

**融通新蓝筹证券投资基金**  
**2006 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：中国建设银行股份有限公司**

**送出日期：二〇〇六年八月二十五日**

## 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年8月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配、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
(一) 基金基本情况	1
(二) 基金投资目标、投资策略、业绩比较基准、风险收益特征	1
(三) 基金管理人概况	1
(四) 基金托管人概况	1
(五) 信息披露	1
(六) 注册登记机构概况	1
二、主要财务指标和基金净值表现	2
(一) 主要财务指标(单位:人民币元)	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	6
六、投资组合报告	11
七、基金份额持有人户数、持有人结构	15
八、开放式基金份额变动	15
九、重大事项揭示	15
十、备查文件目录	17

## 一、基金简介

### （一）基金基本情况

基金名称：融通新蓝筹证券投资基金

基金简称：融通新蓝筹基金

交易代码：161601

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2002 年 9 月 13 日

期末基金份额总额：759,233,719.99 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

投资目标：主要投资于处于成长阶段和成熟阶段早期的“新蓝筹”上市公司。通过组合投资，在充分控制风险的前提下实现基金净值的稳定增长，为基金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。在正常市场状况下，股票投资比例浮动范围：30-75%；债券投资比例浮动范围：20-55%；权证投资比例浮动范围：0-3%；现金留存比例浮动范围：不低于 5%。

业绩比较基准：本基金股票投资部分的比较基准是“国泰君安指数”。

风险收益特征：在适度风险下追求较高收益。

### （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：wuy@mail.rtfund.com

### （四）基金托管人概况

名称：中国建设银行股份有限公司（以下简称：中国建设银行）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

信息披露负责人：尹东

联系电话：010-67595104

传真：010-66275830

电子信箱：yindong@ccb.cn

### （五）信息披露

信息披露报刊：《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  
北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼 中国建设银行基金托管部

### （六）注册登记机构概况

注册登记机构：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)

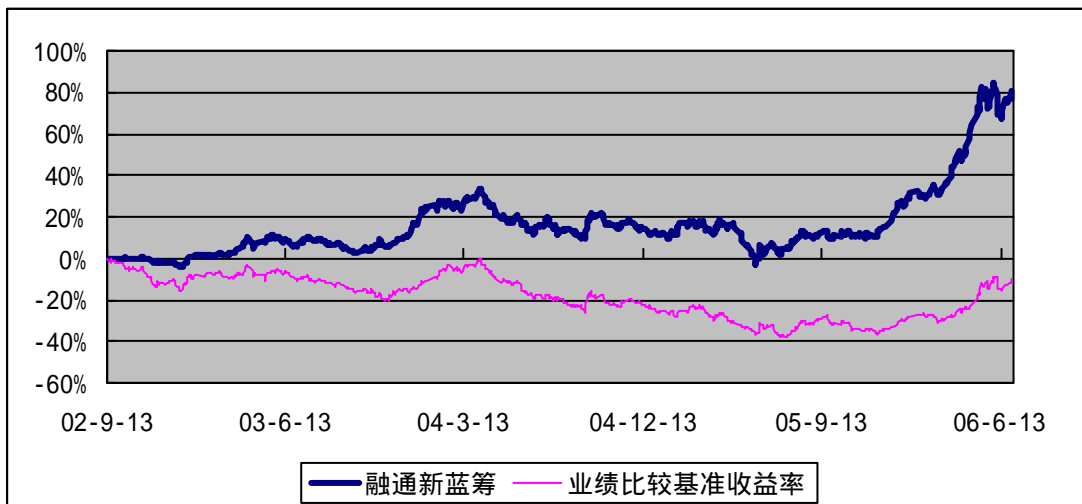
项目	2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日
基金本期净收益	319,583,453.02
加权平均基金份额本期净收益	0.3686
期末可供分配基金收益	185,675,599.91
期末可供分配基金份额收益	0.2446
期末基金资产净值	1,092,217,427.18
期末基金份额净值	1.4386
基金加权平均净值收益率	30.04%
本期基金份额净值增长率	49.37%
基金份额累计净值增长率	80.79%

(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 (由于本基金只规定了股票投资部分的比较基准是“国泰君安指数”，为便于基金历史业绩与比较基准的比较，参照其他多数基金业绩比较基准的设定方式，以国泰君安指数收益率×75%+全国银行间债券指数×25%作为图示的比较基准。)

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 1 个月	0.40%	1.59%	1.24%	1.33%	-0.84%	0.26%
过去 3 个月	25.04%	1.57%	24.38%	1.40%	0.66%	0.17%
过去 6 个月	49.37%	1.28%	33.98%	1.16%	15.39%	0.12%
过去 1 年	72.04%	1.05%	36.17%	1.07%	35.87%	-0.02%
过去 3 年	70.55%	0.99%	-0.09%	1.03%	70.64%	-0.04%
自基金合同生效起至今	80.79%	0.91%	-10.18%	1.01%	90.97%	-0.10%

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



### 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、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2006年6月底，公司管理的基金共有七只，两只为封闭式基金：基金通乾和基金通宝，五只为开放式基金：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指数基金和融通易支付货币市场基金，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

刘模林，1969年出生，华中理工大学机械工程硕士。具有12年证券从业经验，曾任武汉市信托投资公司证券总部研究部经理、花桥证券营业部经理；融通基金管理有限公司研究策划部策略和行业研究员、总监、机构理财部总监；现同时担任基金管理部总监、通宝证券投资基金基金经理。

#### (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、《融通新蓝筹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、上半年市场回顾

2006年上半年A股市场表现强劲，上证指数上涨44.02%。股权分置改革持续快速推进，保护公众股东权益的安排，获利示范效应加快了长线资金的介入；A股市场与全球金融市场的联动更为紧密，在年初整体估值吸引力良好的背景下，资源和成长成为投资主线，有色金属、金融地产、商业、国防军工和装备制造业等先后强劲表现。六月份开始，随着整体估值水平的提高和融资开闸，对经济调控措施出台的担忧，市场进入强势振荡和分化行情。

五月份A股市场实现了从封闭到开放系统的转变，IPO和再融资正式进入实施操作。A股市场的国际化接轨迈出了最重要的一步。

《国家中长期科学技术发展纲要》、建立创新型国家的发展战略的出台，提升了市场对于经济持续发展预期，也给相关领域上市公司带来良好的市场表现。上半年中国经济增长速度创出多年新高，6月份开始针对投资和信贷规模过快增长的调控预期逐渐增强。

报告期新蓝筹基金净值增长49.37%。贯彻精选优质成长股的思路，围绕先进制造和服务类资产进行了局部调整，增持了电力设备、机床等资产，减持了成长能力不足和股价可能充分已反映的资产；部分服务类资产则表现出一定的防御特征。本基金坚持寻找能干的成长公司为主的策略，但错过了分享有色金属股的机会。

##### 2、市场展望

我们认为A股市场适应新的运行规则和全流通环境刚刚开始。新股发行和非流通股份上市，推动股价上涨的力量将从股改和估值中枢提升转为价值挖掘和分享为基础。新股上市带来新的资产选择，市场融资效率的改善、金融创新、整体上市和实质性重组加快，优质成长公司反复带来投资机会。我们看好经济增长质量和盈利状况的提升，而控制投资和信贷规模的宏观调控措施可能加强，对投资类资产预期可能带来影响。

新蓝筹基金将贯彻精选优质成长股的策略，专注于具有战略价值和长期潜力的资产。挖掘自主创新的先进制造业和现代服务业等领域中，具备核心竞争优势、持续成长能力且定价

合理的优秀公司。秉承更趋稳健的策略，实现良好的持续回报。

#### 四、托管人报告

中国建设银行根据《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》和《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》，托管融通新蓝筹证券投资基金（以下简称融通新蓝筹基金）。

本报告期，中国建设银行在融通新蓝筹基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在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。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人—融通基金管理有限公司在融通新蓝筹基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

由融通新蓝筹基金管理人—融通基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

#### 五、财务会计报告（未经审计）

##### （一）会计报表

##### 融通新蓝筹证券投资基金

##### 资产负债表

二〇〇六年六月三十日

单位：人民币元

	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款		149,578,880.66	85,894,565.32
清算备付金		1,643,031.22	1,152,810.39
交易保证金		737,187.48	140,741.00
应收证券清算款		11,116,349.03	--
应收股利		1,284,474.51	--
应收利息	5(1)	3,389,683.55	4,244,967.31
应收申购款		687,664.00	100,030,997.50
其他应收款		--	--
股票投资市值		790,068,594.23	685,010,429.42
其中：股票投资成本		599,097,816.79	599,154,554.50
债券投资市值		226,595,065.00	274,444,989.70
其中：债券投资成本		224,504,155.34	268,828,710.00
权证投资		3,835,531.45	--
其中：权证投资成本		--	--
买入返售证券		--	--
待摊费用		--	--
其他资产		--	--

资产总计		1,188,936,461.13	1,150,919,500.64
负债:			
应付证券清算款		35,111,571.03	18,842,437.05
应付赎回款		4,053,432.34	2,046,402.44
应付赎回费		12,240.97	6,179.96
应付管理人报酬		1,304,096.61	1,139,760.14
应付托管费		217,349.44	189,960.07
应付佣金	5(3)	991,572.88	430,024.27
应付利息		62,690.18	15,241.58
应付收益		--	--
其它应付款	5(4)	285,353.05	33,564.34
卖出回购证券款		54,500,000.00	44,200,000.00
预提费用	5(5)	180,727.45	100,000.00
其他负债		--	--
负债合计		96,719,033.95	67,003,569.85
持有人权益:			
实收基金	5(6)	759,233,719.99	1,063,691,250.84
未实现利得	5(7)	147,308,107.28	99,053,862.62
未分配收益		185,675,599.91	-78,829,182.67
持有人权益合计		1,092,217,427.18	1,083,915,930.79
负债及持有人权益总计		1,188,936,461.13	1,150,919,500.64
基金份额净值		1.4386	1.0190

所附附注为本会计报表的组成部分

融通新蓝筹证券投资基金

经营业绩表

自二〇〇六年一月一日至二〇〇六年六月三十日止期间

单位: 人民币元

	附注	2006年1月1日 至2006年6月30日	2005年1月1日 至2005年6月30日
一、收入		329,551,938.41	-76,030,968.08
1、股票差价收入	5(8)	301,982,203.38	-85,682,879.24
2、债券差价收入	5(9)	14,878.02	-3,254,927.71
3、权证差价收入	5(10)	17,058,777.37	--
4、债券利息收入		3,186,902.26	3,341,369.04
5、存款利息收入		489,634.28	512,150.91
6、股利收入		5,390,539.24	8,678,426.04
7、买入返售证券收入		--	--
8、其他收入	5(11)	1,429,003.86	374,892.88
二、费用		9,968,485.39	9,891,013.22
1、基金管理人报酬		7,958,533.49	8,144,512.77
2、基金托管费		1,326,422.32	1,357,418.84
3、卖出回购证券支出		484,481.60	219,653.00

4、利息支出		--	--
5、其他费用	5(12)	199,047.98	169,428.61
其中：上市年费		--	--
信息披露费		131,138.88	104,136.54
审计费用		49,588.57	49,588.57
三、基金净收益		319,583,453.02	-85,921,981.30
加：未实现利得		105,425,063.93	8,284,968.81
四、基金经营业绩		425,008,516.95	-77,637,012.49

所附附注为本会计报表的组成部分

融通新蓝筹证券投资基金

收益分配表

自二〇〇六年一月一日至二〇〇六年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2006年1月1日 至2006年6月30日	2005年1月1日 至2005年6月30日
本期基金净收益		319,583,453.02	-85,921,981.30
加：期初基金净收益		-78,829,182.67	-7,252,844.52
加：本期损益平准金		4,946,790.82	5,169,947.72
可供分配基金净收益		245,701,061.17	-88,004,878.10
减：本期已分配基金净收益	5(13)	60,025,461.26	--
期末基金净收益		185,675,599.91	-88,004,878.10

所附附注为本会计报表的组成部分

融通新蓝筹证券投资基金

净值变动表

自二〇〇六年一月一日至二〇〇六年六月三十日止期间

单位：人民币元

	附注	2006年1月1日 至2006年6月30日	2005年1月1日 至2005年6月30日
一、期初基金净值		1,083,915,930.79	1,185,022,114.17
二、本期经营活动：			
基金净收益		319,583,453.02	-85,921,981.30
未实现利得		105,425,063.93	8,284,968.81
经营活动产生的基金净值变动数		425,008,516.95	-77,637,012.49
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		357,599,182.96	15,964,199.34
基金赎回款		-714,280,742.26	-172,057,893.62
基金份额交易产生的基金净值变动数		-356,681,559.30	-156,093,694.28
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		-60,025,461.26	--
五、期末基金净值		1,092,217,427.18	951,291,407.40

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. 基金的基本情况

融通新蓝筹证券投资基金（简称“本基金”）经中国证监会证监基金字[2002]41 号文件“关于同意融通新蓝筹证券投资基金设立的批复”核准发售，基金合同生效日为 2002 年 9 月 13 日。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 2,218,864,742.31 份基金单位。本基金的管理人为融通基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行。《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》、《融通新蓝筹证券投资基金招募说明书》等文件已按规定报送中国证监会备案。

附注 2. 主要会计政策及会计估计

本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

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
河北证券有限责任公司（“河北证券”）	管理人股东
联合证券有限责任公司（“联合证券”）	管理人股东、代销机构
陕西省国际信托投资股份有限公司	管理人股东
华林证券有限责任公司	管理人股东
融通基金管理有限公司	管理人、注册登记人、销售机构
中国建设银行	托管人、代销机构

本报告期内关联方关系未发生变化。

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

A 股票买卖

关联方名称	2006年1月1日 至 2006 年 6 月 30 日		2005年1月1日 至 2005 年 6 月 30 日	
	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
联合证券	631,831,245.43	26.95%	280,152,720.54	20.20%

B 债券买卖

关联方名称	2006年1月1日 至 2006 年 6 月 30 日		2005年1月1日 至 2005 年 6 月 30 日	
	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例	本期成交金额	占本期该类交易成交总金额比例
联合证券	--	--	18,582,453.00	8.63%

C 佣金

关联方名称	2006年1月1日 至 2006 年 6 月 30 日		2005年1月1日 至 2005 年 6 月 30 日	
	金额	占本期佣金总金额比例	金额	占本期佣金总金额比例
联合证券	494,411.04	26.17%	220,860.31	19.72%

本基金2006年上半年和2005年上半年无通过关联方席位进行证券回购及权证买卖交易。

上述佣金按市场佣金率计算，并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) 关联方报酬

A 基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币7,958,533.49元(2005年度同期：人民币8,144,512.77元)。

B 基金托管人报酬

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币1,326,422.32元(2005年度同期：人民币1,357,418.84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建设银行保管，并按银行间同业存款利率计息，由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下：

	2006年6月30日	2005年6月30日
银行存款余额	149,578,880.66	96,440,174.24

	2006年1月1日至2006年6月30日	2005年1月1日至2005年6月30日
银行存款产生的利息收入	472,054.50	499,363.48

(5) 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金于2006年上半年和2005年上半年未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

(6) 各关联方投资本基金情况

A. 基金管理公司期末持有本基金份额的情况

本基金管理人于2006年上半年和2005年上半年未持有本基金份额。

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

本基金管理人的主要股东及其控制的机构于2006年上半年及2005年上半年未持有本基金份额。

附注5. 基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

项目	2006年6月30日
应收银行存款利息	28,043.55
应收清算备付金利息	739.30

应收权证保证金利息	63.30
应收债券利息	3,360,837.40
合计	3,389,683.55

## (2) 投资估值增值

项目	2006年6月30日
股票估值增值	190,970,777.44
债券估值增值	2,090,909.66
权证估值增值	3,835,531.45
合计	196,897,218.55

## (3) 应付佣金

项目	2006年6月30日
应付兴业证券佣金	51,770.24
应付东吴证券佣金	165,724.98
应付平安证券佣金	120,746.69
应付联合证券佣金	231,450.56
应付中金公司佣金	155,655.99
应付民生证券佣金	36,986.79
应付国泰君安证券佣金	140,489.84
应付国金证券佣金	88,747.79
合计	991,572.88

## (4) 其他应付款

项目	2006年6月30日
应付后端申购费	3,310.67
应付企业债税金	7,838.38
应付可转债税金	23,779.00
债券交易结算服务费	300.00
债券交易手续费	125.00
交易保证金	250,000.00
合计	285,353.05

## (5) 预提费用

项目	2006年6月30日
信息披露费	131,138.88
审计费用	49,588.57
合计	180,727.45

## (6) 实收基金

项目	2006年1月1日至6月30日
期初数	1,063,691,250.84
加: 本期因申购的增加数	282,083,059.13
减: 本期因赎回的减少数	586,540,589.98
期末数	759,233,719.99

## (7) 未实现利得

项目	2006年1月1日至6月30日
----	-----------------

期初数	99,053,862.62
加：投资估值增值	105,425,063.93
加：未实现利得平准金	-57,170,819.27
其中：未实现利得平准金—申购	58,737,397.83
未实现利得平准金—赎回	-115,908,217.10
期末数	147,308,107.28

(8) 股票差价收入

项目	2006年1月1日至6月30日
卖出股票成交总额	1,359,825,580.38
卖出股票成本总额	1,056,700,977.26
应付佣金	1,142,399.74
股票差价收入	301,982,203.38

注：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的现金对价共计 1,479,544.19元，已全额冲减股票投资成本。

(9) 债券差价收入

项目	2006年1月1日至6月30日
卖出债券及债券到期兑付收到金额	236,939,978.51
减：债券及债券到期成本总额	230,717,180.13
减：应收利息总额	6,207,920.36
债券差价收入	14,878.02

(10) 权证差价收入

项目	2006年1月1日至6月30日
卖出权证成交总额	17,058,777.37
减：卖出权证成本总额	--
权证差价收入	17,058,777.37

(11) 其他收入

项目	2006年1月1日至6月30日
赎回费	1,429,003.86
合计	1,429,003.86

(12) 其他费用

项目	2006年1月1日至6月30日
银行费用	4,470.50
信息披露费	131,138.88
审计费用	49,588.57
回购交易费用	4,425.03
债券账户维护费	9,000.00
债券结算服务费	300.00
债券交易手续费	125.00
合计	199,047.98

(13) 本期已分配基金净收益

	分红公告日	权益登记日	每 10 份基金份额 分配收益	收益分配总金额
第一次分红	2006-5-29	2006-5-26	0.80	60,025,461.26

累计收益分配金额			0.80	60,025,461.26
----------	--	--	------	---------------

附注6. 流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 本基金截止 2006 年 6 月 30 日止, 持有以下新股发行网下获配部分股票:

名称	数量(股)	总成本	总市值	估值方法	受限原因	受限期限
中国银行	598,913	1,844,652.04	1,844,652.04	成本估值	未上市流通	2006/10/09
中国银行	598,913	1,844,652.04	1,844,652.04	成本估值	未上市流通	2007/01/05
云南盐化	88,006	642,443.80	1,161,679.20	市价估值	未上市流通	2006/9/27

(2) 本基金截止 2006 年 6 月 30 日止, 持有以下因股权分制改革而暂时停牌的股票, 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	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
方案沟通协商阶段停牌:								
600383	金地集团	2006/3/27	8.57	2006/7/11	9.43	10,000	52,104.47	85,700.00
600415	小商品城	2006/6/19	63.27	2006/7/04	57.05	680,442	30,711,372.19	43,051,565.34
方案实施阶段停牌:								
600315	上海家化	2006/6/14	16.98	2006/7/24	13.73	2,000	12,469.97	33,960.00
000616	亿城股份	2006/6/21	6.91	2006/7/18	6.17	572,704	4,888,924.69	3,957,384.64
合计							35,664,871.32	47,128,609.98

## 六、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	149,578,880.66	12.58%
清算备付金	1,643,031.22	0.14%
股票投资市值	790,068,594.23	66.45%
债券投资市值	226,595,065.00	19.06%
权证投资市值	3,835,531.45	0.32%
其他资产	17,215,358.57	1.45%
资产合计	1,188,936,461.13	100.00%

### (二) 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	37,614,406.25	3.44%
C 制造业	337,852,035.74	30.94%
C0 食品、饮料	21,945,383.54	2.01%
C1 纺织、服装、皮毛	--	--
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	2,190,325.06	0.20%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	61,246,739.50	5.61%
C5 电子	--	--
C6 金属、非金属	64,721,224.14	5.93%
C7 机械、设备、仪表	150,407,563.60	13.77%

C8 医药、生物制品	37,340,799.90	3.42%
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	104,796,460.72	9.59%
H 批发和零售贸易	42,030,633.90	3.85%
I 金融、保险业	88,894,412.45	8.14%
J 房地产业	4,043,084.64	0.37%
K 社会服务业	64,012,945.57	5.86%
L 传播与文化产业	64,226,793.62	5.88%
M 综合类	46,597,821.34	4.27%
合计	790,068,594.23	72.34%

## (三) 本报告期末股票投资明细

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	600036	G 招 行	9,972,647	76,889,108.37	7.04%
2	600271	G 航 信	2,187,122	65,635,531.22	6.01%
3	600037	G 歌华	4,357,313	64,226,793.62	5.88%
4	000069	G 华侨城	5,561,507	64,012,945.57	5.86%
5	600309	G 万 华	4,221,571	61,212,779.50	5.60%
6	000410	G 沈 机	3,254,235	44,940,985.35	4.11%
7	600415	小商品城	680,442	43,051,565.34	3.94%
8	600320	G 振 华	2,101,505	41,483,708.70	3.80%
9	600406	国电南瑞	1,430,275	39,160,929.50	3.59%
10	600028	中国石化	6,018,305	37,614,406.25	3.44%
11	000039	G 中 集	2,033,700	32,742,570.00	3.00%
12	000970	G 三 环	2,202,153	27,262,654.14	2.50%
13	600739	G 成 大	2,038,452	24,216,809.76	2.22%
14	000623	G 敖 东	1,350,000	22,923,000.00	2.10%
15	002046	轴研科技	1,161,620	18,260,666.40	1.67%
16	600361	G 综 超	986,369	17,813,824.14	1.63%
17	000858	G 五粮液	1,161,707	16,891,219.78	1.55%
18	600316	洪都航空	380,000	13,197,400.00	1.21%
19	000400	G 许 继	1,515,143	11,348,421.07	1.04%
20	000538	G 云白药	301,962	8,741,799.90	0.80%
21	000001	深发展A	1,100,000	8,316,000.00	0.76%
22	600312	G 平 高	679,602	8,155,224.00	0.75%
23	600268	G 南 自	449,874	6,860,578.50	0.63%
24	600276	G 恒 瑞	240,000	5,676,000.00	0.52%
25	600001	G 邯 钢	1,200,000	4,716,000.00	0.43%
26	000616	亿城股份	572,704	3,957,384.64	0.36%
27	000869	G 张 裕	103,496	3,892,484.56	0.36%

28	600761	G 合 力	253,474	3,731,137.28	0.34%
29	601988	中国银行	1,197,826	3,689,304.08	0.34%
30	600858	G 银 座	221,641	3,546,256.00	0.32%
31	000951	G 重 汽	169,293	2,400,574.74	0.22%
32	000910	G 大 亚	202,433	2,190,325.06	0.20%
33	002053	云南盐化	88,006	1,161,679.20	0.11%
34	600383	金地集团	10,000	85,700.00	0.01%
35	600315	上海家化	2,000	33,960.00	0.00%
36	600150	G 重 机	1,308	28,867.56	0.00%

(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	600320	G 振 华	91,283,568.06	8.42%
2	600037	G 歌 华	78,506,951.13	7.24%
3	600036	G 招 行	70,651,131.96	6.52%
4	600028	中国石化	60,564,788.83	5.59%
5	000069	G 华侨城	53,273,623.81	4.91%
6	000970	G 三 环	44,405,045.11	4.10%
7	000866	扬子退市	38,630,188.45	3.56%
8	000410	G 沈 机	38,398,530.67	3.54%
9	600415	小商品城	30,711,372.19	2.83%
10	000039	G 中 集	30,615,390.23	2.82%
11	000858	G 五粮液	29,590,533.24	2.73%
12	600900	G 长 电	26,711,212.10	2.46%
13	600406	国电南瑞	25,462,016.40	2.35%
14	000063	G 中 兴	24,899,256.56	2.30%
15	000768	G 西 飞	22,093,198.94	2.04%
16	600030	G 中 信	20,549,453.34	1.90%
17	000623	G 敖 东	20,502,409.11	1.89%
18	600016	G 民 生	20,379,674.14	1.88%
19	600361	G 综 超	20,273,542.05	1.87%
20	600879	G 火 箭	19,407,550.52	1.79%

(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	600320	G 振 华	170,976,454.05	15.77%
2	600028	中国石化	131,269,949.02	12.11%
3	600036	G 招 行	94,461,166.22	8.71%
4	000063	G 中 兴	77,105,479.47	7.11%
5	000069	G 华侨城	74,201,968.47	6.85%
6	600037	G 歌 华	71,332,954.57	6.58%
7	600309	G 万 华	68,127,221.27	6.29%
8	600879	G 火 箭	53,537,645.63	4.94%

9	600030	G 中 信	52,681,621.28	4.86%
10	600348	G 国 阳	52,674,055.02	4.86%
11	000866	扬子退市	44,803,603.27	4.13%
12	000970	G 三 环	44,636,038.77	4.12%
13	000024	G 招商局	33,725,349.09	3.11%
14	000951	G 重 汽	28,210,441.74	2.60%
15	600900	G 长 电	26,975,220.09	2.49%
16	600085	G 同仁堂	26,891,366.69	2.48%
17	600428	G 中 远	21,814,430.79	2.01%
18	600050	G 联 通	21,341,119.75	1.97%
19	600016	G 民 生	20,512,965.06	1.89%
20	000768	G 西 飞	18,419,916.36	1.70%

(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	1,058,123,783.74
卖出股票的收入总额	1,359,825,580.38

(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	226,595,065.00	20.75%
合计	226,595,065.00	20.75%

(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 (14)	156,688,497.00	14.35%
21 国债 (3)	59,385,064.00	5.44%
04 国债 (11)	10,521,504.00	0.96%

(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股票。

(3) 其他资产：

项目	金 额 (元)
交易保证金	737,187.48
应收证券清算款	11,116,349.03
应收股利	1,284,474.51
应收利息	3,389,683.55
应收申购款	687,664.00
合计	17,215,358.57

(4) 处于转股期的可转换债券明细

本报告期末没有处于转股期的可转换债券

(5) 权证投资情况

权证名称	获配权证数量 (份)	成本总额 (元)	期间卖出数量 (份)	卖出差价收入 (元)
招行 CMP1	9,461,493	--	9,461,493	5,564,984.14
万华 HXB1	878,848	--	561,521	6,829,829.59
万华 HXP1	1,318,271	--	1,318,271	3,956,372.26

钾肥 JTP1	244,000	--	244,000	707,591.38
---------	---------	----	---------	------------

注：本基金报告期内投资的以上权证均源于股权分置改革中对价支付所获配部分，非本基金主动投资。

(6) 本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

项目	2006 年 6 月 30 日
持有人户数(户)	13,639
平均每户持有基金份额(份)	55,666.38
机构投资者持有份额(份)	535,677,089.08
机构投资者占总份额比例	70.55%
个人投资者持有份额(份)	223,556,630.91
个人投资者占总份额比例	29.45%

#### 八、开放式基金份额变动

项目	基金份额(份)
基金合同生效日基金份额	2,218,864,742.31
本期期初基金份额	1,063,691,250.84
本期总申购份额	282,083,059.13
本期总赎回份额	586,540,589.98
本期期末基金份额	759,233,719.99

#### 九、重大事项揭示

- (一) 本报告期末未召开基金份额持有人大会。
- (二) 本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
- (三) 本基金管理人、基金财产、基金托管业务在本报告期内无诉讼事项。
- (四) 本基金投资策略在本报告期末未发生改变。
- (五) 本基金本报告期内收益分配情况如下：

融通新蓝筹证券投资基金			
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 年 5 月 29 日	2006 年 5 月 26 日	0.80 元	中国证券报、上海证券报、 证券时报

(六) 本基金在报告期内未改聘为其审计的会计师事务所。

(七) 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。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况：

本基金管理人选择代理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)、资历雄厚，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。

本基金管理人选择代理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。

本基金管理人选定的专用交易席位券商分别是：河北证券有限责任公司、联合证券有限责任公司、兴业证券股份有限公司、平安证券有限责任公司、东吴证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、世纪证券有限责任公司、国金证券有限责任公司、民生证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司和长江证券有限公司。其中长江证券有限公司为本报告期内新增席位券商。

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)	占本期股票 总成交金额比例	席位佣金金额(元)	占本期佣金 总额比例
河北证券	2	--	--	--	--
兴业证券	1	63,134,962.28	2.69%	51,770.24	2.74%
东吴证券	1	364,422,750.36	15.54%	297,595.89	15.76%
平安证券	2	166,141,988.38	7.09%	130,006.29	6.88%
联合证券	2	631,831,245.43	26.95%	494,411.04	26.17%
中金公司	1	248,950,681.61	10.62%	203,062.77	10.75%
世纪证券	1	--	--	--	--
民生证券	1	466,770,654.87	19.91%	382,313.84	20.24%
国泰君安	1	294,934,800.85	12.58%	240,986.21	12.76%
国金证券	1	108,702,865.92	4.64%	88,747.79	4.70%
长江证券	1	--	--	--	--
合计	14	2,344,889,949.70	100.00%	1,888,894.07	100.00%

(2) 债券、债券回购及权证交易情况：

券商名称	债券成交金额 (元)	占本期债券 总成交金额 比例	债券回购成交 金额(元)	占本期回 购 总成交金 额 比例	权证成交金额 (元)	占本期权 证总成交 金额比例
河北证券	--	--	--	--	--	--
兴业证券	--	--	--	--	--	--
东吴证券	63,062,109.30	28.97%	59,500,000.00	31.40%	--	--
平安证券	--	--	--	--	707,662.16	4.15%
联合证券	--	--	--	--	--	--
中金公司	67,187,767.80	30.87%	40,000,000.00	21.11%	10,787,037.96	63.23%
世纪证券	--	--	--	--	--	--

民生证券	12,200,209.30	5.60%	40,000,000.00	21.11%	5,565,415.44	32.62%
国泰君安	66,438,794.80	30.52%	20,000,000.00	10.55%	--	--
国金证券	8,785,516.90	4.04%	30,000,000.00	15.83%	--	--
长江证券	--	--	--	--	--	--
合计	217,674,398.10	100%	189,500,000.00	100%	17,060,115.56	100.00%

(九) 其他重大事项

(1) 从2006年5月22日起, 本公司开通“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。

(2) 从2006年2月13日起, 国都证券有限责任公司代理本公司旗下所有开放式基金的销售业务。包括融通新蓝筹证券投资基金的销售业务。具体内容请参阅2006年2月13日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上的公告。

十、备查文件目录

- (一) 中国证监会批准融通新蓝筹证券投资基金设立的文件;
- (二) 《融通新蓝筹证券投资基金基金合同》;
- (三) 《融通新蓝筹证券投资基金托管协议》;
- (四) 《融通新蓝筹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) 中国建设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

2006年8月25日