

融通通利系列证券投资基金 2006 年年度报告摘要

一、重要提示

本基金为契约型开放式证券投资基金，融通深证 100 指数证券投资基金和融通蓝筹成为其子基金。

基金管理人的董事局及董事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的完整性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基民托管人中国工商银行股份有限公司根据本系列基金合同的规定，于 2007 年 3 月 16 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。投资人应详阅基金定期报告，作出投资决策前仔细阅读本系列基金的招募说明书。

本年度报告摘要能摘要年度报告正文，投资者欲了解详细内容，阅读年度报告正文。

二、基金简介

（一）基金基本情况

本基金为融通通利系列基金，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、融通货币市场基金代码 161605；融通深证 100 指数基金交易代码 161604；融通蓝筹成长基金运作方式为契约型开放式。

基金合同生效日：2003 年 9 月 30 日

基金份额净值总额：

融通债券基金 214,732,687.42 分

融通深证 100 指数基金 533,327,971.02 分

融通蓝筹成长基金 282,241,429.58 分

基金份额合同存续期：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：在锁定基金资产的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。

投资策略：通过资产配置策略，利用收益曲线模型和资金品种定价模型，在获取较好的稳定收益的基础上，实现基金资产的保值增值。

业绩比较基准：各银行间市场的银行间债券综合指数。

风险收益特征：属于相对风险的债券型基金。

2、融通深证 100 指数基金

投资目标：运用指数化投资方式，通过对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，谋取分享中国经济的持续、稳定的增长中中国证券市场的发展，实现基金资产的长期增长，为客户提供稳定的回报。

投资策略：强调通过基本面分析选股的成份股进行股票指数化投资。股票指数化投资分析主要基于基金资产的 100%采用恒定比例混合策略，100%因应股票指数变化×5%。

业绩比较基准：深证 100 指数收益率×95%+银行间同业存款利率×5%。

风险收益特征：风险和预期收益率均居于市场平均水平。

3、融通蓝筹成长基金

投资目标：结合行业分析，博取本年度内各行业的投资收益。

投资策略：在对行业趋势进行研究的前提下，重视仓位选择和行业配置，同时更重视基本面分析，强调通过基本面分析挖掘个股。

业绩比较基准：75%×国君安泰指数+25%×银行间同业综合指数。

风险收益特征：为获得超过市场平均的收益，承担相应的风险。

（三）收益分配情况（最近三年）

1、融通债券基金

每 10 份基金份额分红数 收益分配总金额

2006 年度 1.040 29,928,674.42

2005 年度 0.300 8,837,348.25

2004 年度 0.410 27,378,651.43

合计 1.750 66,144,674.11

2、融通深证 100 指数基金

每 10 份基金份额分红数 收益分配总金额

2006 年度 3.000 137,815,546.52

2005 年度 —— ——

2004 年度 1.500 56,776,894.47

合计 4.500 194,592,440.99

3、融通蓝筹成长基金

每 10 份基金份额分红数 收益分配总金额

2006 年度 1500 68,386,235.63

2005 年度 —— ——

2004 年度 1020 81,994,052.00

合计 2520 150,390,365.65

四、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

名称：融通基金管理有限公司（以下简称“中国工商银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行托管部

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行托管部

联系人：陈军

电话：(010) 66109012

传真：(010) 66106004

电子信箱：wuyip@mail.fund.com.cn

（四）基金托管概况

名称：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）

住所：北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行托管部

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行托管部

联系人：陈军

电话：(010) 66109012

传真：(010) 66106004

电子信箱：custody@cboc.com.cn

（五）基金销售机构

名称：华泰柏瑞基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1000 号

联系人：王海峰

电话：(021) 58753888

传真：(021) 58753889

电子信箱：service@htfund.com

（六）基金上市交易情况

名称：融通深证 100 指数基金

上市地：深圳证券交易所

上市时间：2004 年 12 月 2 日

交易状态：正常交易

（七）基金净值表现

1、基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表

融通债券基金

项目 2006 年度 2005 年度 2004 年度

基金本期净收益 40,491,510,688 12,110,167,585 34,408,341.13

加权平均基金份额本期净收益 0.1546 0.0404 0.0657

期末可供分配基金份额 0.0651 0.0342 -0.0142

期末基金资产净值 228,706,097.48 310,474,036.03 373,258,871.21

期末基金份额净值 1.065 1.034 0.996

本期基金份额净值增长率 13.75% 9.73% 0.17%

融通深证 100 指数基金

项目 2006 年度 2005 年度 2004 年度

基金本期净收益 283,029,865.61 -84,696,994.90 39,808,236.22

加权平均基金份额本期净收益 0.5031 -0.0864 0.0513

期末可供分配基金份额 0.1602 -0.1981 -0.1869

期末基金资产净值 713,466,689.45 674,227,284.72 859,247,739.65

期末基金份额净值 1.336 0.802 0.814

本期基金份额净值增长率 117.23% -1.47% -9.56%

融通蓝筹成长基金

项目 2006 年度 2005 年度 2004 年度

基金本期净收益 296,699,884.68 -23,262,107.99 51,217,251.47

加权平均基金份额本期净收益 0.6784 -0.0375 0.0591

期末可供分配基金份额 0.4860 -0.0582 -0.0560

期末基金资产净值 473,852,597.39 728,969,096.48 657,295,605.65

期末基金份额净值 1.679 1.031 0.945

本期基金份额净值增长率 83.08% 9.10% -0.46%

（八）基金净值表现

1、基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表

融通债券基金

阶段 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率标准差

过去 3 个月 2.70% 0.13% 0.76% 0.03%

过去 6 个月 3.50% 0.10% 1.30% 0.02%

过去 1 年 13.75% 0.23% 3.07% 0.17%

过去 3 年 22.98% 0.23% 10.08% 0.13%

自基金合同生效起至今 25.92% 0.23% 10.96% 0.13%

融通深证 100 指数基金

阶段 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率标准差

过去 3 个月 3.76% 0.14% 1.07% 0.04%

过去 6 个月 5.72% 0.12% 1.87% 0.03%

过去 1 年 11.73% 0.18% 2.03% 0.05%

过去 3 年 29.35% 0.17% 27.20% 0.05%

自基金合同生效起至今 30.17% 0.18% 27.98% 0.05%

融通蓝筹成长基金

阶段 净值增长率标准差 业绩比较基准收益率标准差

过去 3 个月 1.49% 0.19% 1.98% 0.08%

过去 6 个月 2.43% 0.19% 2.08% 0.08%

过去 1 年 12.15% 0.21% 12.80% 0.09%

过去 3 年 35.00% 0.21% 33.95% 0.09%

自基金合同生效起至今 35.80% 0.21% 34.73% 0.09%

（九）基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图

3. 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

4. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

5. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

6. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

7. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

8. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

9. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

10. 基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

11. 基