

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)
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

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股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）根据本基金合同规定，于 2007 年 8 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	2
三、管理人报告	3
(一) 基金管理人及基金经理简介	3
(二) 基金运作合规性说明	3
(三) 基金经理报告	3
四、托管人报告	4
五、财务会计报告（未经审计）	4
(一) 会计报表	4
(二) 会计报表附注	7
七、投资组合报告	11
八、基金份额持有人户数、持有人结构及场内前十名持有人	19
九、开放式基金份额变动	20
十、重大事项揭示	20
十一、备查文件目录	22

一、基金简介

(一) 基金基本情况

基金名称：融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)
基金简称：融通巨潮
交易代码：161607
基金运作方式：上市契约型开放式
基金合同生效日：2005 年 5 月 12 日
期末基金份额总额：2,586,385,613.96 份
基金合同存续期：不定期
基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所
上市日期：2005 年 6 月 16 日

(二) 基金投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征

投资目标：本基金为增强型指数基金。在控制股票投资组合相对巨潮 100 目标指数跟踪误差的基础上，力求获得超越巨潮 100 目标指数的投资收益，追求长期的资本增值。本基金谋求分享中国经济的持续、稳定增长和中国证券市场发展的成果，实现基金财产的长期增长，为投资者带来稳定的回报。

投资策略：本基金为增强型指数基金，在控制股票投资组合相对目标指数偏离风险的基础上，力争获得超越目标指数的投资收益。基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动调整，在数量化投资技术与基本面深入研究的结合中谋求基金投资组合在偏离风险及超额收益间的最佳匹配。为控制基金偏离目标指数的风险，本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在 0.5%。

业绩比较基准：巨潮 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。

(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
电话：0755 - 26948666
传真：0755 - 26935005
电子信箱：wuyip@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

信息披露报刊：《中国证券报》

基金管理人互联网网址：<http://www.rtfund.com>

报告备置地点：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
深圳证券交易所

(六) 注册登记机构概况

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融街 27 号投资广场 22、23 层

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

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

单位：人民币元

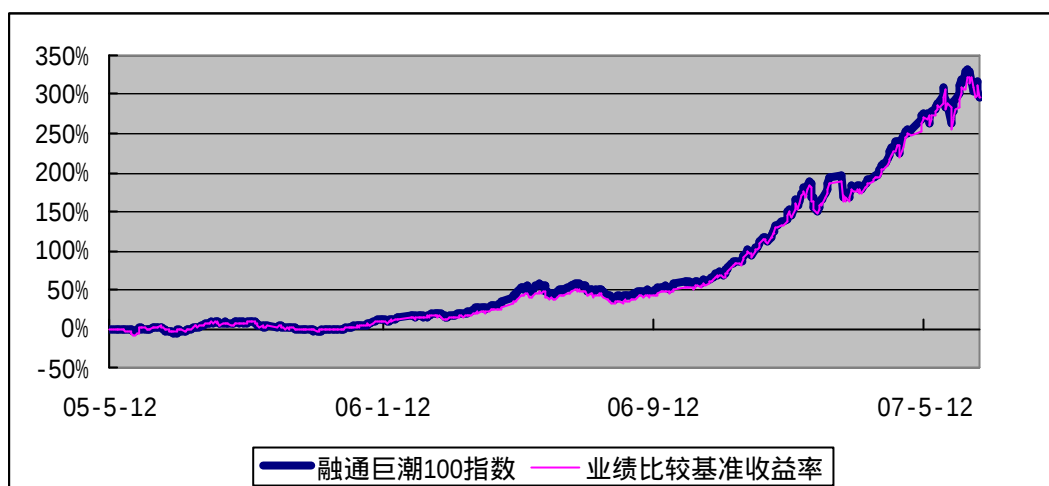
项目	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
基金本期净收益	976,324,106.07
加权平均基金份额本期净收益	0.5937
期末可供分配基金收益	82,330,946.11
期末可供分配基金份额收益	0.0318
期末基金资产净值	3,535,879,395.96
期末基金份额净值	1.367
基金加权平均净值收益率	42.81%
本期基金份额净值增长率	69.38%
基金份额累计净值增长率	294.87%

(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

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	0.45%	2.60%	0.17%	2.69%	0.28%	-0.09%
过去 3 个月	33.32%	2.23%	35.25%	2.25%	-1.93%	-0.02%
过去 6 个月	69.38%	2.36%	70.31%	2.36%	-0.93%	-0.00%
过去 1 年	153.53%	1.91%	163.53%	1.91%	-10.00%	-0.00%
自合同生效日起至今	294.87%	1.55%	289.99%	1.58%	4.88%	-0.03%

2、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



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.）、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，一只为封闭式基金：基金通乾，七只为开放式基金：融通新蓝筹基金、融通通利系列基金、融通行业景气基金和融通巨潮 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、基金经理简介

张野先生，1962 年出生，工商管理硕士，11 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。现同时担任融通深证 100 指数基金基金经理。

(二) 基金运作合规性说明

本报告期内，本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、《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)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

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%。

由于巨潮 100 指数成份股的风格特点和行业特点：金融、黑色金属、房地产、交通运输以及电力是本基金的核心资产；大盘蓝筹股权重相对其他指数权重超出较多，前 20 大蓝筹股票占比接近 50%。同时由于上半年是题材股和低价股的大幅上涨时期，在这些因素的共同左

右下，巨潮 100 指数在 2007 年上半年涨幅大幅略低于其他跨市场指数，但是超出大盘蓝筹指数的表现，上半年巨潮 100 指数增长 73.84%，同期沪深 300 指数增长 84.42%，上证 50 指数增长 61.52%。从净值表现来看，上半年巨潮 100 指数基金净值增长 69.38%，同期巨潮指数基金比较基准增长 70.31%。

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 6 次，累计分红每份 0.67 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巨潮 100 指数成份股自然权重的偏离，减少基金相对巨潮 100 指数的跟踪误差，力求最终实现对巨潮 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 0.11%，上半年平均日跟踪误差为 0.28%，严格控制基金合同规定的 0.5%的范围以内。上半年基金净值最终较好地拟合了目标指数的增长，有效地控制了指数基金相对目标指数的偏离风险。

四、托管人报告

2007年上半年，本基金托管人在对融通巨潮100指数基金的托管过程中，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，融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)的管理人——融通基金管理有限公司在融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)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。

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巨潮100指数证券投资基金(LOF)半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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2007年8月15日

五、财务会计报告（未经审计）

（一）会计报表

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)

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		187,488,615.56	36,818,033.85
清算备付金		10,886,981.24	4,628,255.08
交易保证金		2,771,099.04	250,000.00
应收证券交易清算款		--	344,177.37
应收股利		1,717,035.84	--
应收利息	5(1)	1,781,199.01	93,908.7
应收申购款		41,237,220.99	6,822,955.89
其他应收款		--	--
股票投资市值		3,301,964,660.40	930,355,958.48
其中：股票投资成本		3,084,338,480.63	725,960,878.14
债券投资市值		100,808,458.50	15,976,693.68
其中：债券投资成本		100,886,507.41	15,912,933.54
权证投资		9,202,102.18	502,258.15
其中：权证投资成本		1,290,226.29	206,626.85
买入返售证券		--	--
待摊费用		--	--
其他资产		--	--
资产总计		3,657,857,372.76	995,792,241.20
负债：			
应付证券清算款		73,328,888.06	1,067,309.96
应付赎回款		39,748,990.82	10,465,970.55
应付赎回费		149,701.74	39,259.22
应付管理人报酬	4(3)	3,506,050.80	909,069.56
应付托管费	4(3)	539,392.43	139,856.87
应付佣金	5(2)	4,313,597.97	1,367,674.22
应付利息		--	--
应付收益		--	--
其它应付款	5(3)	250,062.82	250,000.00
卖出回购证券款		--	--
预提费用	5(4)	141,292.16	150,000.00
其他负债		--	--
负债合计		121,977,976.80	14,389,140.38
持有人权益：			
实收基金	5(5)	2,586,385,613.96	755,826,642.54
未实现利得	5(6)	867,162,835.89	209,795,909.87
未分配收益		82,330,946.11	15,780,548.41
持有人权益合计		3,535,879,395.96	981,403,100.82

负债及持有人权益总计		3,657,857,372.76	995,792,241.20
基金份额净值		1.367	1.298

所附附注为本会计报表的组成部分

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)

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		993,448,684.63	42,891,501.54
1、股票差价收入	5(7)	976,072,128.14	36,549,842.25
2、债券差价收入	5(8)	--	-136,325.64
3、权证差价收入	5(9)	876,323.60	4,478,234.77
3、债券利息收入		1,117,292.18	111,225.94
4、存款利息收入		420,855.94	39,600.67
5、股利收入		11,737,375.18	1,505,962.36
6、买入返售证券收入		--	--
7、其他收入	5(10)	3,224,709.59	342,961.19
二、费用		17,124,578.56	1,204,092.38
1、基金管理人报酬	4(3)	14,558,812.55	908,039.32
2、基金托管费	4(3)	2,239,817.26	139,698.40
3、卖出回购证券支出		172,808.00	42,278.87
4、利息支出		--	--
5、其他费用	5(11)	153,140.75	114,075.79
其中：上市年费		29,752.78	29,752.78
信息披露费		62,408.40	49,588.57
审计费用		44,630.98	24,795.19
回购交易费用		2,000.09	779.40
银行费用		848.50	159.85
债券账户维护费		13,500.00	9,000.00
其他		--	--
三、基金净收益		976,324,106.07	41,687,409.16
加：未实现利得		20,705,534.97	11,978,165.91
四、基金经营业绩		997,029,641.04	53,665,575.07

所附附注为本会计报表的组成部分

融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)

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		976,324,106.07	41,687,409.16
加：期初基金净收益		15,780,548.41	4,402,152.14
加：本期损益平准金		85,941,277.16	-1,241,114.89

可供分配基金净收益		1,078,045,931.64	44,848,446.41
减：本期已分配基金净收益	5(12)	995,714,985.53	33,506,745.77
期末基金净收益		82,330,946.11	11,341,700.64

所附附注为本会计报表的组成部分

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)

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		981,403,100.82	252,546,633.23
二、本期经营活动：			
基金净收益		976,324,106.07	41,687,409.16
未实现利得		20,705,534.97	11,978,165.91
经营活动产生的基金净值变动数		997,029,641.04	53,665,575.07
三、本期基金份额交易：			
基金申购款		5,138,338,726.55	164,296,907.22
其中：分红再投资		631,861,174.05	3,045,339.05
基金赎回款		-2,585,177,086.92	-275,784,081.85
基金份额交易产生的基金净值变动数		2,553,161,639.63	-111,487,174.63
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	5(12)	-995,714,985.53	-33,506,745.77
五、期末基金净值		3,535,879,395.96	161,218,287.90

所附附注为本会计报表的组成部分

(二) 会计报表附注

(除特别说明外，金额单位为人民币元)

附注1. 基金基本情况

融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)(以下简称“本基金”)经中国证监会证监基金字[2005]第 18 号《关于同意融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)募集的批复》核准，由融通基金管理有限公司依照《证券投资基金法》和《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 513,273,618.60 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 65 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《融通巨潮 100 指数证券投资基金(LOF)基金合同》于 2005 年 5 月 12 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 513,527,198.43 份基金份额。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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2005]第 56 号文审核同意，本基金 188,512,868.00 份基金份额于 2005 年 6 月 16 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《证券投资基金法》和《融通巨潮100指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定,本基金主要投资于目标指数的成份股票,包括巨潮100指数的成份股和预期将要被选入巨潮100指数的股票,非成份股的投资比例控制在基金资产净值的10%以内,但成份股更换期因指数成份股调整而进行的非成份股投资不在此比例限制范围之内。为控制基金偏离目标指数的风险,本基金力求将基金份额净值增长率与目标指数增长率间的日跟踪误差控制在0.5%。本基金投资于股票的资产比例范围为基金资产净值的90% - 95%;保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的资产比例合计不低于基金资产净值的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. 重大关联方关系及关联交易

(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“十 重大事项揭示 (二) 本报告期基金管理人的股权变动事项”

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交易

本基金未租用关联方席位。

(3) 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 1.3% 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 × 1.3% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 14,558,812.55 元(2006 年同期: 908,039.32 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 0.2% 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 × 0.2% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 2,239,817.26 元(2006 年同期: 139,698.40 元)。

(4) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无(2006 年同期: 无)。

(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 187,488,615.56 元(2006 年 6 月 30 日: 9,190,567.73 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 338,998.96 元。

(2006 年同期：36,430.77 元)。

(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 年同期：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 年同期：无)

附注 5. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2007年6月30日
应收银行存款利息	32,659.46
应收申购款利息	83.88
应收清算备付金利息	4,409.28
应收债券利息	1,744,046.39
合计	1,781,199.01

(2) 应付佣金

项目	2007年6月30日
银河证券	1,402,228.25
东北证券	740,616.70
广发证券	1,213,851.82
光大证券	956,901.20
合计	4,313,597.97

(3) 其他应付款

项目	2007年6月30日
应付券商席位保证金	250,000.00
其他应付款	62.82
合计	250,062.82

(4) 预提费用

项目	2007年6月30日
信息披露费	62,408.40
审计费用	44,630.98
上市费	29,752.78
帐户维护费	4,500.00
合计	141,292.16

(5) 实收基金

项目	2007年6月30日
期初基金份额 (份)	755,826,642.54
加：本期申购	3,721,976,907.20
减：本期赎回	1,891,417,935.78
期末数	2,586,385,613.96

(6) 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	204,754,471.78	5,041,438.09	209,795,909.87

本期净变动数	20,705,534.97	--	20,705,534.97
加:本期申购基金份额	--	1,209,890,170.38	1,209,890,170.38
减:本期赎回基金份额	--	573,228,779.33	573,228,779.33
2007 年 6 月 30 日	225,460,006.75	641,702,829.14	867,162,835.89

(a) 未实现估值增值

项目	2007 年 6 月 30 日
股票投资	217,626,179.77
债券投资	-78,048.91
权证投资	7,911,875.89
合计	225,460,006.75

(7) 股票差价收入

项目	2007-1-1至2007-6-30
卖出股票成交总额	4,783,329,412.65
减:应付佣金总额	4,013,631.14
减:卖出股票成本总额	3,803,243,653.37
股票差价收入	976,072,128.14

本基金本报告期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共计2,487.24元,已全额同期冲减股票投资成本。(2006年度同期:共计395,828.26元已全额同期冲减股票投资成本)。

(8) 债券差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出债券成交总额	--
减:卖出债券成本总额	--
减:应收利息总额	--
债券差价收入	--

(9) 权证差价收入

项目	2007-1-1 至 2007-6-30
卖出权证成交总额	1,082,950.45
减:卖出权证成本总额	206,626.85
权证差价收入	876,323.60

(10) 其他收入

项目	2007-1-1至2007-6-30
赎回费分成	3,224,709.59
合计	3,224,709.59

(11) 其他费用

项目	2007-1-1至2007-6-30
上市年费	29,752.78
信息披露费	62,408.40
审计费用	44,630.98
回购交易费用	2,000.09
银行费用	848.50
债券账户维护费	13,500.00
合计	153,140.75

(12) 收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数 (元)	收益分配总金额 (元)
2007 年半年度		
第一次中期分红	2.600	233,648,547.37
第二次中期分红	0.500	76,765,768.06
第三次中期分红	0.800	115,160,443.12
第四次中期分红	0.800	140,232,922.27
第五次中期分红	1.000	201,921,932.57
第六次中期分红	1.000	227,985,372.14
合计	6.700	995,714,985.53

附注6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

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)交易印花税税率，由1‰调整为3‰。

七、投资组合报告

(一) 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
银行存款及清算备付金	198,375,596.80	5.42%
股票投资市值	3,301,964,660.40	90.27%
债券投资市值	100,808,458.50	2.76%
权证投资市值	9,202,102.18	0.25%
其他资产	47,506,554.88	1.30%
资产合计	3,657,857,372.76	100.00%

(二) 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	--	--
B 采掘业	163,987,904.48	4.63%
C 制造业	994,838,610.58	28.13%
C0 食品、饮料	218,619,441.77	6.18%
C1 纺织、服装、皮毛	46,461,166.44	1.31%
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	--	--
C4 石油、化学、塑胶、塑料	95,490,759.78	2.70%
C5 电子	16,454,988.00	0.47%
C6 金属、非金属	391,738,275.23	11.08%
C7 机械、设备、仪表	210,513,720.72	5.95%

C8 医药、生物制品	15,560,258.64	0.44%
C99 其他制造业	--	--
D 电力、煤气及水的生产和供应业	238,718,344.09	6.75%
E 建筑业	--	--
F 交通运输、仓储业	269,418,474.06	7.62%
G 信息技术业	155,203,080.42	4.39%
H 批发和零售贸易	95,777,310.12	2.71%
I 金融、保险业	915,540,892.99	25.89%
J 房地产业	192,663,323.92	5.45%
K 社会服务业	41,217,167.00	1.17%
L 传播与文化产业	21,057,149.96	0.60%
M 综合类	75,808,158.24	2.14%
合计	3,164,230,415.86	89.49%

(2) 积极投资部分

行业	市 值 (元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	17,459,439.84	0.49%
B 采掘业	110,590,945.5	3.13%
C 制造业	9,683,859.20	0.27%
C7 机械、设备、仪表	9,683,859.20	0.27%
合计	137,734,244.54	3.89%

(三) 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)	期末市值 (元)	市值占净值比例
1	600000	浦发银行	4,615,264	168,872,509.76	4.78%
2	600036	招商银行	6,618,815	162,690,472.70	4.60%
3	000002	万 科 A	6,883,261	131,607,950.32	3.72%
4	600030	中信证券	2,385,663	126,368,569.11	3.57%
5	600016	民生银行	10,179,343	116,349,890.49	3.29%
6	600900	长江电力	6,140,788	92,848,714.56	2.63%
7	601318	中国平安	1,114,157	79,673,367.07	2.25%
8	000858	五 粮 液	2,408,260	75,763,859.60	2.14%
9	600019	宝钢股份	6,592,900	72,521,900.00	2.05%
10	000001	深发展 A	2,605,070	71,691,526.40	2.03%
11	600519	贵州茅台	596,026	71,332,391.68	2.02%
12	600050	中国联通	11,594,616	68,060,395.92	1.92%
13	600028	中国石化	4,981,044	65,849,401.68	1.86%
14	600009	上海机场	1,423,400	54,103,434.00	1.53%
15	601628	中国人寿	1,279,815	52,613,194.65	1.49%
16	600177	雅戈尔	1,746,004	46,461,166.44	1.31%
17	600309	烟台万华	867,144	46,444,232.64	1.31%
18	601006	大秦铁路	3,023,086	45,769,522.04	1.29%

19	002024	苏宁电器	973,700	45,724,952.00	1.29%
20	600011	华能国际	3,466,395	37,194,418.35	1.05%
21	600104	上海汽车	2,146,352	37,067,499.04	1.05%
22	601988	中国银行	7,251,874	36,404,407.48	1.03%
23	601600	中国铝业	1,552,235	35,825,583.80	1.01%
24	600320	振华港机	1,790,442	35,576,082.54	1.01%
25	601166	兴业银行	996,281	34,959,500.29	0.99%
26	000527	美的电器	1,113,866	33,861,526.40	0.96%
27	000063	中兴通讯	614,532	33,430,540.80	0.95%
28	600005	武钢股份	3,293,309	33,130,688.54	0.94%
29	000039	中集集团	1,083,338	31,763,470.16	0.90%
30	600739	辽宁成大	927,813	31,721,926.47	0.90%
31	000825	太钢不锈	1,405,100	28,186,306.00	0.80%
32	600015	华夏银行	2,302,276	27,719,403.04	0.78%
33	000069	华侨城 A	695,400	27,676,920.00	0.78%
34	000402	金融街	938,300	27,210,700.00	0.77%
35	600811	东方集团	874,465	26,985,989.90	0.76%
36	600642	申能股份	1,908,000	26,692,920.00	0.75%
37	000898	鞍钢股份	1,498,504	26,508,535.76	0.75%
38	600018	上港集团	3,330,334	25,610,268.46	0.72%
39	600010	包钢股份	3,621,586	25,314,886.14	0.72%
40	000651	格力电器	704,436	24,584,816.40	0.70%
41	600717	天津港	974,600	24,530,682.00	0.69%
42	601328	交通银行	2,200,800	24,186,792.00	0.68%
43	000895	双汇发展	400,001	23,160,057.90	0.66%
44	000983	西山煤电	806,200	22,759,026.00	0.64%
45	600583	海油工程	609,645	22,069,149.00	0.62%
46	600649	原水股份	1,545,062	21,677,219.86	0.61%
47	600887	伊利股份	677,185	21,101,084.60	0.60%
48	600037	歌华有线	804,322	21,057,149.96	0.60%
49	600601	方正科技	1,734,000	21,033,420.00	0.59%
50	000568	泸州老窖	497,005	20,923,910.50	0.59%
51	000792	盐湖钾肥	463,800	20,583,444.00	0.58%
52	600585	海螺水泥	345,750	20,385,420.00	0.58%
53	600832	东方明珠	1,248,120	20,207,062.80	0.57%
54	600048	保利地产	430,900	19,791,237.00	0.56%
55	000629	攀钢钢钒	2,352,432	19,454,612.64	0.55%
56	601333	广深铁路	2,503,311	19,100,262.93	0.54%
57	600795	国电电力	1,454,961	19,089,088.32	0.54%
58	000878	云南铜业	537,600	18,547,200.00	0.52%
59	000060	中金岭南	630,574	18,475,818.20	0.52%
60	000027	深能源 A	811,400	18,435,008.00	0.52%

61	600100	同方股份	536,139	18,389,567.70	0.52%
62	000709	唐钢股份	1,437,053	18,365,537.34	0.52%
63	601111	中国国航	1,832,900	17,944,091.00	0.51%
64	600497	驰宏锌锗	264,800	17,484,744.00	0.49%
65	600331	宏达股份	357,450	17,318,452.50	0.49%
66	600660	福耀玻璃	556,700	16,990,484.00	0.48%
67	000768	西飞国际	549,444	16,961,336.28	0.48%
68	600839	四川长虹	1,846,800	16,454,988.00	0.47%
69	600690	青岛海尔	1,026,200	16,419,200.00	0.46%
70	600001	邯郸钢铁	2,477,643	15,782,585.91	0.45%
71	600026	中海发展	684,318	15,725,627.64	0.44%
72	000423	东阿阿胶	595,722	15,560,258.64	0.44%
73	600895	张江高科	829,819	14,339,272.32	0.41%
74	000839	中信国安	510,327	14,289,156.00	0.40%
75	000630	铜都铜业	751,300	14,282,213.00	0.40%
76	601588	北辰实业	1,379,140	14,053,436.60	0.40%
77	000562	宏源证券	478,200	14,011,260.00	0.40%
78	601872	招商轮船	1,261,200	13,835,364.00	0.39%
79	600879	火箭股份	518,922	13,798,135.98	0.39%
80	600008	首创股份	1,186,700	13,540,247.00	0.38%
81	000932	华菱管线	1,562,246	13,325,958.38	0.38%
82	600004	白云机场	701,300	13,044,180.00	0.37%
83	000793	华闻传媒	1,517,800	12,719,164.00	0.36%
84	000625	长安汽车	714,846	11,780,662.08	0.33%
85	600098	广州控股	978,100	11,688,295.00	0.33%
86	600688	S 上石化	974,181	11,144,630.64	0.32%
87	000539	粤电力 A	1,027,100	11,092,680.00	0.31%
88	600500	中化国际	769,740	10,861,031.40	0.31%
89	600269	赣粤高速	775,127	10,751,011.49	0.30%
90	600428	中远航运	480,350	10,514,861.50	0.30%
91	000800	一汽轿车	963,400	10,501,060.00	0.30%
92	600418	江淮汽车	949,800	9,963,402.00	0.28%
93	600362	江西铜业	389,100	9,544,623.00	0.27%
94	000088	盐田港	551,900	9,266,401.00	0.2621%
95	000089	深圳机场	923,200	9,222,768.00	0.26%
96	600808	马钢股份	1,362,803	9,158,036.16	0.26%
97	600694	大商股份	121,355	7,469,400.25	0.21%
98	000930	丰原生化	988,789	6,338,137.49	0.18%
99	000503	海虹控股	129,939	1,556,669.22	0.04%

2、积极投资部分

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	期末市值 (元)	市值占净值比例
1	600547	山东黄金	1,508,950	110,590,945.50	3.13%

2	000860	顺鑫农业	1,347,179	17,459,439.84	0.49%
3	002013	中航精机	499,168	9,683,859.20	0.27%

(四) 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	600030	中信证券	657,649,641.31	67.01%
2	600000	浦发银行	309,686,992.33	31.56%
3	000001	深发展 A (注)	214,093,702.67	21.82%
4	000858	五 粮 液	201,326,247.45	20.51%
5	600016	民生银行	187,847,108.27	19.14%
6	600036	招商银行	162,419,289.15	16.55%
7	000002	万 科 A	155,608,756.95	15.86%
8	601628	中国人寿	151,949,956.31	15.48%
9	600019	宝钢股份	151,007,807.09	15.39%
10	600005	武钢股份	135,197,537.47	13.78%
11	600900	长江电力	125,771,381.48	12.82%
12	600009	上海机场	112,297,648.37	11.44%
13	601988	中国银行	107,060,928.94	10.91%
14	600642	申能股份	92,938,254.57	9.47%
15	601006	大秦铁路	88,535,521.84	9.02%
16	600547	山东黄金	88,077,350.84	8.97%
17	000527	美的电器	86,090,947.24	8.77%
18	600028	中国石化	83,328,156.50	8.49%
19	002024	苏宁电器	79,605,850.12	8.11%
20	600050	中国联通	79,138,205.51	8.06%
21	000825	太钢不锈	71,516,156.57	7.29%
22	601318	中国平安	70,784,266.30	7.21%
23	600811	东方集团	70,609,285.76	7.19%
24	600519	贵州茅台	69,237,072.58	7.05%
25	600177	雅戈尔	68,611,662.85	6.99%
26	000063	中兴通讯	61,418,474.57	6.26%
27	600290	华仪电气	56,867,047.79	5.79%
28	600104	上海汽车	55,724,111.23	5.68%
29	000402	金 融 街	51,744,255.68	5.27%
30	600309	烟台万华	49,390,265.36	5.03%
31	000651	格力电器	49,180,916.51	5.01%
32	600717	天津港	48,461,054.63	4.94%
33	600015	华夏银行	45,935,586.42	4.68%
34	000629	攀钢钢钒	45,727,409.56	4.66%
35	000039	中集集团	44,020,378.55	4.49%
36	000069	华侨城 A	42,838,761.82	4.37%

37	600320	振华港机	42,811,047.04	4.36%
38	000898	鞍钢股份	42,469,902.25	4.33%
39	000709	唐钢股份	42,203,508.05	4.30%
40	000630	铜都铜业	41,826,590.07	4.26%
41	600048	保利地产	41,299,616.09	4.21%
42	600739	辽宁成大	40,018,807.10	4.08%
43	000568	泸州老窖	39,327,790.38	4.01%
44	600660	福耀玻璃	39,082,553.43	3.98%
45	600832	东方明珠	38,240,116.81	3.90%
46	600011	华能国际	37,687,540.37	3.84%
47	601328	交通银行	37,440,373.88	3.81%
48	601111	中国国航	37,376,777.40	3.81%
49	600010	包钢股份	36,485,621.37	3.72%
50	000983	西山煤电	35,871,769.14	3.66%
51	000768	西飞国际	34,818,360.19	3.55%
52	601166	兴业银行	34,430,467.89	3.51%
53	600018	上港集团	33,046,915.87	3.37%
54	600742	一汽四环	32,825,573.53	3.34%
55	000878	云南铜业	32,783,856.94	3.34%
56	000792	盐湖钾肥	32,135,290.20	3.27%
57	600690	青岛海尔	30,353,860.05	3.09%
58	600839	四川长虹	29,084,933.89	2.96%
59	600601	方正科技	29,053,945.30	2.96%
60	600100	同方股份	28,332,498.77	2.89%
61	600649	原水股份	28,196,096.64	2.87%
62	600132	重庆啤酒	27,843,362.45	2.84%
63	000027	深能源 A	27,277,197.81	2.78%
64	000793	华闻传媒	27,048,214.86	2.76%
65	601333	广深铁路	25,513,058.71	2.60%
66	000932	华菱管线	25,415,180.44	2.59%
67	000060	中金岭南	25,309,511.00	2.58%
68	600688	S 上石化	25,260,312.32	2.57%
69	600037	歌华有线	25,142,892.81	2.56%
70	600008	首创股份	24,384,223.32	2.48%
71	000895	双汇发展	24,377,371.70	2.48%
72	000800	一汽轿车	23,550,635.05	2.40%
73	600192	长城电工	23,451,570.79	2.39%
74	600583	海油工程	23,078,946.07	2.35%
75	000860	顺鑫农业	22,554,638.40	2.30%
76	000625	长安汽车	22,379,161.83	2.28%
77	600895	张江高科	21,829,739.90	2.22%
78	600331	宏达股份	21,789,564.84	2.22%

79	600867	通化东宝	21,677,486.35	2.21%
80	600795	国电电力	21,620,005.45	2.20%
81	000539	粤电力 A	21,335,412.69	2.17%
82	600098	广州控股	21,167,338.34	2.16%
83	600004	白云机场	20,883,444.29	2.13%
84	000088	盐 田 港	20,881,892.81	2.13%
85	000778	新兴铸管	20,133,898.88	2.05%

注：此买入金额中已扣除因股权分置改革获得的现金对价 2,487.24 元。

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	600030	中信证券	661,355,351.60	67.39%
2	000001	深发展 A	198,551,016.92	20.23%
3	600000	浦发银行	196,190,627.87	19.99%
4	000858	五 粮 液	182,065,065.82	18.55%
5	600016	民生银行	170,964,023.72	17.42%
6	600005	武钢股份	165,241,065.25	16.84%
7	600019	宝钢股份	136,971,877.37	13.96%
8	600036	招商银行	111,724,113.41	11.38%
9	601628	中国人寿	111,005,969.09	11.31%
10	000002	万 科 A	110,246,100.95	11.23%
11	600009	上海机场	93,427,180.60	9.52%
12	601988	中国银行	89,463,791.18	9.12%
13	600900	长江电力	75,982,209.81	7.74%
14	000527	美的电器	75,703,495.74	7.71%
15	600642	申能股份	75,243,271.49	7.67%
16	600290	华仪电气	70,697,993.79	7.20%
17	600811	东方集团	67,808,992.96	6.91%
18	601006	大秦铁路	61,539,726.87	6.27%
19	000825	太钢不锈	59,766,332.41	6.09%
20	600028	中国石化	59,237,033.06	6.04%
21	600050	中国联通	54,632,926.78	5.57%
22	002024	苏宁电器	53,797,769.90	5.48%
23	000402	金 融 街	48,307,349.18	4.92%
24	600177	雅戈尔	46,475,926.09	4.74%
25	000709	唐钢股份	43,930,745.26	4.48%
26	600717	天津港	43,648,491.04	4.45%
27	000063	中兴通讯	43,197,092.34	4.40%
28	600104	上海汽车	42,301,011.51	4.31%
29	000630	铜都铜业	39,487,451.91	4.02%
30	000651	格力电器	39,383,751.97	4.01%
31	600048	保利地产	38,534,803.87	3.93%
32	000629	攀钢钢钒	38,483,670.52	3.92%

33	600660	福耀玻璃	35,816,512.83	3.65%
34	000568	泸州老窖	35,027,755.17	3.57%
35	600015	华夏银行	34,656,547.90	3.53%
36	000898	鞍钢股份	33,596,868.37	3.42%
37	000069	华侨城 A	33,151,606.28	3.38%
38	000039	中集集团	32,981,856.58	3.36%
39	600742	一汽四环	31,693,571.22	3.23%
40	601111	中国国航	31,327,783.98	3.19%
41	000778	新兴铸管	31,117,280.57	3.17%
42	000972	新 中 基	30,974,342.78	3.16%
43	600132	重庆啤酒	30,383,156.26	3.10%
44	000983	西山煤电	29,653,109.84	3.02%
45	000768	西飞国际	29,407,285.34	3.00%
46	600519	贵州茅台	29,359,213.16	2.99%
47	000878	云南铜业	28,719,345.08	2.93%
48	600320	振华港机	27,610,496.30	2.81%
49	600309	烟台万华	26,814,224.42	2.73%
50	600832	东方明珠	26,705,482.13	2.72%
51	600690	青岛海尔	26,337,855.40	2.68%
52	000792	盐湖钾肥	25,435,078.06	2.59%
53	600192	长城电工	25,221,386.57	2.57%
54	600010	包钢股份	23,981,972.78	2.44%
55	600867	通化东宝	23,933,350.73	2.44%
56	600688	S 上石化	22,438,434.67	2.29%
57	000027	深能源 A	21,499,679.54	2.19%
58	600839	四川长虹	21,332,657.66	2.17%
59	600550	天威保变	21,274,418.26	2.17%
60	600100	同方股份	20,854,339.58	2.12%
61	600018	上港集团	20,669,924.14	2.11%
62	000800	一汽轿车	20,488,657.38	2.09%
63	600601	方正科技	19,751,238.21	2.01%
64	000661	长春高新	19,716,909.83	2.01%

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	6,161,621,255.86
卖出股票的收入总额	4,783,329,412.65

(五) 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	95,079,105.00	2.69%
企业债	5,729,353.50	0.16%

合计	100,808,458.50	2.85%
----	----------------	-------

(六) 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	95,079,105.00	2.69%
07 武钢债	4,844,560.00	0.14%
钢钒债 1	884,793.50	0.03%

(七) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体无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。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产

项目	金 额 (元)
交易保证金	2,771,099.04
应收股利	1,717,035.84
应收利息	1,781,199.01
应收申购款	41,237,220.99
合计	47,506,554.88

4、本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、权证投资情况

权证名称	权证数量 (份)	成本总额 (元)	期间卖出数量 (份)	卖出差价收入 (元)
钢钒 GFC1	262,550	206,626.85	262,550	876,323.60
武钢 CWB1	556,780	1,290,226.29	--	--
深发 SFC1	247,577	0.00	--	--
深发 SFC2	123,788	0.00	--	--

注：本基金不允许主动投资权证业务，以上钢钒权证为钢钒可分离债所获配部分，武钢权证为武钢债所获配部分，深发权证为深发展股权分置改革中对价支付所获配部分，均属被动投资。

6、本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、持有人结构及场内前十名持有人

1、基金份额持有人户数及持有人结构：

基金份额持有人户数(户)	150,352
平均每户持有的基金份额(份)	17,202.20
机构投资者持有的基金份额(份)	18,210,694.55
机构投资者持有的基金份额占总份额比例	0.70%
个人投资者持有的基金份额(份)	2,568,174,919.41
个人投资者持有的基金份额占总份额比例	99.30%

2、截止 2007 年 6 月 30 日，本基金场内前十名持有人情况如下：

序号	持有人名称	期末持有份额 (份)	占总份额比例
1	董浩	1,002,200	0.76%

2	潘河虾	894,186	0.68%
3	林青	864,658	0.66%
4	张颖	781,236	0.59%
5	施红梅	582,458	0.44%
6	江蕊	557,672	0.42%
7	孙燕	557,672	0.42%
8	上海黄浦对外经济技术合作有限公司	550,000	0.42%
9	李佩兰	533,861	0.40%
10	杜烨	529,856	0.40%

3、截止 2007 年 6 月 30 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 131,944,695 份。

4、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基金份额。

九、开放式基金份额变动

项目	基金份额（份）
合同生效日基金份额	513,527,198.43
本期期初基金份额	755,826,642.54
本期总申购份额	3,721,976,907.20
本期总赎回份额	1,891,417,935.78
本期期末基金份额	2,586,385,613.96

十、重大事项揭示

（一）本报告期末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重大人事变动。

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。

（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末发生改变。

（八）本基金在本报告期内实施收益分配情况

公告日	权益登记日	每 10 份基金份额分红数 (元)	披露报纸
07-1-19	07-1-24	2.600	中国证券报
07-2-14	07-2-26	0.500	中国证券报
07-3-26	07-3-29	0.800	中国证券报
07-4-26	07-5-8	0.800	中国证券报
07-5-28	07-5-31	1.000	中国证券报
07-6-20	07-6-25	1.000	中国证券报

(九) 本基金在报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

(十) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

本基金管理人选定的专用交易席位券商分别是：银河证券、东北证券、兴安证券、广发证券和光大证券。

本报告期内，本基金通过各机构的交易席位的成交及佣金情况见下表：

1、股票成交量及佣金支付情况：

券商名称	席位数量 (个)	股票成交金额 (元)	占全年该类交易 总成交金额比例	席位佣金 金额(元)	占佣金 总额比例
银河证券	1	3,418,835,648.26	31.26%	2,675,260.06	30.27%
东北证券	1	1,948,456,219.27	17.82%	1,597,153.96	18.07%
兴安证券	1	--	--	--	--
广发证券	1	2,343,237,529.85	21.42%	1,921,077.23	21.74%
光大证券	1	3,226,510,685.43	29.50%	2,644,262.52	29.92%
合 计	5	10,937,040,082.81	100.00%	8,837,753.77	100.00%

2、债券、债券回购及权证成交情况：

券商席位	债券成交 金额(元)	占全年该 类交易总 成交金额 比例	债券回购 成交金额(元)	占全年该 类交易 总成交金 额比例	权证 成交金额(元)	占全年该类 交易总成交 金额比例
银河证券	--	--	--	--	1,083,058.76	100.00%
东北证券	20,200,000.00	25.09%	73,000,000.00	22.81%	--	--
兴安证券	--	--	--	--	--	--
广发证券	20,109,577.20	24.97%	35,000,000.00	10.94%	--	--
光大证券	40,210,169.60	49.94%	212,000,000.00	66.25%	--	--
合 计	80,519,746.80	100.00%	320,000,000.00	100.00%	1,083,058.76	100.00%

3、本报告期内租用证券公司席位无变化。

(十一) 其他重要事项

1、本基金参加中国工商银行基金定投业务，申购费率有优惠。具体内容请参阅2007年4月20日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报的公告。

2、从 2007 年 6 月 20 日至 2007 年 9 月 28 日，本基金参加工行“金融@家”基金申购费率优惠活动，投资者通过工行个人网上银行申购本基金享有优惠。

具体内容请参阅 2007 年 6 月 19 日刊登于中国证券报、证券时报和上海证券报上的公告。

3、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。

4、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。

十一、备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件；
- (二) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同》；
- (三) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 托管协议》；
- (四) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书》；
- (五) 《融通巨潮 100 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书》；
- (六) 《融通基金管理有限公司开放式基金业务管理规则》；
- (七) 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、深圳证券交易所

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