续了 2006 年牛气冲天的辉煌，但也出现两个显著的变化：一是市场振荡加剧；二是市场结构分化日益突出。上半年两次“泡沫论”的探讨分别在一季度和二季度各引发了一次阶段性调整，一季度的调整幅度为 15%，二季度的调整幅度为 22%，这两次调整的压力更多的来自于获利回吐的压力。尽管沪综指冲上 4300 点的中国股市从静态估值水平来看已经不再便宜，但在考虑了未来 2-3 年的成长性的基础上，我们仍然可以选择出一批个股，中、长期持有它们的期望回报率仍然大大超过中长期债券的收益率。也即从动态估值水平评估，中国 A 股市场相对于国债投资仍然存在良好的投资吸引力。

始于 2005 年上证指数 1000 点的牛市是加息背景下由基本面推动的牛市，它显著的特点是“好公司具有好股价”。从过去三年角度来看，的确涨幅居前的仍然是质优股票占多

数。但 2007 年上半年特别是 1 月中旬到 5 月中，低价题材股成为市场的主力，涨幅巨大。我们认为，质地优良的个股和低价题材股在大牛市的背景下均有表现的机会，但它们之间存在巨大的差异：质地优良的个股如茅台、万科、沪东重机等涨一段，调整后均再创新高。时间是好公司的朋友，拿着好公司的时间越长，亏钱的机会就越小，赚大钱的机会就越大。而低价题材股往往在很短的时间内涨很大的幅度，但随后的调整常常以暴跌告终，5 月底市场进入调整时大部分低价题材股出现了 5 个跌停板甚至更大幅度的调整就是很好的证明。

一季度市场的振荡调整使市场热点从绩优股转向低价题材股，第二季度的调整再次改变了市场的重心，质优股再次获得市场的追捧。投资者的结构变化是造成这一现象的重要因素，我们相信下半年增量资金将回流机构，基本面良好的投资品种胜出的概率更大。

第二、基金操作回顾

作为价值投资的坚持者，我们一直坚持中、长期持有质优品种的投资策略，即便期间遭遇困难。上半年我们基本保持组合的稳定，具有持续成长能力的成长股以及仍然具有良好成长性的蓝筹股是本组合重点配置目标。

今年年初，蓝筹成长基金在大比例分红获得大额申购后，由于资产配置上出现一定的失误，上半年没能为广大投资带来满意的回报，作为本基金的投资管理人，我们深表歉意。第二季度末本基金已经完成结构调整过程，我们适当提高了个股的集中度，增持中、长期重点品种的配置权重。

第三、2007 年下半年投资展望

我们认为，至今年中期，中国股票市场正逐步完成从“恢复性牛市”向“结构性牛市”的过渡。“恢复性牛市”主要靠股改、估值水平的提升加上业绩增长三轮驱动，当市场估值水平达到均衡水准后，市场再向上拓展空间的推动力将更多的要依靠上市公司良好的业绩增长。我们相信下半年市场将展开依靠基本面特别是业绩增长来推动的“结构性牛市”的可能性很大，基于此，我们认为下半年时机选择的重要性将让位于结构配置，具有良好成长性的投资品种将更受投资者的青睐。

股改的成功给中国股票市场带来重大变化，其中影响最深远的变化就是实业资本开始参与股票市场的定价，这使得投资者运用实业的眼光来判断市场及个股的可投资性变得越来越重要。

从产业的角度看，我们认为以金融、地产为主导的服务业；以装备制造为代表的先进制造业、消费类资产以及资源性资产（如煤炭和有色）具有良好的投资吸引力，随着资源向优势企业集中的趋势的不断强化，我们认为这些类别资产中各子行业的龙头优势企业值得重点关注，市场最将给予它们更高的估值溢价。

第四、2007 年下半年操作计划

2007 年下半年，蓝筹成长仍然坚持精选个股的投资策略。随着股改成功以及市场化程度的不断提高，我们坚信“二八”效应将在股票市场上逐步显现出来。具有领先优势的行业龙头公司将更易于获得各类资源，利于扩大和巩固领先优势。从行业和板块方面，房地产行业、证券行业、银行业及航空业均是本基金重点关注和配置的重要领域。基于实业的眼光，我们认为这些资产在未来的半年中仍然有能力为我们带来不错的超额收益。

四、托管人报告

2007 年上半年，本基金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》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

2007 年上半年，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基金合同的规定进行。

2007 年上半年，融通通利系列证券投资基金之一的融通蓝筹成长证券投资基金因证券市场波动发生过不符合《证券投资基金运作管理办法》或基金合同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，及时对融通蓝筹成长证券投资基金

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 2007 年上半年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。

中国工商银行资产托管部

2007 年 8 月 20 日

五、财务会计报告（未经审计）

（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

二〇〇七年六月三十日

单位：人民币元

	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		14,696,285.71	6,411,003.51
清算备付金		872,106.42	270,960.19
交易保证金		109,733.30	250,000.00
应收证券清算款		--	--
应收股利		--	--
应收利息	5(1)	2,847,429.58	3,279,117.85
应收申购款		37,485,312.27	1,473,841.27
其他应收款		--	--
债券投资市值		264,177,904.84	265,201,208.93
其中：债券投资成本		263,019,395.86	264,537,220.46
买入返售证券		--	--
待摊费用		--	--
其他资产		--	--
资产总计		320,188,772.12	276,886,131.75
负债：			
应付证券清算款		--	1,437,967.98
应付赎回款		22,366,054.98	1,853,674.44
应付赎回费		48,958.64	2,110.11
应付管理人报酬		149,277.79	118,594.51
应付托管费		49,759.25	39,531.50
应付佣金	5(2)	55,436.06	82,974.15
应付利息		--	6,568.57
应付收益		--	--
其他应付款	5(3)	1,163,982.47	999,279.69
卖出回购证券款		--	43,500,000.00
预提费用	5(4)	76,404.06	139,333.32
其他负债		--	--
负债合计		23,909,873.25	48,180,034.27
持有人权益：			

实收基金	5(5)	252,622,599.74	214,732,687.42
未实现利得	5(6)	-6,416,168.90	-5,167,662.83
未分配收益		50,072,468.03	19,141,072.89
持有人权益合计		296,278,898.87	228,706,097.48
负债及持有人权益总计		320,188,772.12	276,886,131.75
基金份额净值		1.173	1.065

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日
一、收入		26,077,703.95	33,248,492.51
债券差价收入	5(7)	21,486,682.53	29,965,676.37
权证损益	5(8)	1,514,796.81	--
债券利息收入		2,706,032.34	3,089,994.29
存款利息收入		126,908.82	94,440.00
买入返售证券收入		135,543.00	18,270.00
其他收入	5(9)	107,740.45	80,111.85
二、费用		1,291,074.40	1,436,037.30
基金管理人报酬	4(2)	788,059.31	849,011.83
基金托管费	4(3)	262,686.49	283,003.93
卖出回购证券支出		42,103.62	110,967.56
其他费用	5(10)	198,224.98	193,053.98
其中：信息披露费		49,588.57	43,713.17
审计费用		22,315.49	22,315.49
其 他		126,320.92	127,025.32
三、基金净收益		24,786,629.55	31,812,455.21
加：未实现利得		494,520.51	-4,295,458.38
四、基金经营业绩		25,281,150.06	27,516,996.83

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日
本期基金净收益		24,786,629.55	31,812,455.21
加：期初基金净收益		19,141,072.89	11,600,359.61
加：本期损益平准金		6,144,765.59	1,788,457.45
可供分配基金净收益		50,072,468.03	45,201,272.27
减：本期已分配基金净收益		--	29,928,674.43
期末基金净收益		50,072,468.03	15,272,597.84

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		228,706,097.48	310,474,035.03
二、本期经营活动			
基金净收益		24,786,629.55	31,812,455.21
未实现利得		494,520.51	-4,295,458.38
经营活动产生的基金 净值变动数		25,281,150.06	27,516,996.83
三、本期基金份额交易			
基金申购款		724,895,027.32	149,831,367.66
基金赎回款		-682,603,375.99	-161,677,222.55
基金份额交易产生的 基金净值变动数		42,291,651.33	-11,845,854.89
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		--	-29,928,674.43
五、期末基金净值		296,278,898.87	296,216,502.54

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份额部分共募集 2,116,929,381.80 份基金份额, 其中包括本基金 873,320,777.53 份基金份额、融通深证 100 指数证券投资基金 477,610,977.87 份基金份额和融通蓝筹成长证券投资基金 765,997,626.40 份基金份额, 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。本基金募集期认购资金利息折份额部分为 141,916.58 份基金份额, 基金成立日本基金份额总额为 873,462,694.11 份。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》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%。

附注 2. 本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表是一致的。

附注 3. 本报告期末发生重大会计差错的内容和更正金额。

附注 4. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

企业名称	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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东(注)
新时代证券有限责任公司	基金管理人股东(注)
联合证券有限责任公司	基金管理人原股东、基金代销机构(注)
陕西省国际信托投资股份有限公司	基金管理人原股东(注)
华林证券有限责任公司	基金管理人原股东(注)

(注)详见“九、重大事项揭示(二)本报告期基金管理人的股权变更事项”

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) 基金管理人报酬

支付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。

本基金在本期需支付基金管理人报酬 788,059.31 元(2006 年同期：849,011.83 元)。

(3) 基金托管费

支付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。

本基金在本期需支付基金托管费 262,686.49 元(2006 年同期：283,003.93 元)。

(4) 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 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 14,696,285.71 元(2006 年 6 月 30 日：37,610,294.27 元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 114,355.98 元(2006 年同期：87,874.56 元)。

(5) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与基金托管人中国工商银行进行的银行间同业市场交易明细如下：

交易日期	交易类型	成交金额(元)
2007-1-10	卖出银行间债券	30,806,973.70

2006 年度同期末与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

(6) 基金各关联方投资本基金的情况

A. 基金管理公司期末持有本基金份额的情况

无(2006 年 6 月 30 日：无)。

B. 基金管理公司的主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

无(2006 年 6 月 30 日：无)。

附注 5. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2007-6-30
应收债券利息	2,840,618.84
应收银行存款利息	6,396.79
应收清算备付金利息	353.25
应收申购款利息	60.70
合计	2,847,429.58

(2) 应付佣金

项目	2007-6-30
中信建投证券有限责任公司	25,561.90
上海证券有限责任公司	29,874.16

合计	55,436.06
----	-----------

(3) 其他应付款

项目	2007-6-30
应付企业债税金	910,810.80
应付券商席位保证金	250,000.00
应付后端申购费	2,996.67
应付债券交易手续费	175.00
合计	1,163,982.47

(4) 预提费用

项目	2007-6-30
信息披露费	49,588.57
审计费用	22,315.49
债券账户维护费	4,500.00
合计	76,404.06

(5) 实收基金

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
期初数	214,732,687.42
加：本期申购	623,426,789.88
减：本期赎回	585,536,877.56
期末数	252,622,599.74

(6) 未实现利得

	未实现估值增值	未实现利得平准金	合计
2006 年 12 月 31 日	663,988.47	-5,831,651.30	-5,167,662.83
加：本期净变动数	494,520.51		494,520.51
加：本期申购基金份额		-4,306,672.84	-4,306,672.84
减：本期赎回基金份额		-2,563,646.26	-2,563,646.26
2007 年 6 月 30 日	1,158,508.98	-7,574,677.88	-6,416,168.90

(7) 债券差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出债券结算总额	278,606,338.54
减：卖出债券成本总额	253,545,842.83
减：应收利息总额	3,573,813.18
债券差价收入	21,486,682.53

(8) 权证损益

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出权证成交总额	2,710,166.75
减：卖出权证成本总额	1,195,369.94
权证损益	1,514,796.81

本基金权证损益是因投资可分离债券而被动获配的权证部分的卖出差价收入,非主动投资。

(9) 其他收入

截止 2007 年 6 月 30 日,其他收入余额均为基金赎回费按 25%的比例归入基金资产的部分。

(10) 其他费用

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
债券交易佣金	106,292.56
信息披露费	49,588.57

审计费用	22,315.49
债券托管账户维护费	16,620.00
银行间交易手续费	644.55
交易所交易手续费	1,051.81
银行费用	1,712.00
合计	198,224.98

(11) 收益分配情况

本基金在本报告期内未进行收益分配。

附注 6. 本报告期末流通转让受到限制的基金资产

无

(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

二〇〇七年六月三十日

单位：人民币元

	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
资产：			
银行存款		519,571,835.96	14,079,572.87
清算备付金		43,769,273.49	1,484,566.70
交易保证金		6,762,091.91	1,250,000.00
应收证券清算款		--	940,440.21
应收股利		--	--
应收利息	5(1)	4,726,782.95	132,947.93
应收申购款		242,181,754.57	3,085,651.15
股票投资市值		12,209,987,184.20	682,882,281.26
其中：股票投资成本		11,549,800,667.52	520,675,521.57
债券投资市值		281,329,115.78	29,163,900.74
其中：债券投资成本		279,476,216.48	27,183,020.42
权证投资		39,649,131.43	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		13,347,977,170.29	734,432,972.21
负债：			
应付证券清算款		63,585,621.56	--
应付赎回款		212,183,506.95	10,815,372.86
应付赎回费		470,333.87	21,468.74
应付管理人报酬		9,891,289.44	643,021.56
应付托管费		1,978,257.90	128,604.32
应付佣金	5(3)	10,909,404.13	933,887.20
应付利息		--	460.00

应付收益		--	--
其他应付款	5(4)	1,120,718.47	1,275,139.69
卖出回购证券款		--	7,000,000.00
预提费用	5(5)	93,760.15	148,333.34
其他负债		--	--
负债合计		300,232,892.47	20,966,287.71
持有人权益：			
实收基金	5(6)	8,467,753,295.46	533,327,971.02
未实现利得	5(7)	3,922,140,344.55	94,700,422.84
未分配收益		657,850,637.81	85,438,290.64
持有人权益合计		13,047,744,277.82	713,466,684.50
负债及持有人权益总计		13,347,977,170.29	734,432,972.21
基金份额净值		1.541	1.338

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附 注	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日
一、收入		957,489,800.82	135,331,321.74
股票差价收入	5(8)	902,441,214.67	119,827,522.34
债券差价收入	5(9)	1,130,633.98	-401,669.02
权证差价收入	5(10)	1,191,187.88	8,643,460.18
债券利息收入		1,332,217.79	419,541.49
存款利息收入		1,249,382.67	64,208.10
股利收入		45,747,964.23	6,375,363.96
其他收入	5(11)	4,397,199.60	402,894.69
二、费用		27,009,754.52	3,348,302.94
基金管理人报酬	4(3)	22,241,887.18	2,630,400.53
基金托管费	4(4)	4,448,377.46	526,080.15
卖出回购证券支出		213,048.63	106,979.00
其他费用	5(12)	106,441.25	84,843.26
其中：信息披露费		49,588.57	43,713.17
审计费用		39,671.58	29,752.78
回购交易费用		1,750.13	--
三、基金净收益		930,480,046.30	131,983,018.80
加：未实现利得		536,668,849.70	113,997,980.98
四、基金经营业绩		1,467,148,896.00	245,980,999.78

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日
--	----	-------------------------------------	-------------------------------------

本期基金净收益		930,480,046.30	131,983,018.80
加：期初基金净收益		85,438,290.64	-86,869,471.13
加：本期损益平准金		439,980,244.64	37,952,221.99
可供分配基金净收益		1,455,898,581.58	83,065,769.66
减：本期已分配基金净收益	5(13)	798,047,943.77	51,961,632.31
期末基金净收益		657,850,637.81	31,104,137.35

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 6 月 30 日	2006 年 1 月 1 日 至 2006 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		713,466,684.50	674,227,284.72
二、本期经营活动			
基金净收益		930,480,046.30	131,983,018.80
未实现利得		536,668,849.70	113,997,980.98
经营活动产生的基金 净值变动数		1,467,148,896.00	245,980,999.78
三、本期基金份额交易			
基金申购款		18,169,638,494.64	409,066,502.80
基金赎回款		-6,504,461,853.55	-783,473,132.52
基金份额交易产生的 基金净值变动数		11,665,176,641.09	-374,406,629.72
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		-798,047,943.77	-51,961,632.31
五、期末基金净值		13,047,744,277.82	493,840,022.47

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折份额部分共募集 2,116,929,381.80 份基金份额，其中包括本基金 477,610,977.87 份基金份额、融通债券投资基金 873,320,777.53 份基金份额和融通蓝筹成长证券投资基金 765,997,626.40 份基金份额，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。本基金募集期认购资金利息折份额部分为 78,399.29 份基金份额，基金合同生效日本基金份额总额为 477,689,377.16 份。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》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 指数的跟踪误差不超过 0.5%。

附注 2. 本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表是一致的。

附注 3. 本报告期末发生重大会计差错的内容和更正金额。

附注 4. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

企业名称	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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东(注)
新时代证券有限责任公司	基金管理人股东(注)
联合证券有限责任公司	基金管理人原股东、基金代销机构(注)
陕西省国际信托投资股份有限公司	基金管理人原股东(注)
华林证券有限责任公司	基金管理人原股东(注)

(注)详见“九、重大事项揭示(二)本报告期基金管理人的股权变更事项”。

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

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 13 日(注)					
	买卖 股票成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 债券成交量	占本期该 类交易成 交量比例	交易佣金	占本期 佣金 总量比例
联合证券	2,582,696,375.23	49.73%	5,266,598.89	10.88%	2,020,975.88	49.77%

	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日					
	买卖 股票成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 债券成交量	占本期该 类交易成 交量比例	交易佣金	占本期 佣金 总量比例
联合证券	25,537,177.69	1.71%	0.00	0.00	19,983.24	1.71%

注：2007 年 4 月 13 日为基金管理人公告联合证券转让公司股权的相关变更登记手续已办理完毕的公告日。

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。

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。

本基金在本期间需支付基金管理人报酬 22,241,887.18 元(2006 年同期 :2,630,400.53 元)。

(4) 基金托管费

支付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。

本基金在本期间需支付基金托管费 4,448,377.46 元(2006 年同期 :526,080.15 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 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 519,571,835.96 元(2006 年 6 月 30 日：23,881,629.70 元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 774,153.04 元(2006 年同期：55,768.48 元)。

(6) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无(2006 年度同期：无)。

(7) 基金各关联方投资本基金的情况

A. 基金管理公司期末持有本基金份额的情况

无(2006 年 6 月 30 日：无)。

B. 基金管理公司的主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

无(2006 年 6 月 30 日：无)。

附注 5. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2007-6-30
应收银行存款利息	113,878.10
应收清算备付金利息	17,726.49
应收认申购款利息	25,782.52
应收债券利息	4,569,395.84
合计	4,726,782.95

(2) 投资估值增值

项目	2007-6-30
股票估值增值	660,186,516.68
债券估值增值	1,852,899.30
权证估值增值	39,649,131.43
合计	701,688,547.41

(3) 应付佣金

项目	2007-6-30
海通证券	1,804,000.34
中信万通证券	14,117.13
长城证券	1,328,872.81
长江证券	4,898,863.45
联合证券	2,863,550.40
合计	10,909,404.13

(4) 其他应付款

项目	2007-6-30
应付券商席位保证金	1,000,000.00
应付后端申购费	120,120.72
应付银行间交易手续费	597.75
合计	1,120,718.47

(5) 预提费用

项目	2007-6-30
信息披露费	49,588.57
审计费用	39,671.58
债券托管账户维护费	4,500.00
合计	93,760.15

(6) 实收基金

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
期初数	533,327,971.02
加：本期申购	12,353,865,039.99
减：本期赎回	4,419,439,715.55
期末数	8,467,753,295.46

(7) 未实现利得

	未实现估值增值	未实现利得平准金	合计
2006 年 12 月 31 日	165,019,697.71	-70,319,274.87	94,700,422.84
加：本期净变动数	536,668,849.70		536,668,849.70
加：本期申购基金份额		5,138,168,801.56	5,138,168,801.56
减：本期赎回基金份额		1,847,397,729.55	1,847,397,729.55
2007 年 6 月 30 日	701,688,547.41	3,220,451,797.14	3,922,140,344.55

(8) 股票差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出股票成交总额	3,880,265,304.52
减：应付佣金	3,157,463.61
减：卖出股票成本总额	2,974,666,626.24
股票差价收入	902,441,214.67

本基金于本报告期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部分共计12,150.78元(2006年同期：4,966,074.31)，已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出债券成交总额	5,266,335.56
减：应收利息总额	14,055.23
减：卖出债券成本总额	4,121,646.35
债券差价收入	1,130,633.98

(10) 权证差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出权证成交总额	1,772,741.53
减：卖出权证成本总额	581,553.65
权证差价收入	1,191,187.88

(11) 其他收入

截止 2007 年 6 月 30 日,其他收入余额 4,397,199.60 元均为基金赎回费按 25%的比例归入基金资产的部分。

(12) 其他费用

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
信息披露费	49,588.57
银行费用	1,333.22
审计费用	39,671.58
回购交易费	2,347.88
债券托管账户维护费	13,500.00
合计	106,441.25

(13) 收益分配情况

	每10份基金份额分红数(元)	收益分配总金额(元)
--	----------------	------------

第一次中期分红	0.31	195,602,075.70
第二次中期分红	0.12	151,724,937.76
第三次中期分红	0.08	134,600,585.34
第四次中期分红	0.10	316,120,344.97
合计	0.61	798,047,943.77

附注 6. 本报告期末流通转让受到限制的基金资产

无

附注 7. 其他变更事项

根据财政部、国家税务总局财税[2007]84 号《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，经国务院批准，财政部决定从 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由 1‰调整为 3‰。

（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

二〇〇七年六月三十日

单位：人民币元

	附 注	2007年6月30日	2006年12月31日
资产：			
银行存款		6,379,350.35	19,802,013.26
清算备付金		15,127,814.31	891,744.97
交易保证金	5（1）	5,343,772.50	1,098,780.49
应收证券清算款		28,428,539.74	12,013,083.68
应收股利		--	--
应收利息	5（2）	25,145,546.82	575,064.57
应收申购款		8,838,222.83	600,335.93
其他应收款		--	--
股票投资市值		4,420,437,546.81	320,574,470.99
其中：股票投资成本		3,464,694,817.18	247,914,209.38
债券投资市值		1,325,593,601.85	118,439,789.52
其中：债券投资成本		1,328,165,916.50	117,969,689.18
权证投资		52,061,850.00	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		5,887,356,245.21	478,188,579.41
负债：			
应付证券清算款		--	--
应付赎回款		59,912,930.46	1,983,765.04
应付赎回费		133,120.61	3,189.59
应付管理人报酬		8,082,507.44	628,542.36
应付托管费		1,347,084.56	104,757.07

应付佣金	5 (3)	6,943,080.88	461,409.14
应付利息		--	--
应付收益		--	--
其他应付款	5 (4)	1,068,663.59	1,003,985.48
预提费用	5 (5)	82,353.53	150,333.34
其他负债		--	--
负债合计		77,569,741.07	4,335,982.02
持有人权益：			
实收基金	5 (6)	4,476,772,562.33	282,241,429.58
未实现利得	5 (7)	-293,838,343.80	54,711,493.55
未分配收益		1,626,852,285.61	136,899,674.26
持有人权益合计		5,809,786,504.14	473,852,597.39
负债及持有人权益总计		5,887,356,245.21	478,188,579.41
基金份额净值		1.298	1.679

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
一、收入		1,271,647,452.62	219,553,549.08
股票差价收入	5(8)	1,180,315,676.97	201,213,302.88
债券差价收入	5(9)	-36,116,904.95	-503,613.24
权证差价收入	5(10)	81,827,511.86	11,128,596.86
债券利息收入		22,599,193.55	2,953,693.54
存款利息收入		4,295,177.70	266,565.25
股利收入		13,505,674.98	4,191,312.00
买入返售证券收入		516,834.38	--
其他收入	5(11)	4,704,288.13	303,691.79
二、费用		67,963,401.22	5,167,959.50
基金管理人报酬	4(3)	50,992,406.11	4,344,331.13
基金托管费	4(4)	8,498,734.34	724,055.12
卖出回购证券支出		8,336,945.97	18,500.00
其他费用	5(12)	135,314.80	81,073.25
其中：信息披露费		49,588.57	43,713.17
审计费用		28,264.96	27,273.08
银行费用		10,235.38	574.50
三、基金净收益		1,203,684,051.40	214,385,589.58
加：未实现利得		929,633,711.03	-1,099,201.83
四、基金经营业绩		2,133,317,762.43	213,286,387.75

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
本期基金净收益		1,203,684,051.40	214,385,589.58
加：期初基金净收益		136,899,674.26	-41,254,024.11
加：本期损益平准金		661,328,108.13	-3,927,891.96
可供分配基金净收益		2,001,911,833.79	169,203,673.51
减：本期已分配基金净收益	5(13)	375,059,548.18	68,386,283.55
期末基金净收益		1,626,852,285.61	100,817,389.96

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

自二〇〇七年一月一日至二〇〇七年六月三十日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月1日 至2007年6月30日	2006年1月1日 至2006年6月30日
一、期初基金净值		473,852,597.39	728,969,096.48
二、本期经营活动			
基金净收益		1,203,684,051.40	214,385,589.58
未实现利得		929,633,711.03	-1,099,201.83
经营活动产生的基金 净值变动数		2,133,317,762.43	213,286,387.75
三、本期基金单位交易			
基金申购款		10,734,759,067.60	166,778,329.30
基金赎回款		-7,157,083,375.10	-508,736,552.33
基金单位交易产生的 基金净值变动数		3,577,675,692.50	-341,958,223.03
四、本期向持有人分配收益		-375,059,548.18	-68,386,283.55
向基金持有人分配收益 产生的净值变动数		-375,059,548.18	-68,386,283.55
五、期末基金净值		5,809,786,504.14	531,910,977.65

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折份额部分共募集 2,116,929,381.80 份基金份额，其中包括本基金 765,997,626.40 份基金份额、融通债券投资基金 873,320,777.53 份基金份额和融通深证 100 指数证券投资基金 477,610,977.87 份基金份额，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。本基金募集期认购资金利息折份额部分为 75,387.74 份基金份额，基金成立日本基金份额总额为 766,073,014.14 份。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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《融通通利系列证券投资基金基金合同》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。

附注 2. 本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表是一致的。

附注 3. 本报告期末发生重大会计差错的内容和更正金额。

附注 4. 关联方关系及关联方交易

(1) 关联方关系

企业名称	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
日兴资产管理有限公司	基金管理人股东(注)
新时代证券有限责任公司	基金管理人股东(注)
联合证券有限责任公司	基金管理人原股东、基金代销机构(注)
陕西省国际信托投资股份有限公司	基金管理人原股东(注)
华林证券有限责任公司	基金管理人原股东(注)

(注)详见“九、重大事项揭示(二)本报告期基金管理人的股权变更事项”。

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

A、联合证券：

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 13 日(注)							
买卖 股票成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 债券成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 权证成交量	占本期该 类交易成 交量比例	交易佣金	占本期 佣金 总量比例
424,858,784.36	4.40%	7,160,967.62	1.24%	6,815,343.71	14.99%	332,096.47	4.29%

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日							
买卖 股票成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 债券成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 权证成交量	占本期该 类交易成 交量比例	交易佣金	占本期 佣金 总量比例
278,778,858.69	21.10%	--	--	--	--	218,146.41	20.48%

B、华林证券：

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 20 日(注)						
买卖 股票成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 权证成交量	占本期该 类交易成 交量比例	交易佣金	占本期 佣金 总量比例	
2,084,563,737.58	12.47%	49,338,652.60	50.09%	1,631,183.92	12.17%	

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日						
买卖 股票成交量	占本期该 类交易成 交量比例	买卖 权证成交量	占本期该 类交易成 交量比例	交易佣金	占本期 佣金 总量比例	
49,767,633.77	3.77%	--	--	38,943.58	3.66%	

注：2007 年 4 月 13 日为基金管理人公告联合证券转让公司股权的相关变更登记手续已

办理完毕的公告日。2007 年 6 月 20 日为基金管理人公告华林证券转让公司股权的相关变更登记手续已办理完毕的公告日。

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。

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。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬 50,992,406.11 元(2006 年同期：4,344,331.13 元)。

(4) 基金托管费

支付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。

本基金在本报告期需支付基金托管费 8,498,734.34 元(2006 年同期：724,055.12 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 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 6,379,350.35 元(2006 年 6 月 30 日：66,925,846.86 元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 4,058,598.50 元(2006 年同期：254,838.59 元)。

(6) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期与基金托管人中国工商银行进行的银行间同业市场交易明细如下：

交易日期	交易类型	成交金额(元)
2007-6-28	买入银行间债券	61,631,367.12

2006 年度同期未与关联方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. 基金管理公司期末持有本基金份额的情况

无(2006 年 6 月 30 日：无)。

B. 基金管理公司的主要股东及其控制的机构在期末持有本基金份额的情况

无(2006 年 6 月 30 日：无)。

附注 5. 基金会计报表重要项目说明

(1) 交易保证金

项目	2007-6-30
深圳结算保证金	5,244,992.01
权证交易保证金	98,780.49
合计	5,343,772.50

(2) 应收利息

项目	2007-6-30
应收债券利息	25,099,068.22
应收银行存款利息	39,814.11
应收清算备付金利息	6,126.75
应收保证金利息	40.05
应收认申购款利息	497.69
合计	25,145,546.82

(3) 应付佣金

项目	2007-6-30
中信建投证券有限责任公司	571,136.92
东方证券股份有限公司	1,274,498.98
金元证券有限责任公司	930,829.76
齐鲁证券有限公司	1,068,491.85
招商证券股份有限公司	1,405,271.00
华林证券有限责任公司	1,007,501.31
海通证券股份有限公司	685,351.06
合计	6,943,080.88

(4) 其他应付款

项目	2007-6-30
应付券商席位保证金	1,000,000.00
应付后端申购费	61,670.14
债券交易费	2,525.00
回购交易费	4,468.45
合计	1,068,663.59

(5) 预提费用

项目	2007-6-30
审计费用	28,264.96
信息披露费	49,588.57
账户维护费	4,500.00
合计	82,353.53

(6) 实收基金

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
期初数	282,241,429.58
加：本期申购	10,352,001,356.82
其中：红利再投资	231,699,229.91
减：本期赎回	6,157,470,224.07
期末数	4,476,772,562.33

(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
2006 年 12 月 31 日	75,598,553.95	-20,887,060.40	54,711,493.55
加：本年净变动数	929,633,711.03	--	929,633,711.03
加：本年申购基金份额	--	-1,655,869,767.93	-1,655,869,767.93
其中：红利再投资	--	-38,790,511.11	-38,790,511.11
减：本年赎回基金份额	--	-377,686,219.55	-377,686,219.55
2007 年 6 月 30 日	1,005,232,264.98	-1,299,070,608.78	-293,838,343.80

(a) 未实现估值增值按投资类别分项列示如下：

项目	2007-6-30
股票估值增值	955,742,729.63
债券估值增值	-2,572,314.65
权证估值增值	52,061,850.00
合计	1,005,232,264.98

(8) 股票差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出股票成交总额	7,511,000,130.07
减：卖出股票成本总额	6,324,389,868.91
减：应付佣金	6,294,584.19
股票差价收入	1,180,315,676.97

本基金于本报告期获得股权分置改革中由非流通股股东支付给流通股东的现金对价部分共计 11,051.00 元(2006 年度同期：2,056,936.94)，已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出及到期兑付债券结算总额	2,340,332,366.41
减：卖出及到期兑付债券成本总额	2,344,079,786.25
减：应收利息总额	32,369,485.11
债券差价收入	-36,116,904.95

(10) 权证差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出权证成交总额	120,333,062.85
减：卖出权证成本总额	38,505,550.99
减：应付佣金	--
权证差价收入	81,827,511.86

(11) 其他收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
赎回基金补偿收入(注)	4,689,288.13
新股申购手续费返还	--
印花税返还	--
其他	15,000.00
合计	4,704,288.13

(注)基金的赎回费总额的 25%归入基金资产，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	2007-1-1 至 2007-6-30
信息披露费	49,588.57
审计费用	28,264.96
债券账户维护费	13,500.00
回购交易费	21,525.89
银行费用	10,235.38
银行间债券交易费	9,000.00
其他	3,200.00
合计	135,314.80

(13) 收益分配情况

	每10份基金份额分红数(元)	收益分配总金额(元)
第一次中期分红	8.70	375,059,548.18
合计	8.70	375,059,548.18

附注 6. 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)	期末成本总额	期末估值总额
601919	中国远洋	07/06/20	07/09/26	8.48	18.26	434,420	3,683,881.60	7,932,509.20
合 计							3,683,881.60	7,932,509.20

附注 7. 其他变更事项

根据财政部、国家税务总局财税[2007]84 号《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》，经国务院批准，财政部决定从 2007 年 5 月 30 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由 1‰调整为 3‰。

六、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	15,568,392.13	4.86%
债券投资市值	244,196,905.49	76.27%
资产支持证券市值	19,980,999.35	6.24%
其他资产	40,442,475.15	12.63%
资产合计	320,188,772.12	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	68,904,660.60	23.26%
可转债	12,722,601.20	4.29%
企业债	152,549,893.69	51.49%
金融债	10,019,750.00	3.38%
合计	244,196,905.49	82.42%

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	6.74%

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
21 国债	43,858,029.60	14.80%
钢钒债 1	41,966,104.50	14.16%
06 中化债	35,360,268.00	11.93%
06 首都机场债	29,891,486.19	10.09%
06 马钢债	26,776,998.00	9.04%

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	6.74%

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	109,733.30
应收利息	2,847,429.58
应收申购款	37,485,312.27
合计	40,442,475.15

(3) 报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券；

(4) 报告期内本基金权证投资情况

权证名称	本期买入 数量(份)	买入成本 总额(元)	类别(被动持有 /主动投资)	本期卖出 数量(份)	卖出收入(元)
武钢 CWB1	515,846	0.00	被动持有	515,846	1,514,796.81

(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	563,341,109.45	4.22%
股票投资市值	12,209,987,184.20	91.47%
债券投资市值	281,329,115.78	2.11%
权证投资市值	39,649,131.43	0.30%
其他资产	253,670,629.43	1.90%
资产合计	13,347,977,170.29	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	24,803,064.00	0.19%
B 采掘业	359,657,643.06	2.76%
C 制造业	6,549,165,570.63	50.19%
C0 食品、饮料	1,084,378,632.23	8.31%
C1 纺织、服装、皮毛	125,601,543.80	0.96%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	78,616,162.80	0.60%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	566,919,275.23	4.34%
C5 电子	143,430,770.06	1.10%
C6 金属、非金属	2,417,939,393.02	18.53%
C7 机械、设备、仪表	1,516,159,661.38	11.62%
C8 医药、生物制品	581,317,831.92	4.46%
C99 其他制造业	34,802,300.19	0.27%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	423,300,079.14	3.24%
E 建筑业	204,628,955.30	1.57%

F 交通运输、仓储业	691,911,259.93	5.30%
G 信息技术业	523,180,544.53	4.01%
H 批发和零售贸易	404,161,039.96	3.10%
I 金融、保险业	705,796,186.14	5.41%
J 房地产业	1,795,690,013.28	13.76%
K 社会服务业	255,852,411.05	1.96%
L 传播与文化产业	47,865,262.50	0.37%
M 综合类	223,975,154.68	1.72%
合计	12,209,987,184.20	93.58%

(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)	占基金资产净值比例
1	000002	万科A	58,215,903	1,113,088,065.36	8.53%
2	000858	五粮液	18,602,556	585,236,411.76	4.49%
3	000001	深发展A	19,650,637	540,785,530.24	4.14%
4	000652	泰达股份	13,516,651	382,250,890.28	2.93%
5	002024	苏宁电器	7,883,806	370,223,529.76	2.84%
6	000063	中兴通讯	5,927,368	322,448,819.20	2.47%
7	000527	美的电器	10,548,158	320,664,003.20	2.46%
8	000039	中集集团	9,264,681	271,640,446.92	2.08%
9	000402	金融街	9,140,088	265,062,552.00	2.03%
10	000623	吉林敖东	5,115,360	254,489,160.00	1.95%
11	000825	太钢不锈	12,073,225	242,188,893.50	1.86%
12	000069	华侨城A	5,979,120	237,968,976.00	1.82%
13	000024	招商地产	4,636,977	227,675,570.70	1.74%
14	000898	鞍钢股份	12,006,404	212,393,286.76	1.63%
15	000651	格力电器	5,981,745	208,762,900.50	1.60%
16	000758	中色股份	8,088,101	204,628,955.30	1.57%
17	000792	盐湖钾肥	4,384,142	194,568,221.96	1.49%
18	000568	泸州老窖	4,522,605	190,401,670.50	1.46%
19	000983	西山煤电	6,712,882	189,504,658.86	1.45%
20	000562	宏源证券	5,631,763	165,010,655.90	1.26%
21	000629	攀钢钢钒	19,847,048	164,135,086.96	1.26%
22	000027	深能源A	7,200,528	163,595,996.16	1.25%
23	000751	锌业股份	8,144,837	160,534,737.27	1.23%
24	000709	唐钢股份	12,385,061	158,281,079.58	1.21%
25	000157	中联重科	3,946,273	151,931,510.50	1.16%
26	000060	中金岭南	5,137,847	150,538,917.10	1.15%
27	000878	云南铜业	4,320,563	149,059,423.50	1.14%
28	000630	铜都铜业	6,851,079	130,239,011.79	1.00%

29	000423	东阿阿胶	4,888,696	127,692,739.52	0.98%
30	000031	中粮地产	5,588,606	126,414,267.72	0.97%
31	000932	华菱管线	13,537,121	115,471,642.13	0.89%
32	000839	中信国安	3,966,462	111,060,936.00	0.85%
33	000960	锡业股份	3,356,472	109,118,904.72	0.84%
34	000680	山推股份	6,675,628	105,341,409.84	0.81%
35	000933	神火股份	3,697,360	103,932,789.60	0.80%
36	000778	新兴铸管	7,573,983	103,687,827.27	0.79%
37	000793	华闻传媒	12,187,257	102,129,213.66	0.78%
38	000895	双汇发展	1,684,619	97,539,440.10	0.75%
39	000539	粤电力 A	9,022,719	97,445,365.20	0.75%
40	000807	云铝股份	5,791,893	92,728,206.93	0.71%
41	000538	云南白药	2,571,894	92,073,805.20	0.71%
42	000625	长安汽车	5,506,641	90,749,443.68	0.70%
43	000800	一汽轿车	8,295,586	90,421,887.40	0.69%
44	000410	沈阳机床	3,543,212	85,037,088.00	0.65%
45	000401	冀东水泥	6,064,559	83,448,331.84	0.64%
46	000088	盐田港	4,881,790	81,965,254.10	0.63%
47	000959	首钢股份	13,205,560	81,478,305.20	0.62%
48	000422	湖北宜化	5,727,696	79,385,866.56	0.61%
49	000488	晨鸣纸业	9,015,615	78,616,162.80	0.60%
50	000009	S 深宝安 A	6,713,727	77,879,233.20	0.60%
51	000089	深圳机场	7,730,501	77,227,704.99	0.59%
52	000768	西飞国际	2,493,492	76,974,098.04	0.59%
53	000729	燕京啤酒	5,795,689	76,792,879.25	0.59%
54	000528	柳工	3,077,291	75,393,629.50	0.58%
55	000581	威孚高科	4,035,958	72,162,929.04	0.55%
56	000937	金牛能源	4,149,135	66,220,194.60	0.51%
57	000717	韶钢松山	9,375,001	66,093,757.05	0.51%
58	000822	山东海化	5,452,409	64,283,902.11	0.49%
59	000006	深振业 A	2,548,175	63,449,557.50	0.49%
60	000036	华联控股	9,294,294	63,201,199.20	0.48%
61	000541	佛山照明	2,933,468	63,069,562.00	0.48%
62	000726	鲁泰 A	3,828,242	62,400,344.60	0.48%
63	002007	华兰生物	1,487,507	61,880,291.20	0.47%
64	000021	长城开发	4,250,979	61,511,666.13	0.47%
65	000012	南玻 A	4,545,363	59,953,337.97	0.46%
66	000930	丰原生化	9,336,046	59,844,054.86	0.46%
67	000869	张裕 A	962,587	59,179,848.76	0.45%
68	000520	长航凤凰	5,852,913	55,017,382.20	0.42%
69	000659	珠海中富	5,415,865	54,862,712.45	0.42%

70	000900	现代投资	3,141,264	53,307,250.08	0.41%
71	002008	大族激光	2,281,156	51,896,299.00	0.40%
72	000636	风华高科	5,987,493	50,175,191.34	0.38%
73	000767	漳泽电力	4,643,332	48,058,486.20	0.37%
74	000917	电广传媒	3,223,250	47,865,262.50	0.37%
75	000912	泸天化	3,153,596	46,673,220.80	0.36%
76	002022	科华生物	1,792,930	45,181,836.00	0.35%
77	000400	许继电气	3,341,753	44,846,325.26	0.34%
78	000503	海虹控股	3,670,009	43,966,707.82	0.34%
79	000875	吉电股份	6,197,451	39,973,558.95	0.31%
80	000970	中科三环	3,372,780	39,765,076.20	0.30%
81	000550	江铃汽车	2,372,997	38,869,690.86	0.30%
82	000601	韶能股份	6,657,173	38,545,031.67	0.30%
83	000707	双环科技	4,557,558	38,329,062.78	0.29%
84	000429	粤高速 A	4,844,571	37,400,088.12	0.29%
85	000939	凯迪电力	2,084,208	35,681,640.96	0.27%
86	000969	安泰科技	2,171,073	34,802,300.19	0.27%
87	002028	思源电气	541,690	34,061,467.20	0.26%
88	000061	农产品	1,549,658	33,937,510.20	0.26%
89	000619	海螺型材	2,842,633	33,798,906.37	0.26%
90	000927	一汽夏利	3,906,061	32,654,669.96	0.25%
91	000022	深赤湾 A	1,144,580	30,274,141.00	0.23%
92	000916	华北高速	4,695,212	29,485,931.36	0.23%
93	000066	长城电脑	2,788,032	28,159,123.20	0.22%
94	000962	东方钽业	2,259,611	27,183,120.33	0.21%
95	002048	宁波华翔	1,641,865	25,219,046.40	0.19%
96	002069	獐子岛	326,700	24,803,064.00	0.19%
97	002025	航天电器	794,538	21,126,765.42	0.16%
98	002056	横店东磁	700,087	20,232,514.30	0.16%
99	002051	中工国际	702,689	17,883,435.05	0.14%
100	000911	南宁糖业	1,465,174	15,384,327.00	0.12%

(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比例
1	000002	万科 A	981,081,797.49	137.51%
2	000623	吉林敖东	742,714,374.15	104.10%
3	000858	五粮液	663,263,082.68	92.96%
4	002024	苏宁电器	569,814,265.01	79.87%
5	000562	宏源证券	563,748,984.19	79.02%
6	000001	深发展 A	559,400,356.71	78.41%

7	000652	泰达股份	335,686,135.26	47.05%
8	000039	中集集团	324,019,837.84	45.41%
9	000825	太钢不锈	319,887,029.08	44.84%
10	000063	中兴通讯	298,645,236.96	41.86%
11	000758	中色股份	296,192,202.95	41.51%
12	000709	唐钢股份	291,322,357.52	40.83%
13	000527	美的电器	242,836,660.42	34.04%
14	000069	华侨城 A	238,141,286.33	33.38%
15	000568	泸州老窖	218,464,523.35	30.62%
16	000402	金融街	204,569,546.32	28.67%
17	000898	鞍钢股份	204,209,826.53	28.62%
18	000024	招商地产	198,814,110.52	27.87%
19	000060	中金岭南	198,416,503.14	27.81%
20	000031	中粮地产	196,553,453.67	27.55%
21	000878	云南铜业	196,438,659.52	27.53%
22	000629	攀钢钢钒	181,440,300.98	25.43%
23	000793	华闻传媒	165,456,560.99	23.19%
24	000751	锌业股份	163,372,703.60	22.90%
25	000651	格力电器	159,549,688.10	22.36%
26	000778	新兴铸管	154,753,566.60	21.69%
27	000932	华菱管线	153,767,490.79	21.55%
28	000792	盐湖钾肥	153,087,865.87	21.46%
29	000983	西山煤电	143,917,500.37	20.17%
30	000157	中联重科	142,519,594.03	19.98%
31	000027	深能源 A	141,498,760.27	19.83%
32	000933	神火股份	139,291,138.21	19.52%
33	000401	冀东水泥	130,275,927.39	18.26%
34	000422	湖北宜化	127,442,179.27	17.86%
35	000539	粤电力 A	122,264,435.29	17.14%
36	000423	东阿阿胶	119,414,595.78	16.74%
37	000960	锡业股份	119,151,795.97	16.70%
38	000630	铜都铜业	116,555,368.55	16.34%
39	000410	沈阳机床	113,870,428.28	15.96%
40	000839	中信国安	112,393,447.52	15.75%
41	000036	华联控股	111,783,462.24	15.67%
42	000959	首钢股份	108,178,776.15	15.16%
43	000800	一汽轿车	97,281,532.46	13.64%
44	000807	云铝股份	95,171,869.02	13.34%
45	000538	云南白药	94,593,584.20	13.26%
46	000625	长安汽车	93,388,876.70	13.09%

47	000088	盐 田 港	91,414,683.72	12.81%
48	000089	深圳机场	89,255,055.95	12.51%
49	000488	晨鸣纸业	89,251,818.14	12.51%
50	000930	丰原生化	88,992,104.89	12.47%
51	000717	韶钢松山	85,413,777.13	11.97%
52	000680	山推股份	80,239,687.38	11.25%
53	000822	山东海化	79,673,153.95	11.17%
54	000768	西飞国际	78,502,572.09	11.00%
55	000729	燕京啤酒	76,896,897.71	10.78%
56	000012	南 玻 A	75,368,778.38	10.56%
57	000528	柳 工	70,862,957.64	9.93%
58	000400	许继电气	69,897,831.04	9.80%
59	000970	中科三环	69,110,795.94	9.69%
60	000659	珠海中富	67,825,651.32	9.51%
61	000009	S 深宝安 A	65,903,129.08	9.24%
62	000869	张 裕 A	64,575,294.14	9.05%
63	000917	电广传媒	64,064,669.20	8.98%
64	000021	长城开发	63,743,801.93	8.93%
65	000726	鲁 泰 A	63,174,310.97	8.85%
66	000895	双汇发展	59,780,226.44	8.38%
67	000581	威孚高科	57,994,307.64	8.13%
68	000939	凯迪电力	57,731,774.22	8.09%
69	000636	风华高科	57,244,751.35	8.02%
70	000503	海虹控股	57,215,825.73	8.02%
71	000900	现代投资	54,572,746.14	7.65%
72	000937	金牛能源	54,042,033.24	7.57%
73	000006	深振业 A	53,992,689.25	7.57%
74	002007	华兰生物	50,288,454.35	7.05%
75	000541	佛山照明	49,573,573.91	6.95%
76	000875	吉电股份	48,103,367.61	6.74%
77	002008	大族激光	46,998,855.34	6.59%
78	000520	长航凤凰	46,179,369.94	6.47%
79	000767	漳泽电力	45,605,084.12	6.39%
80	000927	一汽夏利	44,861,255.29	6.29%
81	000912	泸 天 化	44,550,192.72	6.24%
82	000601	韶能股份	44,101,179.72	6.18%
83	000429	粤高速 A	40,586,446.28	5.69%
84	000061	农 产 品	37,410,962.51	5.24%
85	000619	海螺型材	35,590,865.01	4.99%
86	000969	安泰科技	34,974,478.05	4.90%

87	000707	双环科技	34,542,990.95	4.84%
88	000550	江铃汽车	34,133,889.73	4.78%
89	002022	科华生物	32,760,957.70	4.59%
90	000916	华北高速	31,805,227.54	4.46%
91	002028	思源电气	31,135,687.88	4.36%
92	000962	东方钨业	31,042,855.19	4.35%
93	000066	长城电脑	28,355,391.69	3.97%
94	002069	獐子岛	26,193,032.18	3.67%
95	000022	深赤湾A	26,114,739.18	3.66%
96	002025	航天电器	25,080,555.43	3.52%
97	002048	宁波华翔	24,994,342.25	3.50%
98	002051	中工国际	21,112,342.43	2.96%
99	002056	横店东磁	20,248,458.42	2.84%
100	000911	南宁糖业	18,017,030.62	2.53%

(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比例
1	000623	吉林敖东	516,814,529.43	72.44%
2	000562	宏源证券	452,469,209.82	63.42%
3	002024	苏宁电器	244,167,474.88	34.22%
4	000858	五粮液	230,770,971.60	32.35%
5	000002	万科A	201,427,680.00	28.23%
6	000709	唐钢股份	173,925,276.29	24.38%
7	000039	中集集团	120,721,825.28	16.92%
8	000878	云南铜业	116,510,491.96	16.33%
9	000001	深发展A	114,834,395.38	16.10%
10	000825	太钢不锈	113,685,921.43	15.93%
11	000031	中粮地产	83,977,580.62	11.77%
12	000060	中金岭南	72,301,236.57	10.13%
13	000778	新兴铸管	68,585,737.36	9.61%
14	000069	华侨城A	64,829,997.54	9.09%
15	000933	神火股份	63,230,838.21	8.86%
16	000401	冀东水泥	55,724,192.47	7.81%
17	000422	湖北宜化	54,170,466.08	7.59%
18	000157	中联重科	44,519,623.09	6.24%
19	000527	美的电器	44,518,287.48	6.24%
20	000410	沈阳机床	43,722,047.69	6.13%
21	000629	攀钢钢钒	43,528,500.66	6.10%
22	000036	华联控股	38,338,151.54	5.37%
23	000758	中色股份	37,250,815.60	5.22%
24	000568	泸州老窖	36,982,693.22	5.18%

25	000027	深能源 A	36,035,765.95	5.05%
26	000932	华菱管线	35,933,989.99	5.04%
27	000768	西飞国际	33,920,705.49	4.75%
28	000960	锡业股份	32,977,439.28	4.62%
29	000063	中兴通讯	30,094,957.13	4.22%
30	000970	中科三环	29,503,243.57	4.14%
31	000400	许继电气	26,197,219.39	3.67%
32	000983	西山煤电	26,125,268.82	3.66%
33	000939	凯迪电力	25,849,642.98	3.62%
34	000539	粤电力 A	23,503,559.99	3.29%
35	000898	鞍钢股份	23,324,228.38	3.27%
36	000800	一汽轿车	23,150,814.38	3.24%
37	000402	金融街	23,047,130.54	3.23%
38	000659	珠海中富	20,366,608.76	2.85%
39	000717	韶钢松山	20,164,060.15	2.83%
40	000630	铜都铜业	20,049,208.00	2.81%
41	000088	盐田港	19,387,675.12	2.72%
42	000651	格力电器	18,513,320.78	2.59%
43	000024	招商地产	17,939,137.19	2.51%
44	000807	云铝股份	17,637,719.39	2.47%
45	000625	长安汽车	17,503,250.58	2.45%
46	000822	山东海化	16,795,622.47	2.35%
47	000016	深康佳 A	16,603,847.83	2.33%
48	000733	振华科技	15,905,792.55	2.23%
49	000726	鲁泰 A	15,881,072.88	2.23%
50	000839	中信国安	15,816,852.29	2.22%
51	000538	云南白药	15,067,054.35	2.11%
52	000959	首钢股份	14,552,728.73	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	14,003,803,922.97
卖出股票的收入总额	3,880,265,304.52

5、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	128,241,805.00	0.98%
可转债	6,174,339.27	0.05%
央行票据	146,912,971.51	1.13%
合计	281,329,115.78	2.16%

6、报告期末前五名债券投资明细

债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
02 国债	128,241,805.00	0.98%

07 央行票据 49	49,670,098.90	0.38%
06 央行票据 78	48,625,838.36	0.37%
06 央行票据 64	48,617,034.25	0.37%
锡业转债	6,174,339.27	0.05%

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	6,762,091.91
应收利息	4,726,782.95
应收申购款	242,181,754.57
合计	253,670,629.43

(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

权证名称	本期买入 数量(份)	买入成本 总额(元)	类别(被动持有 /主动投资)	本期卖出 数量(份)	卖出收入(元)
钢钒 GFC1	0	0.00	被动持有	738,950	1,191,187.88
深发 SFC1	1,684,795	0.00	被动持有	0	0.00
深发 SFC2	842,398	0.00	被动持有	0	0.00

(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	21,507,164.66	0.37%
股票投资市值	4,420,437,546.81	75.08%
债券投资市值	1,325,593,601.85	22.52%
权证投资市值	52,061,850.00	0.88%
其他资产	67,756,081.89	1.15%
资产合计	5,887,356,245.21	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	0.00	0.00%
B 采掘业	217,689,452.49	3.75%
C 制造业	1,332,837,587.43	22.95%
C0 食品、饮料	389,615,691.36	6.71%
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	172,924,000.00	2.98%
C5 电子	--	--

C6 金属、非金属	385,198,354.16	6.63%
C7 机械、设备、仪表	178,507,215.66	3.07%
C8 医药、生物制品	206,592,326.25	3.56%
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	352,649,155.80	6.07%
G 信息技术业	--	--
H 批发和零售贸易	720,060,818.96	12.39%
I 金融、保险业	1,096,786,832.13	18.88%
J 房地产业	648,673,700.00	11.17%
K 社会服务业	51,740,000.00	0.89%
L 传播与文化产业	--	--
M 综合类	--	--
合计	4,420,437,546.81	76.09%

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)	占基金资产净值比例
1	600030	中信证券	8,000,000	423,760,000.00	7.29%
2	600036	招商银行	13,000,000	319,540,000.00	5.50%
3	000002	万 科 A	16,000,000	305,920,000.00	5.27%
4	000001	深发展 A	11,000,000	302,720,000.00	5.21%
5	000402	金 融 街	9,289,300	269,389,700.00	4.64%
6	600029	南方航空	29,900,000	256,542,000.00	4.42%
7	600859	王府井	4,182,784	205,583,833.60	3.54%
8	002024	苏宁电器	4,324,200	203,064,432.00	3.50%
9	000858	五 粮 液	5,400,000	169,884,000.00	2.92%
10	000825	太钢不锈	7,993,974	160,359,118.44	2.76%
11	000061	农 产 品	7,000,000	153,300,000.00	2.64%
12	600519	贵州茅台	1,273,721	152,438,929.28	2.62%
13	000623	吉林敖东	3,000,000	149,250,000.00	2.57%
14	600690	青岛海尔	8,760,000	140,160,000.00	2.41%
15	000960	锡业股份	4,000,472	130,055,344.72	2.24%
16	600309	烟台万华	2,400,000	128,544,000.00	2.21%
17	600739	辽宁成大	3,577,144	122,302,553.36	2.11%
18	000933	神火股份	2,814,509	79,115,847.99	1.36%
19	601111	中国国航	6,984,540	68,378,646.60	1.18%
20	600887	伊利股份	2,159,588	67,292,762.08	1.16%
21	000878	云南铜业	1,949,678	67,263,891.00	1.16%
22	600028	中国石化	4,597,200	60,774,984.00	1.05%
23	600547	山东黄金	716,450	52,508,620.50	0.90%
24	000069	华侨城 A	1,300,000	51,740,000.00	0.89%

25	000024	招商地产	1,000,000	49,100,000.00	0.85%
26	000792	盐湖钾肥	1,000,000	44,380,000.00	0.76%
27	600169	太原重工	1,677,481	38,347,215.66	0.66%
28	601166	兴业银行	999,975	35,089,122.75	0.60%
29	600161	天坛生物	893,875	28,702,326.25	0.49%
30	000538	云南白药	800,000	28,640,000.00	0.49%
31	000401	冀东水泥	2,000,000	27,520,000.00	0.47%
32	600825	新华传媒	750,000	25,800,000.00	0.44%
33	601001	大同煤业	1,000,000	25,290,000.00	0.44%
34	600325	华发股份	800,000	24,264,000.00	0.42%
35	000652	泰达股份	700,000	19,796,000.00	0.34%
36	601318	中国平安	219,238	15,677,709.38	0.27%
37	000560	昆百大 A	1,000,000	10,010,000.00	0.17%
38	601919	中国远洋	434,420	7,932,509.20	0.14%

4、本报告期末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比例
1	600030	中信证券	472,185,594.61	99.65%
2	600036	招商银行	459,206,619.51	96.91%
3	000002	万科 A	456,662,120.48	96.37%
4	601988	中国银行	414,376,529.26	87.45%
5	600028	中国石化	390,760,213.03	82.46%
6	600005	武钢股份	387,654,235.11	81.81%
7	600050	中国联通	348,930,163.40	73.64%
8	000001	深发展 A	337,747,835.56	71.28%
9	600016	民生银行	290,809,188.05	61.37%
10	000825	太钢不锈	269,034,583.08	56.78%
11	002024	苏宁电器	264,628,277.18	55.85%
12	600900	长江电力	229,080,978.59	48.34%
13	000402	金融街	227,222,815.23	47.95%
14	600309	烟台万华	208,857,544.22	44.08%
15	000562	宏源证券	187,601,601.95	39.59%
16	600690	青岛海尔	185,709,179.51	39.19%
17	600000	浦发银行	183,895,455.81	38.81%
18	000061	农产品	179,516,497.26	37.88%
19	600739	辽宁成大	172,270,345.28	36.36%
20	600029	南方航空	170,169,839.92	35.91%
21	601006	大秦铁路	162,973,830.21	34.39%
22	000063	中兴通讯	146,887,372.75	31.00%
23	601318	中国平安	142,015,277.33	29.97%
24	600519	贵州茅台	139,014,836.75	29.34%

25	000951	中国重汽	138,990,852.29	29.33%
26	600859	王府井	134,856,507.55	28.46%
27	000960	锡业股份	132,375,864.05	27.94%
28	000858	五 粮 液	131,836,874.83	27.82%
29	600019	宝钢股份	127,863,145.20	26.98%
30	600887	伊利股份	125,986,582.31	26.59%
31	000039	中集集团	123,200,848.81	26.00%
32	000623	吉林敖东	118,388,818.87	24.98%
33	000088	盐 田 港	116,400,094.01	24.56%
34	601166	兴业银行	113,039,304.78	23.86%
35	601111	中国国航	105,966,194.97	22.36%
36	601628	中国人寿	97,725,418.52	20.62%
37	000401	冀东水泥	87,889,552.64	18.55%
38	600195	中牧股份	79,835,887.74	16.85%
39	000024	招商地产	76,145,820.23	16.07%
40	000898	鞍钢股份	75,869,860.78	16.01%
41	000792	盐湖钾肥	74,117,470.50	15.64%
42	600675	中华企业	61,737,780.22	13.03%
43	600616	第一食品	61,124,110.88	12.90%
44	000059	辽通化工	60,916,227.16	12.86%
45	000933	神火股份	58,605,590.37	12.37%
46	600198	*ST 大唐	55,935,015.57	11.80%
47	600470	六国化工	54,938,303.96	11.59%
48	600547	山东黄金	49,829,126.59	10.52%
49	000878	云南铜业	48,615,267.49	10.26%
50	000759	武汉中百	48,112,297.93	10.15%
51	000069	华侨城 A	42,874,013.84	9.05%
52	600169	太原重工	39,282,137.54	8.29%
53	600809	山西汾酒	36,947,010.29	7.80%
54	000538	云南白药	34,455,314.02	7.27%
55	600161	天坛生物	31,172,633.86	6.58%
56	600052	*ST 广厦	30,489,446.01	6.43%
57	600825	新华传媒	29,959,676.77	6.32%
58	600639	浦东金桥	29,370,761.28	6.20%
59	600787	中储股份	29,219,586.74	6.17%
60	601001	大同煤业	29,044,325.81	6.13%
61	000751	锌业股份	29,023,485.00	6.13%
62	600015	华夏银行	28,990,918.67	6.12%
63	600325	华发股份	28,863,393.92	6.09%
64	000839	中信国安	26,014,457.13	5.49%

65	000661	长春高新	24,690,824.37	5.21%
66	000560	昆百大 A	22,105,979.87	4.67%
67	600383	金地集团	22,042,601.48	4.65%
68	600583	海油工程	22,006,445.70	4.64%
69	600031	三一重工	19,927,494.14	4.21%
70	000652	泰达股份	18,441,670.73	3.89%
71	000565	渝三峡 A	17,936,752.34	3.79%
72	600655	豫园商城	16,274,249.82	3.43%
73	000568	泸州老窖	14,110,087.84	2.98%
74	600858	银座股份	13,587,360.08	2.87%
75	002007	华兰生物	12,210,534.52	2.58%
76	600058	五矿发展	12,026,134.62	2.54%
77	000410	沈阳机床	11,780,351.13	2.49%
78	600525	长园新材	10,757,390.73	2.27%
79	000022	深赤湾 A	10,253,166.81	2.16%

(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比例
1	601988	中国银行	442,940,703.16	93.48%
2	600005	武钢股份	429,598,169.57	90.66%
3	600050	中国联通	389,618,507.60	82.22%
4	600016	民生银行	318,637,384.80	67.24%
5	000562	宏源证券	303,390,610.44	64.03%
6	600028	中国石化	301,738,281.29	63.68%
7	000002	万科 A	293,205,047.24	61.88%
8	600900	长江电力	289,823,630.16	61.16%
9	600036	招商银行	256,290,254.21	54.09%
10	600030	中信证券	233,349,599.21	49.25%
11	000825	太钢不锈	198,685,022.57	41.93%
12	600000	浦发银行	196,719,470.97	41.51%
13	000951	中国重汽	188,573,552.36	39.80%
14	600019	宝钢股份	182,960,873.30	38.61%
15	601006	大秦铁路	180,994,486.53	38.20%
16	601318	中国平安	177,723,293.29	37.51%
17	000001	深发展 A	155,989,680.68	32.92%
18	600309	烟台万华	154,274,018.71	32.56%
19	002024	苏宁电器	153,796,716.01	32.46%
20	000063	中兴通讯	143,550,270.77	30.29%
21	000401	冀东水泥	138,257,516.83	29.18%
22	000039	中集集团	137,192,526.51	28.95%
23	000898	鞍钢股份	136,190,273.40	28.74%

24	000088	盐 田 港	115,157,826.92	24.30%
25	600690	青岛海尔	108,525,279.13	22.90%
26	600675	中华企业	107,703,876.05	22.73%
27	000059	辽通化工	98,149,361.74	20.71%
28	600195	中牧股份	96,964,400.02	20.46%
29	601166	兴业银行	88,647,865.17	18.71%
30	601628	中国人寿	76,675,654.01	16.18%
31	600616	第一食品	75,332,806.48	15.90%
32	600058	五矿发展	69,633,914.52	14.70%
33	601111	中国国航	63,460,605.58	13.39%
34	000024	招商地产	61,553,185.65	12.99%
35	600022	济南钢铁	59,764,580.96	12.61%
36	600198	*ST 大唐	58,554,523.85	12.36%
37	000709	唐钢股份	57,985,833.55	12.24%
38	600887	伊利股份	57,893,009.35	12.22%
39	000759	武汉中百	54,220,576.88	11.44%
40	600470	六国化工	53,676,507.80	11.33%
41	000792	盐湖钾肥	48,895,110.68	10.32%
42	000402	金 融 街	44,974,780.07	9.49%
43	000751	锌业股份	40,479,612.63	8.54%
44	600031	三一重工	36,411,892.43	7.68%
45	600787	中储股份	34,382,108.29	7.26%
46	000623	吉林敖东	32,789,347.44	6.92%
47	600015	华夏银行	31,921,275.67	6.74%
48	600809	山西汾酒	30,501,113.64	6.44%
49	600052	*ST 广厦	30,403,132.54	6.42%
50	000069	华侨城 A	29,321,866.63	6.19%
51	000661	长春高新	27,627,776.48	5.83%
52	000061	农 产 品	27,197,108.79	5.74%
53	000629	攀钢钢钒	27,066,249.09	5.71%
54	600639	浦东金桥	26,062,941.09	5.50%
55	000839	中信国安	23,426,824.82	4.94%
56	600383	金地集团	22,730,498.22	4.80%
57	000858	五 粮 液	22,671,739.75	4.78%
58	600583	海油工程	21,479,758.14	4.53%
59	000565	渝三峡 A	21,184,356.15	4.47%
60	600521	华海药业	19,912,522.66	4.20%
61	000568	泸州老窖	18,960,164.91	4.00%
62	600655	豫园商城	17,121,595.35	3.61%
63	600858	银座股份	16,098,197.95	3.40%

64	000410	沈阳机床	15,017,105.16	3.17%
65	002007	华兰生物	14,586,237.68	3.08%
66	600525	长园新材	11,808,922.49	2.49%
67	002052	同洲电子	11,713,205.10	2.47%
68	000022	深赤湾 A	10,987,355.00	2.32%
69	601328	交通银行	10,981,021.61	2.32%
70	000560	昆百大 A	9,993,730.09	2.11%

(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	9,541,181,527.71
卖出股票的收入总额	7,511,000,130.07

5、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	408,678,406.40	7.03%
金融债券	864,645,059.47	14.88%
可转换债券	52,270,135.98	0.90%
合计	1,325,593,601.85	22.82%

6、本报告期末前五名债券投资明细

债券名称	市 值 (元)	占基金资产净值比例
02 国债	252,772,355.00	4.35%
01 国开 09	202,699,000.00	3.49%
06 农发 06	160,084,900.00	2.76%
06 国开 01	141,565,039.47	2.44%
21 国债	114,735,824.40	1.97%

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	5,343,772.50
应收证券清算款	28,428,539.74
应收利息	25,145,546.82
应收申购款	8,838,222.83
合计	67,756,081.89

(4) 报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券

(5) 报告期内本基金投资权证的情况：

权证名称	本期买入数量(份)	买入成本总额(元)	类别(被动持有/主动投资)	本期卖出数量(份)	卖出收入(元)
马钢 CWB1	1,490,000	3,956,752.63	主动投资	1,490,000	5,367,047.28
武钢 CWB1	645,632	1,496,123.03	被动持有	645,632	3,692,334.41
南航 JTP1	41,860,000	0.00	被动持有	26,860,000	57,114,485.10
五粮 YGC1	1,596,700	31,327,571.33	主动投资	1,596,700	49,333,718.64

钢钒 GFC1	0	0.00	被动持有	2,192,000	4,825,477.42
深发 SFC1	1,100,000	0.00	被动持有	0	0.00
深发 SFC2	550,000	0.00	被动持有	0	0.00

(6) 报告期内本基金未投资资产支持证券。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

一、持有人户数和持有人结构

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)	11,619	653,200	210,987
平均每户持有基金份额 (份)	21,742.20	12,963.49	21,218.24
机构投资者持有份额 (份)	2,933,335.49	22,869,310.71	72,859,521.62
占总份额比例	1.16%	0.27%	1.63%
个人投资者持有份额 (份)	249,689,264.25	8,444,883,984.75	4,403,913,040.71
占总份额比例	98.84%	99.73%	98.37%

二、截止 2007 年 6 月 30 日, 本基金管理人的基金从业人员未持有本系列基金基金份额。

八、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	214,732,687.42	533,327,971.02	282,241,429.58
本期总申购份额	623,426,789.88	12,353,865,039.99	10,352,001,356.82
本期总赎回份额	585,536,877.56	4,419,439,715.55	6,157,470,224.07
本期期末基金份额	252,622,599.74	8,467,753,295.46	4,476,772,562.33

九、重大事项揭示

(一) 本报告期内本系列基金没有召开基金份额持有人大会。

(二) 本报告期基金管理人的股权变动事项

经公司股东会审议通过, 并报中国证监会及中国商务部审核批准, 本基金管理人融通基金管理有限公司原股东陕西省国际信托投资股份有限公司、华林证券有限责任公司分别将其持有的公司 20% 出资全部转让给日兴资产管理有限公司 (Nikko Asset Management Co., Ltd.), 原股东联合证券有限责任公司将其持有的公司 20% 股权全部转让给新时代证券有限责任公司。

具体内容请参阅 2007 年 4 月 13 日及 6 月 20 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。

(三) 本报告期基金管理人的重大人事变动

1、高级管理人员变动

经公司董事会审议并报中国证监会审核批准, 免去刘小山先生的公司副总经理职务, 聘任刘模林先生为公司副总经理。

具体内容请参阅 2007 年 2 月 3 日及 2 月 5 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。

2、本系列基金基金经理变动

经公司董事会审议并报中国证监会审核通过,聘用陈晓生先生和严菲女士共同担任融通蓝筹成长证券投资基金的基金经理职务,免去易万军融通蓝筹成长证券投资基金的基金经理职务。

具体内容请参阅 2007 年 3 月 2 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。

(四) 本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

(五) 本系列基金的基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。

(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) 本系列基金投资策略在本报告期未发生改变。

(八) 本系列基金在报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

(九) 本系列基金本报告期内收益分配情况如下:

1、融通债券基金在本报告期内无收益分配事项;

2、融通深证 100 指数基金收益分配情况:

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
2007 年 1 月 16 日	2007 年 1 月 15 日	3.10 元	中国证券报、上海证券报、 证券时报
2007 年 2 月 1 日	2007 年 1 月 31 日	1.20 元	
2007 年 4 月 4 日	2007 年 4 月 3 日	0.80 元	
2007 年 4 月 26 日	2007 年 4 月 25 日	1.00 元	

3、融通蓝筹成长基金收益分配情况:

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
2007 年 1 月 22 日	2007 年 1 月 19 日	8.70 元	中国证券报、上海证券报、 证券时报

(十) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

1、融通债券基金

本基金为纯债券型基金。选择上海证券和中信建投的席位作为本基金的专用席位交易,报告期内没有发生租用席位变更情况。其交易量及佣金情况如下:

(1) 债券及债券回购成交情况:

券商名称	席位数量(个)	买卖债券成交量(元)	占本期该类交易成交量比例	债券回购成交量(元)	占本期该类交易成交量比例
上海证券	1	139,584,009.80	48.67%	174,600,000.00	100.00%
中信建投	1	147,217,119.77	51.33%	--	--
合 计	2	286,801,129.57	100.00%	174,600,000.00	100.00%

(2) 权证交易量及佣金情况

券商名称	买卖权证成交量(元)	占本期该类交易成交量比例	交易佣金(元)	占本期佣金总量比例
上海证券	2,710,376.82	100.00%	56,443.29	53.88%
中信建投	--	--	48,314.80	46.12%
合 计	2,710,376.82	100.00%	104,758.09	100.00%

2、融通深证 100 指数基金

本基金在本报告期内租用的席位有海通证券、中信万通证券、长城证券、长江证券、联合证券,原五矿证券交易席位已于 07 年 1 月办理完终止手续。本报告期内各席位交易量情况如下:

(1) 股票、权证成交量及佣金支付情况:

券商名称	席位	买卖股票	占本期	买卖权证	占本期	交易	占本期
------	----	------	-----	------	-----	----	-----

	数量 (个)	成交量(元)	该类交易 成交量 比例	成交量(元)	该类交易 成交量 比例	佣金(元)	佣金总 量比例
海通证券	1	2,746,878,348.90	15.39%	--	--	2,149,449.23	15.40%
中信万通	1	19,356,946.97	0.11%	--	--	8,064.72	0.06%
长城证券	1	2,610,707,627.71	14.62%	--	--	2,042,893.75	14.63%
长江证券	1	6,517,956,977.82	36.51%	1,772,918.80	100.00%	5,100,337.70	36.53%
联合证券	1	5,956,702,565.24	33.37%	--	--	4,660,898.84	33.38%
合 计	5	17,851,602,466.64	100.00%	1,772,918.80	100.00%	13,961,644.24	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)	占本期该类 交易成交量比例	债券回购 成交量(元)	占本期该类 交易成交量比例
海通证券	--	--	--	--
中信万通	105,634,431.10	95.25%	280,000,000.00	100.00%
长城证券	--	--	--	--
长江证券	--	--	--	--
联合证券	5,266,598.89	4.75%	--	--
合 计	110,901,029.99	100.00%	280,000,000.00	100.00%

3、融通蓝筹成长基金

基金在本报告期内选择了海通证券、联合证券、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。报告期内没有发生租用席位变更情况。其交易量及佣金情况如下：

(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)	占本期 该类交 易成交 量比例	买卖权证 成交量(元)	占本期 该类交 易成交 量比例	交易 佣金(元)	占本期 佣金总 量比例
海通证券	1	838,946,916.70	4.95%	--	--	685,074.00	5.03%
联合证券	1	424,858,784.36	2.50%	6,815,343.71	4.38%	332,096.47	2.44%
中信建投	1	1,950,548,362.03	11.50%	60,811,533.48	39.08%	1,568,919.08	11.53%
华林证券	1	2,084,563,737.58	12.29%	49,338,652.60	31.70%	1,631,183.92	11.99%
招商证券	2	4,884,020,413.97	28.79%	3,956,445.96	2.54%	3,967,357.43	29.15%
齐鲁证券	1	2,142,710,737.81	12.63%	--	--	1,742,419.96	12.80%
金元证券	1	1,574,938,837.11	9.28%	5,367,463.17	3.45%	1,288,540.01	9.47%
东方证券	1	3,063,935,675.03	18.06%	29,335,055.18	18.85%	2,394,136.77	17.59%
合 计	9	16,964,523,464.59	100.00%	155,624,494.10	100.00%	13,609,727.64	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)	占本期该类 交易成交量比例	债券回购 成交量(元)	占本期该类 交易成交量比例
海通证券	5,541,084.40	0.66%	515,500,000.00	17.89%
联合证券	7,160,967.62	0.85%	--	--
中信建投	502,618,374.00	59.73%	--	--
华林证券	--	--	--	--

招商证券	60,713,940.90	7.22%	985,500,000.00	34.21%
齐鲁证券	197,200,118.90	23.44%	800,000,000.00	27.77%
金元证券	--	--	580,000,000.00	20.13%
东方证券	68,228,879.46	8.11%	--	--
合 计	841,463,365.28	100.00%	2,881,000,000.00	100.00%

(十一) 其他重大事项说明

1、根据中国证监会发布的《关于统一规范证券投资基金认（申）购费用及认（申）购份额计算方法有关问题的通知》，经与基金托管人协商一致，基金管理人对本系列基金的基金合同相关条款进行修改。主要修改内容涉及基金前端申购费用及前端申购份额的计算方法，由“内扣法”变更为“外扣法”。

具体内容请参阅 2007 年 5 月 15 日及 5 月 22 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。

2、自 2007 年 7 月 1 日起，按照中国证监会的规定，本基金开始实施新的会计准则。

3、基金管理人董事变更

经公司董事会及股东会审议批准并报经中国证监会深圳证监局审核通过，公司第二届董事会由以下人员组成：孟立坤、曹凤岐、强力、林义相、Miyazato Hiroki（宫里启晖）、Allen Yan（颜锡廉）、马金声、吕秋梅、吴治平，其中曹凤岐、强力、林义相为独立董事。

具体内容请参阅 2007 年 8 月 4 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。

十、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）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 8 月 29 日