融通新蓝筹证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

2007年第 2 号

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

重要提示

融通新蓝筹证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]41 号文核准公开发售。核准日期为 2002 年 7 月 25 日。本基金为契约型开放式基金，基金合同生效日为 2002 年 9 月 13 日。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书所载内容截止日为 2007 年 9 月 13 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2007 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

一、基金合同生效日期

2002 年 9 月 13 日

二、基金管理人

（一）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
设立日期:2001 年 5 月 22 日
法定代表人:孟立坤
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层
电话:0755–26948043
联系人:秦燕

融通基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2001]8 号文核准设立,注册资本为 12500 万元人民币。目前公司股东及出资比例为: 河北证券有限责任公司 40%、日兴资产管理有限公司（Nikko Asset Management Co., Ltd.）40%,新时代证券有限责任公司 20%。

（二）主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

董事长孟立坤先生,工学博士。历任海军工程学院、太原机械学院教师;北京市丰台区科委工程师;河北证券有限责任公司总裁助理。2001 年至今,任融通基金管理有限公司董事长。

独立董事曹凤岐先生,教授。历任北京大学经济系讲师;北京大学经济学院副教授、教授。现任北京大学光华管理学院教授、北京大学金融与证券研究中心主任、国务院学位委员会学科评议组成员、中国金融学会常务理事、北京市金融学会副会长。

独立董事强力先生,教授。现任西北政法学院教授、经济法系副主任、经济法学硕士研究生导师、金融证券法研究中心主任。

独立董事林义相先生,经济学博士学位。1983 年获北京大学经济学学士学位;1989 年获法国巴黎第十大学经济学博士学位。1989 年至 1994 年,就职于法国储蓄与信托银行（CDC）股票部,从事股票投资分析工作;1994 年至 1996 年,就职于中国证券监督管理委员会,历任高级专家、研究信息部副主任、证券交易监控系统负责人;1996 年至 2001 年,任职华夏证券有限公司副总裁;2001 年至今,任职天相投资顾问有限公司董事长兼总经理。

董事 Miyazato Hiroki (宫里启晖) 先生,1993 年毕业于日本东京大学生物理学系，获硕士学位。1993 年至 1994 年，任职瑞士信贷第一波士顿银行东京分行债券交易经理助理;1994 年至 1996 年,任职德国农业中央银行东京分行债券交易经理;1996 年至 1998 年,任职日本长期信用银行总行债券交易基金经理;1998 年至 1999 年,任职摩根大通银行东京分行外汇交易全球市场主管;1999 年至今,任职日兴资产管理有限公司大中华区总监、高级基金经理。

董事 Allen Yan（颜锡廉）先生,2000 年毕业于日本一桥大学商学院,获工商管理硕士学位。2000 年至 2001 年，任职美国富达投资公司财务分析员;2001 年至 2006 年，任职日本富达投资公司财务经理;2006 年至今,任职日兴资产管理有限公司财务企划与分析部部长。

董事马金声先生,高级经济师。历任中国人民银行办公厅副主任、主任,金银管理司司长;中国农业发展银行副行长;国泰君安证券股份有限公司党委书记兼副董事长。

董事吕秋梅女士,工商管理硕士。历任国信证券有限公司总裁助理;鹏华基金管理有限公司副总经理。2001 年至今,历任融通基金管理有限公司常务副总经理、总经理。

董事吴冶平先生,经济学硕士。历任中国银行深圳国际信托咨询公司证券发行部项目经理;深圳市安信财务顾问有限公司上市策划部经理;华夏证券有限公司深圳分公司企业购并部经理;国信证券有限公司投资银行总部副总经理、公司研究部总经理;鹏华基金管理有限公司监事、研究部总监、基金经理助理。2001 年至今,历任融通基金管理有限公司监察稽核部总监、督察长。

2、监事

监事程燕春先生,大学本科,高级经济师。长期在中国建设银行工作,历任中国建设银行南昌市城东支行副行长、中国建设银行总行监察室案件检查处正科级监察员、中国建设银行基金托管部市场处负责人、监管处负责人、信息披露负责人,融通基金管理有限公司总经理助理,融通基金管理有限公司上海分公司总经理。

3、总经理及其它高级管理人员

总经理吕秋梅女士,同上。

副总经理刘模林先生,华中理工大学机械工程硕士。具有 13 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、基金管理部总监,现同时担任融通领先成长股票型证券投资基金基金经理和融通新蓝筹证券投资基金基金经理。

督察长吴冶平先生,同上。

4、本基金基金经理

1）现任基金经理情况

刘模林先生,简历同上。在任职本基金基金经理前,刘模林先生担任通宝证券投资基金基金经理。

戴春平先生,博士研究生,具有 7 年证券从业经验,先后在泰康保险资产管理中心、鹏华基金管理公司、中国人寿资产管理公司从事交易、研究和投资管理工作,07 年初进入融通基金管理公司,现任机构理财部投资经理。

（2）历任基金经理情况

自 2002 年 9 月 13 日至 2004 年 7 月 20 日期间,由詹凌蔚先生担任本基金基金经理。

自 2004 年 7 月 21 日起至 2007 年 9 月 27 日期间,由刘模林先生担任本基金基金经理。

自 2007 年 9 月 28 日起至今,由刘模林先生与戴春平先生共同担任本基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

三、基金托管人

一、基金托管人情况

（一）基本情况

名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所: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
法定代表人:郭树清
成立时间:2004 年 09 月 17 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万元人民币
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12 号
联系人:尹 东
联系电话:(010) 6759 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于 1954 年成立，1996 年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于 2004 年 9 月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行 (股票代号:HK0939)于 2005 年 10 月 27 日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006 年 9 月 11 日,中国建设银行又作为第一家 H 股公司晋身恒生指数。于 2006 年末,中国建设银行市值达 1,429.94 亿美元,跻身于全球十大上市银行之列。截至 2006 年 12 月 31 日止,中国建设银行总资产为人民币 54,485.11 亿元,客户存款为人民币 47,212.56 亿元。2006 年,中国建设银行实现净利润人民币 463.19 亿元,较上年增长 18.02%,每股盈利为人民币 0.21 元,平均资产回报率为 0.92%,平均股东权益回报率为 15%。中国建设银行在中国内地设有 1.4 万余个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约设有代表处。2006 年 8 月 24 日,中国建设银行在香港与美国银行签署协定,收购美国银行在香港的全资子公司美国银行（亚洲）股份有限公司 100%的股权,并于 2006 年 12 月 29 日完成收购交割,美国银行（亚洲）有限公司更名为“中国建设银行（亚洲）股份有限公司”。中国建设银行在《银行家》2006 年公布的全球银行按一级资本排名中,名列中国银行业榜首,在世界大银行中列第 11 位。中国建设银行在《福布斯》2006 年全球领先企业榜中为第 65 名,列中国第二位。在《亚洲周刊》2006 年 7 月公布的亚洲银行 300 强排名中,中国建设银行在“利息收入净值最高的银行”和“纯利最高的银行”两项排名中均列第一位,被誉为“亚洲最赚钱的银行”。此外,在 2006 年度《亚洲金融》亚洲最佳公司评选中,中国建设银行入选“最佳管理公司”、“最佳公司管治”、“最佳派息承诺”排行榜。

中国建设银行总行设投资托管服务部,下设综合制度处、基金市场处、资产托管处、QFII 托管处、基金核算处、基金清算处、监督稽核处和投资委托托管团队等 8 个职能处室,现有员工 80 余人。

（二）主要人员情况

罗中涛,投资托管服务部总经理,曾就职于国家统计局、中国建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的领导经验。

李春信,投资托管服务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行人事教育部、计划部、筹资储蓄部、国际业务部工作,对商业银行综合经营计划、零售业务及国际业务具有较丰富相关工作经验。

（三）基金托管业务经营情况

截止到 2007 年 6 月 30 日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、通乾、鸿飞、银丰等 8 只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业宝康系列(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置 3 只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华－道琼斯 88 精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝、上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、长城消费增值、华安上证 180ETF、上投摩根双息平衡、泰达荷银效率优选、华夏深圳中小企业板 ETF、交银施罗德稳健配置、华宝兴业收益增长、华富货币市场、工银瑞信精选平衡、鹏华价值优势、中信稳定债券、华安宏利、上投摩根成长先锋、博时价值增长贰号、海富通风格优势、银华富裕主题、华夏优势增长、信诚精萃成长、工银瑞信稳健成长、信达澳银领先增长、诺德价值优势、工银瑞信债券、国泰金鼎价值、富国天博、融通领先成长、华宝兴业行业精选等 51 只开放式证券投资基金。

四、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构:

（1）融通基金管理有限公司深圳投资理财中心
地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦 13、14 层
邮政编码:518053
联系人:张权
联系电话:0755–26948040
传真:0755–26935005
客户服务中心电话:0755–26948088

（2）融通基金管理有限公司北京分公司
地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 1241–1243 室
邮编:100032
联系人:宋雅萍
联系电话:010－66190975
传真:010–88091635?

（3）融通基金管理有限公司上海分公司
地址:上海市浦东南路 588 号浦发大厦 27 层 I、J 单元
邮编:200120
联系人:林文兵
联系电话:021–38424882
传真:021–38424884

2、代销机构:

（1）中国建设银行股份有限公司
注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号
法定代表人: 郭树清
客户服务电话: 95533
网址:www.ccb.cn

（2）交通银行股份有限公司
注册地址: 上海市仙霞路 18 号
法定代表人: 蒋超良
联系人: 王玮
电话: 021–58781234
传真: 021–58408842
客户服务电话: 95559
网址:www.bankcomm.com

（3）深圳发展银行
注册地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦
法定代表人:蓝德彰
联系人: 周勤
电话: 0755–82088888 转 8811
传真: 0755–82080714
客户服务电话: 95501
网址:www.sdb.com.cn

（4）招商银行股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号
法定代表人: 秦晓
联系人: 朱小姐、刘小姐
电话: 0755–83195834、83195771
传真: 0755–83195049
客户服务电话: 95555
网址:www.cmbchina.com

（5）国泰君安证券股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区商城路 618 号
法定代表人: 祝幼一
联系人:芮敏祺
电话: 021–62580818–213
传真: 021–62583439
客户服务电话: 400–8888–666
网址:www.gtja.com

（6）中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街 188 号
法定代表人: 黎晓宏
联系人: 权唐
电话: 010–65186758
传真: 010–65182261
客户服务电话: 400–8888–108（免长途费）
网址:www.csc108.com

（7）国信证券有限责任公司
注册地址: 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16–26 层
办公地址: 深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16–26 层
法定代表人: 何如
联系人: 林建闽
电话: 0755–82130833 转 2181
传真: 0755–82133302
客户服务电话: 800–810–8868
网址:www.guosen.com.cn

（8）招商证券股份有限公司
注册地址: 深圳福田区益田路江苏大厦 38-–45 层
办公地址: 深圳福田区益田路江苏大厦 38-–45 层
法定代表人: 宫少林
联系人: 黄健
电话: 0755–82943511
传真: 0755–82943237
客户服务电话: 4008888111、0755–26951111
网址:www.newone.com.cn

（9）联合证券有限责任公司
注册地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
办公地址: 深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、24、25 层
法定代表人: 马国强
联系人: 盛宗凌
电话: 0755－82493561
传真: 0755－82492187
客户服务电话: 400–8888–555,0755–25125666
网址:www.lhzq.com

（10）长江证券有限责任公司
注册地址: 武汉市新华下路特 8 号
办公地址: 上海汉口路 130 号
法定代表人: 明云成
联系人:毕艇
电话: 027–65799560
传真: 027–85481532
客户服务电话: 027–65799883
网址:www.cz318.com.cn

（11）东吴证券有限责任公司
注册地址: 江苏省苏州市十梓街 298 号
办公地址: 江苏省苏州市十梓街 298 号
法定代表人: 吴永敏
联系人: 方晓丹
电话: 0512–65581136
传真: 0512–65588021
客户服务电话: 0512–96288
网址:www.dwzq.com.cn

（12）广发证券股份有限公司
注册地址: 广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室
办公地址: 广东广州天河北路大都会广场 36、37、41 和 42 楼
法定代表人: 王志伟
联系人: 肖中梅
电话: 020–87555888
传真: 020–87557985
客户服务电话: 020–87555888 转各营业网点
网址:www.gf.com.cn

（13）中国银河证券有限责任公司
注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人: 朱利
联系人: 郭京华
电话: 010–66568587
传真: 010–66568536
客户服务电话: 010–68016655
网址:www.chinastock.com.cn

（14）中信证券股份有限公司
注册地址:深圳市湖贝路 1030 号海龙王大厦
办公地址:北京朝阳区新源南路 6 号京城大厦
法定代表人:王东明
联系人:陈忠
电话: 010–84864818 转 63266
传真: 010–84865560
客户服务电话: 010–84864818–63266
网址:www.ecitic.com

（15）东方证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东大道 720 号 20 楼
办公地址:上海市巨鹿路 756 号
法定代表人:王益民
联系人:盛云
电话: 021–62568800–3019
客户服务电话: 021–962506
网址:www.dfzq.com.cn

（16）山西证券有限责任公司
注册地址:山西省太原市迎泽大街 282 号
办公地址:山西省太原市府西街 69 号
法定代表人:吴晋安
联系人:邹连星、刘文康
电话:0351–8686766、0351–8686708
客户服务电话:0351–8686868
网址:www.i618.com.cn

（17）金通证券股份有限责任公司
注册地址:杭州市凤起路 108 号
法定代表人:应土歌
联系人:胡琦
电话:0571–85783749
传真:0571–85783748
客户服务热线:0571–96598
网址:www.bigsun.com.cn

（18）中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市东海路 28 号
法定代表人:史洁民
联系人:李锦
电话:0532–85023905
传真:0532–85023905
客户服务热线:0532–96577
网址:www.zxwt.com.cn

（19）渤海证券有限责任公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街 29 号
办公地址:天津市河西区宾水道 3 号
法定代表人: 张志军
联系人:徐焕强
电话: 022–28451883
传真: 022–28451892
客户服务热线:022–28455588
网址:www.ewww.com.cn

（20）万联证券有限责任公司
注册地址:东风东路 836 号东峻广场 3 座 34–35 楼
法定代表人:陆景奎
联系人:徐松
电话:020–87693617
传真:020–87691530
网址:www.wlzq.com.cn

（21）民生证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区朝外大街 16 号中国人寿大厦 1901 室
法人代表:岳献春
联系人:杨甦华
电话:010–85252564
传真:010–85252655
客户服务电话:0371–7639999
网址:www.mszq.com

（22）长城证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 楼
法定代表人:魏云鹏
联系人:高峰
电话:0755–83516094
传真:0755–83516199
客户服务电话:0755–82288968
网址:www.cc168.com.cn

（23）光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 15–16 楼
法定代表人:王明权
联系人:刘晨
电话:021–68816000–1587
传真:021–68817271
客户服务电话:021–68816770
网址:www.ebscn.com

（24）平安证券有限责任公司
注册地址:深圳福田区八卦三路平安大厦 3 楼
法定代表人:杨秀丽
联系人:余江
电话:0755–82440136、82450826
传真:0755–82433794
客户服务电话:95511、0755–82440136
网址:www.pa18.com

（25）华安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市阜南路 166 号
法定代表人:汪永平
联系人:唐泳
电话:0551–5161671
传真:0551–5161672
客户服务电话:0551–5161671
网址:www.hazq.com 或 www.huaans.com.cn

（26）国联证券有限责任公司
注册地址:无锡市县前东街 8 号
法定代表人:范炎
联系人:袁丽萍
电话:0510–2831662
传真:0510–2831589
客户服务电话:0510–2588168
网址:www.glsc.com.cn

（27）金元证券有限责任公司
联系地址:深圳市深南大道 4001 号时代金融中心 17 楼
法定代表人:郑辉
联系人:金春
电话:0755–83025695
传真:0755–83025625
网址:www.jyzq.cn

（28）国都证券有限责任公司
联系地址:北京市东城区安外大街安贞大厦 3 层
法定代表人:王少华
业务联系人:马泽承
电话:010–64482828–390
传真:010–64482090
网址:www.guodu.com

（29）第一创业证券有限责任公司
联系地址:深圳市笋岗路中民时代广场 b 座 25 楼
法定代表人:刘学民
业务联系人: 梁少珍
电话:0755–25832493
传真:0755–25831718
网址:www.firstcapital.com.cn

（30）东北证券有限责任公司
联系地址:长春市自由大路 1138 号
法定代表人:李树
业务联系人:高新宇
电话:0431–5096710
传真:0431–5680032
网址:www.nesc.cn

（31）国盛证券有限责任公司
联系地址:江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10–13 楼
法定代表人:管荣升
业务联系人:万齐志
电话:0791–6289771
传真:0791–6289395
网址:www.gsstock.com

（32）宏源证券股份有限公司
联系地址:北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 b 座 6 层
法定代表人:汤世生
业务联系人:张智红
联系电话:010–62267799–6416
传真:010－62294470
网址:www.ehongyuan.com.cn

（33）信泰证券有限责任公司
联系地址:南京市长江路 88 号
法定代表人:钱凯法
业务联系人:舒萌菲
联系电话:025–84784782
传真:025–84784830
网址:www.thope.cn

（34）恒泰证券有限责任公司
联系地址: 呼和浩特市新城区东风路 111 号
法定代表人:刘汝军
业务联系人:魏华
联系电话:0471–4961259
传真:0471–4961259
网址:www.cnht.com.cn

（35）华龙证券有限责任公司
联系地址: 甘肃省兰州市静宁路 138 号
法定代表人:李晓安
业务联系人:王宝国
联系电话:0931–4890068
传真:0931–4890515
网址:www.hlzqgs.com

（36）上海银行
联系地址:上海市中山东二路 585 号
法定代表人:陈辛
业务联系人:张浩
联系电话:021–63371293
传真:021–63370777
网址:www.bankofshanghai.com

（37）兴业证券股份有限公司
联系地址:福州市湖东路 99 号标力大厦
法定代表人:兰荣
业务联系人:杨盛芳
联系电话:021–68419393
传真:021–68419867
网址:www.xyzq.com.cn

(38)中国工商银行
联系地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人:姜建清
业务联系人:田耕
电话:（010）66107900
传真:（010）66107914
网址:www.icbc.com.cn

（二）注册登记人

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
经营范围:基金管理业务;发起设立基金。
存续期间:持续经营
组织形式:有限责任公司
注册资本:12500 万元
联系人:敖敬东
电话:0755–26948070

（三）律师事务所和经办律师

名称:康达律师事务所
注册地址:北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室
办公地址:北京市朝阳区建国门外大街 19 号国际大厦 703 室
法定代表人:傅洋
经办律师:娄爱东、杜玉兰
电话:010－85262828
传真:010－85262826

（四）会计师事务所和经办注册会计师

名称:安永华明会计师事务所
注册地址:北京朝阳区北大街 6 号北海万泰大厦 802—807
办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城东三办公楼 16 层
法定发表人:葛明
经办注册会计师: 谢枫、樊淑华
电话:010–65246688
传真:010–85188298

五、基金名称

融通新蓝筹证券投资基金

六、基金类型

契约型开放式

七、基金的投资目标

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,为基金份额持有人获取长期稳定的投资收益。

八、基金的投资方向

仅限于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于“新蓝筹”组合的股票资产将不低于股票总资产的 80%;同时将根据市场状况调整投资组合,把握投资机会,实现组合的进一步优化。

九、基金的投资策略

（一）决策依据

1. 国家宏观经济环境;
2. 国家有关法律、法规和本基金合同的有关规定;
3. 货币政策、利率走势;
4. 地区及行业发展状况;
5. 上市公司研究;
6. 证券市场的走势。

（二）决策程序

本基金管理人内部设立基金管理部、研究策划部、基金交易部、监察稽核部、投资决策委员会和风险控制委员会,进行基金资产的投资和风险控制。基金管理实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策程序如下:

1、研究策划部提供宏观分析、行业分析、企业分析及市场分析的研究报告,并在此基础上进行投资论证,作出投资建议提交给基金经理,并为投资决策委员会提供资产配置的决策依据。

2、基金经理根据研究策划部提交的投资建议决定本基金下一阶段的仓位和资金分布,形成资产配置提案报投资决策委员会。

3、投资决策委员会审定基金经理提交的资产配置提案,形成资产配置计划书。

4、基金经理根据投资决策委员会的决策,制定相应的投资组合方案并报投资决策委员会备案。对超出基金经理权限的单项投资决策须报投资决策委员会审议批准。

5、基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划,并以投资指令的形式下达至基金交易部。

6、基金交易部依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

7、风险控制委员会根据市场变化对投资组合计划提出风险防范措施。监察稽核部对投资的决策和执行过程进行日常监督,投资组合方案执行完毕,基金经理负责向投资决策委员会提交总结报告。

（三）投资组合

投资组合的原则是追求收益性、流动性和安全性的有机结合。结合本基金的“新蓝筹”投资理念,本基金投资组合在保持基金资产流动性的条件下,将以获取资本增值为主。

本基金可投资于国债、金融债、企业债（包括可转债）和权证,以分散风险以及调节投资于股票可能带来的收益波动,使得基金收益表现更加稳定;同时满足基金资产对流动性的要求。

本基金的投资组合必须符合以下规定:

1、本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的 80%,本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的 20%;

2、本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的 10%;

3、本基金持有的全部权证,其市值不超过基金资产净值的 3%;

4、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%;

5、本基金与由本基金管理人管理的其他基金合计持有的同一权证不得超过该权证流通量的 10%。本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的 0.5%;

6、基金建仓期:自基金开始运作之日起,将在六个月内达到上述第（1）条、“投资范围”中关于投资于新蓝筹企业的比例规定以及“投资策略”中关于股票投资比例浮动范围、债券投资比例浮动范围、现金留存比例浮动范围的有关规定;

7、本基金可投资于资产支持证券。

A、持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例不得超过该资产支持证券规模的 10%。

B、投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例不得超过基金资产净值的 10%。

C、与基金管理人管理的其它基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的 10%。

D、本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过该基金资产净值的 20%。

E、因市场波动、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资资产支持证券不符合上述第 B 项和第 D 项规定的比例,基金管理人将在 10 交易日内调整完毕。

F、投资的资产支持证券须具有评级资质的资信评级机构进行持续信用评级。

G、基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起 3 个月内予以全部卖出。

8、遵守中国证监会规定的其他比例限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素导致投资组合超出上述比例不在限制之内,但基金管理人应在法规规定的期限内进行调整,以达到上述标准。

（四）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%。

1、资产配置

贯彻“自上而下”的投资策略,结合宏观经济状况、资本市场的运行周期确定风险收益互补的股票资产和债券资产的投资比例。

2、行业资产配置

在“新蓝筹”投资理念的指导下,通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识,确定股票资产在不同行业的投资比例。

3、债券选择

分析利率走势和发行人的基本素质,综合考虑利率变动对不同债券品种的影响、各品种的收益率水平、期限结构、信用风险大小、市场流动性因素;另一方面考虑宏观经济数据,包括通货膨胀率、商品价格和 GDP 增长等因素。

4、股票选择

股票投资中将以“新蓝筹”资本增值型投资为主导,把企业的未来成长能力作为选择投资对象的最核心标准。致力于建立完善的数理统计体系,利用数理分析方法检验不同的投资方法和投资思路,对市场运行特征进行跟踪,确保基金投资决策的科学性。同时重视对趋势的把握,顺势而为,灵活操作。

“新蓝筹”企业的主要选择标准是:

（1）行业发展状况良好,企业处于成长阶段或成熟阶段的早期,企业经营在相对稳健的同时能够保持较高的持续成长能力;过去三年或预期未来两年主营业务收入增长率平均大于 6%或者 GDP 增长率;

（2）企业成长性较好,市场竞争能力强,主营业务收入、主营业务利润、息税前收益保持较高的成长性;

（3）企业盈利能力较强,主营业务盈利水平较高;财务管理能力较强,现金收支安排有序,资产盈利水平较高;

（4）企业财务状况良好,具备一定的规模优势和较好的抗风险能力;

（5）企业在管理制度、产品开发、技术进步方面具有相当的核心竞争优势,有良好的市场知名度和较好的品牌效应,处于行业龙头地位;

（6）企业管理层开拓进取,具备企业家素质,建立了科学的管理和组织架构。

5、权证投资策略

（1）投资策略

根据权证作为衍生品种本身的特性和作用,公司在基金投资权证上主要运用以下投资策略:基于标的证券未来合理估值范围分析及权证定量分析基础上的头寸保护策略及跨式权证投资策略;基于权证杠杆比率及 Delta 对冲比率分析基础上的权证替换投资策略; 基于 Black–Scholes 等权证合理定价分析方法基础上的权证与标的证券的套利投资策略。

（2）风险控制措施

1）实行投资授权控制,确保权证投资的审慎性。

2）实行投资流程控制,在充分研究的基础上参与权证的投资。权证投资必须有公司内部研究报告的支持,研究报告需包含权证标的证券的投资价值分析以及权证投资价值金融工程定量分析。

3）公司监察稽核部依据相关管理规定对权证投资管理过程的合规性进行检查。

6、资产支持证券的投资策略及风险控制措施

A、投资策略

在确保与基金投资目标相一致的前提下,可本着谨慎和风险可控的原则,为取得与承担风险相称的收益,投资于资产支持证券。

a、买入持有策略

可在与投资目标一致的前提下,买入并持有资产支持证券,以获取相应的利息收入。

b、利率预期策略

根据对利率趋势、提前还款率等的预期,预测资产支持证券收益率的变化趋势,从而决定对资产支持证券的买入或卖出。

c、信用利差策略

通过对资产支持证券的信用评估,分析预期违约率和违约损失率的变化趋势,评估其信用利差是否合理,并预测其变化趋势,通过其信用质量的改善和信用利差的缩小获利。

d、相对价值策略

通过计算资产支持证券的名义利差、静态利差及期权调整利差等指标,将资产支持证券的收益风险特征与其他资产类别和债券的收益风险比较,确定其是否具有相对价值,从而决定对其整体或个券的买入和卖出。

B、风险控制措施

a、通过严格的投资流程控制投资风险,基金经理及有关人员必须严格执行公司投资授权制度。

b、在投资资产支持证券时,首先应由固定收益研究员提出资产支持证券产品的风险收益报告和投资建议,基金经理根据投委会决定的资产配置计划和相应的投资权限,参考固定收益研究员的资产支持证券的风险收益报告,充分评估资产支持证券的风险收益特征,确定具体投资方案,在严格控制风险的前提下,谨慎进行投资。

c、基金交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责,监控内容包括基金资产支持证券投资比例及交易对手风险控制等。

d、固定收益小组对资产支持证券投资进行风险和绩效评估,密切跟踪影响基金所投资资产支持证券信用质量变化的各种因素,并在投资中进行相应操作,以规避信用风险的上升。

e、固定收益小组负责不断完善资产支持证券定价模型,并评估模型风险。密切跟踪影响资产支持证券收益率变化的各种因素,并评估其对资产支持证券持有期收益的影响,并进行相应的投资操作。

f、基金经理在投资决策时将评估资产支持证券的上市等流动性安排,并考虑其对基金资产流动性的影响,分散投资,确保所投资的资产支持证券具有适当的流动性。

g、基金经理将密切关注影响债务人提前偿还的各种因素,并评估其对资产支持证券投资价值的影响,并进行相应的投资决策。

h、将不断完善内部控制制度及相应技术手段,使基金相关操作以谨慎安全的方式进行,确保基金及持有人利益得到保障。

i、将严格审查所投资资产支持证券的法律文件,确保各业务环节都有适当的法律保障。

十、基金的业绩比较基准

本基金股票投资部分的比较基准是“国泰君安指数”。国泰君安指数于 1997 年底开始编制,是国内较早的同时反映两个市场的统一指数。该指数采用流通股加权的方式计算,涵盖所有在上海、深圳上市的 A 股上市公司,具有较好的连续性和可比性。

十一、基金的风险收益特征

在适度风险下追求较高收益

十二、基金的投资组合报告

本基金管理人的董事会及董事保证本报告中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。

本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于 2007 年 10 月 11 日复核了本报告中的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。

本投资组合报告所载数据截至 2007 年 6 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

1、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	98,349,134.56	5.70%
清算备付金	11,567,200.19	0.67%
股票投资市值	1,193,188,303.71	69.21%
债券投资市值	391,475,954.19	22.71%
权证投资市值	11,239,253.15	0.65%
其他资产	18,200,713.08	1.06%
资产合计	1,724,020,558.88	100%

2、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	21,400,000.00	1.31%
B 采掘业	138,314,324.75	8.49%
C 制造业	305,652,486.03	18.76%
C0 食品、饮料	39,234,215.68	2.41%
C1 纺织、服装、皮毛	29,414,739.48	1.81%
C2 木材、家具	--	--
C3 造纸、印刷	--	--
C4 石油、化学、塑胶、塑料	132,726,419.64	8.15%
C5 电子	--	--
C6 金属、非金属	55,427,371.83	3.40%
C7 机械、设备、仪表	48,849,739.40	3.00%
C8 医药、生物制品	--	--
C99 其他制造业	--	--
D 电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E 建筑业	25,251,110.04	1.55%
F 交通运输、仓储业	85,317,804.00	5.24%
G 信息技术业	--	--
H 批发和零售贸易	147,068,772.10	9.03%
I 金融、保险业	148,848,753.74	9.13%
J 房地产业	241,991,695.05	14.85%
K 社会服务业	59,708,358.00	3.66%
L 传播与文化产业	19,635,000.00	1.21%
M 综合类	--	--
合计	1,193,188,303.71	73.23%

3、按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市 值(元)	占基金资产净值的比例
1	600048	保利地产	2,168,529	99,600,536.97	6.11%
2	600029	南方航空	9,943,800	85,317,804.00	5.24%
3	000069	华侨城 A	1,500,210	59,708,358.00	3.66%
4	600309	烟台万华	1,068,236	57,214,720.16	3.51%
5	002024	苏宁电器	1,200,000	56,352,000.00	3.46%
6	000960	锡业股份	1,704,933	55,427,371.83	3.40%
7	600030	中信证券	1,027,600	54,431,972.00	3.34%
8	600859	王府井	1,089,000	53,524,350.00	3.28%
9	000001	深发展 A	1,867,062	51,381,546.24	3.15%
10	601699	潞安环能	1,226,900	50,143,403.00	3.08%

4、按券种分类的债券投资组合

序号	市 值(元)	占基金资产净值比例
国债	325,211,777.10	19.96%
可转债	26,443,617.09	1.62%
银行间金融债	39,820,560.00	2.44%
合计	391,475,954.19	24.02%

5、基金投资前五名债券明细

债券名称	市 值(元)	占基金资产净值比例
02国债(14)	158,428,082.50	9.72%
21国债(15)	126,014,040.60	7.73%
21国债(3)	40,769,654.00	2.50%
06国开 01	39,820,560.00	2.44%
锡业转债	26,443,617.09	1.62%

6、报告附注

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

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

（3）其他资产的构成如下:

项目	金 额(元)
交易保证金	1,042,660.55
应收利息	5,600,573.33
应收申购款	11,557,479.20
合计	18,200,713.08

（4）本报告期内无处于转股期的可转换债券

（5）本报告期内无投资资产支持证券

（6）本报告期内本基金投资权证业务的情况

权证名称	期间买入数量(份)	成本总额(元)	期间卖出数量(份)	卖出收入(元)	类别(被动持有 / 主动投资)
长电 CWB1	--	--	2,100,000	19,145,913.14	主动投资
侨城 HQC1	270,000	8,055,921.56	--	--	主动投资
深发 SFC1	151,706	--	--	--	被动持有
深发 SFC2	75,853	--	--	--	被动持有

十三、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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
2002年度	–3.18%	0.23%	–13.76%	0.87%	10.58%	–0.64%
2003年度	19.97%	0.58%	–0.92%	0.82%	20.89%	–0.24%
2004年度	–2.37%	0.97%	–12.21%	1.02%	9.84%	–0.05%
2005年度	6.70%	1.01%	–10.67%	1.09%	17.37%	–0.08%
2006年度	114.00%	1.26%	59.26%	1.09%	54.74%	0.17%
2007年上半年	65.54%	2.04%	66.04%	1.90%	–0.50%	0.14%
自基金合同生效起至今	328.84%	1.12%	77.28%	1.14%	251.56%	–0.02%

十四、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关费用种类

（1）基金管理人的管理费;
（2）基金托管人的托管费;
（3）证券交易费用;
（4）基金信息披露费用;
（5）基金份额持有人大会费用;
（6）基金成立后与基金相关的会计师费和律师费;
（7）按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

（1）基金管理人的管理费

基金管理人的管理费以基金资产净值的 1.5%年费率计提。基金管理人的管理费每日计提，按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

（2）基金托管费

本基金应给付基金托管人托管费,按前一日的基金资产净值的 2.5‰的年费率计提。基金托管人的托管费每日计算,每日计提,按月支付,由基金托管人于次月首两个工作日内从基金资产中一次性支取,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

（3）上述 1 中（3）到（7）项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

3、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4、基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费,无须召开基金份额持有人大会。最迟须于新的费率或收费方式实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上公告。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费

（1）本基金的申购采用前端收费和后端收费两种收费模式,投资人可自行选择。申购费用用于基金管理人、基金销售机构的基金销售费用。

（2）本基金的前端申购费按申购金额采用比例费率,投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。费率表如下:

申购金额(含申购费)	费率
100万元以下	1.5%
100万元(含)—1,000 万元	1.2%
1,000 万元(含)—1 亿元(含)	1.0%
超过 1 亿元以上部分	0

（3）本基金的后端申购费以持有期限分档设置不同的费率水平。费率表如下:

持有期	后端申购费率
一年以内	1.6%
满一年不满二年	1.2%
满二年不满三年	0.8%
满三年不满四年	0.4%
满四年后	0

2、赎回费按照赎回总金额的 0.5%收取,最低赎回费为 5 元。赎回费用由赎回人承担,在扣除销售代理费用和注册登记费等相关手续费用后,余额不低于赎回费的 25%归基金财产。

3、转换费用

（1）基金转换只允许在缴纳前端申购（认购）费用的基金份额之间或者缴纳后端申购（认购）费用的基金份额之间进行。不能将缴纳前端申购（认购）费用的基金份额转换为缴纳后端申购（认购）费用的基金份额,或将缴纳后端申购（认购）费用的基金份额转换为缴纳前端申购（认购）费用的基金份额。基金转换费用包括转换费和补差费。

（2）转换费:按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。

（3）补差费:对于前端收费模式基金,转出基金的申购费率（或认购费率）高于转入基金的申购费率（或认购费率）时,补差费为 0;转出基金的申购费率（或认购费率）低于转入基金的申购费率（或认购费率）时,按申购费率（或认购费率）的差额收取补差费。对于后端收费模式基金,补差费为 0。

（4）基金补差费的收取以该基金份额曾经有过的最高申（认）购费率为基础计算,累计不超过最高认购（申购）费率与最低认购（申购）费率的差额。

（5）基金转换费由转换申请人承担,其中 25%归转出基金基金财产,其余作为注册登记费和相关的手续费。基金补差费由转换申请人承担,作为相关的手续费。

（三）基金税收

本基金运作过程中的各类纳税主体,依照国家法律法规的规定,履行纳税义务。

十五、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《基金法》、《运作管理办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金管理人于 2007 年 10 月 日刊登的本基金更新招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

1、在“第三节基金管理人”中,更新了公司股东和股权结构;
2、在“第三节基金管理人”中,对基金经理做了更新;
3、在“第四节基金托管人”中,对基金托管人的基本情况及相关业务经营情况进行了更新;
4、在“第五节相关服务机构”中,更新了融通基金管理有限公司北京、上海分公司总机号码,新增代销机构工商银行;
5、在”第八节基金份额的申购、赎回与转换”中,更新了申购份额与转入份额的计算方式
6、在“第九节基金的投资”和“第十节基金的业绩”中,对财务数据和投资组合等进行了定期更新;
7、对“第十二节基金资产的估值”进行了更新.
8、在“第十三节基金收益的分配”中,更新了基金收益的构成。
9、在”第二十节基金托管协议的内容摘要”中,更新了基金资产净值计算与复核。
10、对“第二十二节其他应披露的事项”进行了更新。

融通基金管理有限公司
2007 年 10 月 24 日

证券代码:600225　证券简称:S*ST 天香　公告编号:2007–临 068

华通天香集团股份有限公司
关于法人股被冻结的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

华通国际招商集团股份有限公司系我司第二大股东，持有我司法人股 29,007,000 股。该股权因中国农业银行上海市浦东分行诉我司一案,于 2005 年 6 月 14 日被上海市第一中级人民法院查封（详见我司 2005 年 6 月 15 日、2006 年 5 月 26 日及 2006 年 12 月 15 日公告）。现因该案尚未结束，经上海市第一中级人民法院作出的（2005）沪一中字第 1083 号民事裁定,继续冻结华通国际招商集团股份有限公司持有的我司 29,007,000 股社会法人股（已质押）。冻结日期自 2007 年 10 月 22 日至 2008 年 4 月 21 日。

特此公告。

华通天香集团股份有限公司
董事会
2007 年 10 月 23 日

证券代码:600702　证券简称:沱牌曲酒　公告编号:2007–025

四川沱牌曲酒股份有限公司
关于发审会审核公司
非公开发行 A 股股票事宜停牌公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

公司接到中国证券监督管理委员会发行审核委员会通知，发审会将于 2007 年 10 月 24 日审核本公司非公开发行 A 股股票事宜。按照相关规定，本公司股票于 2007 年 10 月 24 日停牌,待公司公告审核结果后复牌。

特此公告

四川沱牌曲酒股份有限公司董事会
二〇〇七年十月二十三日

证券代码:600155　证券简称:*ST 宝硕　编号:临 2007–054

河北宝硕股份有限公司
关于股东限售流通股股权解冻公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整，对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

公司日前收到山东省济南市中级人民法院发至中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的《协助执行通知书》（2006）济民四初字第 214 号，山东省济南市中级人民法院已于 2007 年 10 月 22 日将轮候冻结的宝硕集团有限公司所持本公司 150,683,512股限售流通股股权予以解冻。

特此公告。

河北宝硕股份有限公司董事会
2007 年 10 月 23 日

股票代码:600087　股票简称:南京水运　编号:临 2007–034

南京水运实业股份有限公司
关于中国证监会审核公司
非公开发行股份事宜的停牌公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整，并对公告中的任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担责任。

公司接到中国证券监督管理委员会的通知，中国证监会发行审核委员会将于 2007 年 10 月 24 日审核公司非公开发行股份事宜。按照相关规定，公司股票于 10 月 24 日停牌一天，待公告审核结果后复牌。

特此公告。

南京水运实业股份有限公司董事会
2007 年 10 月 24 日