

融通行业景气证券投资基金 2006年半年度报告摘要

一、重要提示

基金管理人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...

二、基金简介

(一)基金基本情况
基金简称:融通行业景气基金
交易代码:161606
基金运作方式:契约型开放式

(二)基金业绩表现

业绩比较基准:70%×上证综合指数+30%×银行间债券综合指数
风险收益特征:在锁定可承受风险的基础上,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
办公地址:深圳市南山区华侨城汉唐大厦13.14层
邮政编码:518063

(四)基金托管人概况

名称:交通银行
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
邮政编码:200120

(五)信息披露

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

重要提示: 本报告所列示的基金业绩指标并不包括个人认购或交易基金的各项费用...

Table with 2 columns: 财务指标, 2006年1月1日至2006年6月30日

Table with 2 columns: 基金净值表现, 2006年1月1日至2006年6月30日

Table with 5 columns: 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, 业绩比较基准标准差④

Table with 2 columns: 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

四、管理人报告
(一)基金管理人及基金经理介绍
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金字[2001]8号文批准,于2001年6月22日成立。

截止至2006年6月底,公司管理的基金共有七只,两只为封闭式基金:基金金通和基金通宝...

(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、法规和《融通行业景气证券投资基金合同》的规定...

(三)基金业绩表现
1.市场回顾
06年上半年是近几年来少有的牛市上涨,上证指数上涨44%,A股上涨板块一改往日的二八现象...

2.基金操作总结
从上半年的投资结果看,业绩虽然跑输指数,但相对其他基金,并未能为持有人提供更好的投资回报...

3.下半年市场展望及投资策略
由于上半年股指上涨的推动因素宏观经济高速增长受调控影响趋于稳定,股改对价已基本完成...

基于对下半年证券市场进入相对平衡阶段的判断,我们将采取较为灵活的投资策略,加大资产周转率,投资重点将着重选股,重点放在对公司的把握,投资指数的影响,加大把握因公司重组或市场调整带来的投资机会...

五、托管人报告
2006年上半年,托管人在融通行业景气基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律、法规和《基金合同》的规定...

六、财务会计报告(未经审计)
(一)基金会计报表

Table with 2 columns: 融通行业景气证券投资基金资产负债表, 2006年6月30日

Table with 2 columns: 融通行业景气证券投资基金经营业绩表, 自2006年1月1日至2006年6月30日止期间

融通行业景气证券投资基金资产负债表 二〇〇六年六月三十日

Table with 3 columns: 资产, 2006年6月30日, 2005年12月31日

融通行业景气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

Table with 3 columns: 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

融通行业景气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

Table with 3 columns: 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

融通行业景气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

Table with 3 columns: 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

(二)会计报表附注
(除特别标明外,金额单位为人民币元)
附注1.主要会计政策及会计估计

附注2.本报告期末发生重大会计差错的内容和更正金额。
附注3.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、注册登记机构、基金销售机构

交通银行 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

陕西国际信托投资股份有限公司 基金管理人股东
联合证券有限责任公司“联合证券” 基金管理人股东、基金代销机构

华林证券有限责任公司“华林证券” 基金管理人股东
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。

Table with 4 columns: 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

Table with 4 columns: 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

Table with 4 columns: 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

Table with 4 columns: 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

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)关联方报酬
A.基金管理人报酬
基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提。

H=E×1.5%/当年天数
E为每日应支付的基金管理费
H为前一日基金资产净值

B.基金托管人报酬
基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。

H=E×0.25%/当年天数
E为每日应支付的基金托管费
H为前一日基金资产净值

(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交通银行股份有限公司保管,并按银行同业利率计息。

(5)与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易
本基金在本报告期及05年同期末与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行债券交易。

(6)基金各关联方投资本基金的情况
A.基金管理人期末持有本基金的情况
本报告期间及05年同期末基金管理人未持有本基金份额。

附注4.流通转让受限制的金融资产
(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,这些股票自该新股上市交易之日起锁定3个月后可上市流通。

Table with 10 columns: 股票名称, 数量(股), 总市值, 估值方法, 转让受限原因, 受限期限

(2)本基金截至2006年6月30日止持有以下因股权激励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或在股权激励改革规定的程序结束后复牌。

Table with 10 columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 停牌前收盘价, 复牌日期, 复牌前收盘价, 数量(股), 估值方法, 期末成本总额, 期末市值总额

七、投资组合报告

Table with 2 columns: 项目, 金额(元), 占基金资产净值比例

(二)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

Table with 3 columns: 行业, 市值(元), 占基金资产净值比例

Table with 4 columns: 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

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于融通基金管理人网站上的半年度报告正文。

(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

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(元), 占期初基金资产净值比例

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

Table with 5 columns: 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

2.债券及回购及权证交易量情况:
券商名称 债券成交金额(元) 占本期该类交易成交总金额比例

Table with 5 columns: 券商名称, 债券成交金额(元), 占本期该类交易成交总金额比例, 债券回购成交金额(元), 占本期该类交易成交总金额比例

(八)其他重大事项
1.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。

2.从2006年2月27日起,本基金开通与融通易支付货币市场证券投资基金份额之间的基金转换业务。

3.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。

4.2006年7月18日,交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于住所变更的公告》。

融通基金管理有限公司
2006年8月25日

3.本报告期买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 项目, 金额(元)

(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

Table with 3 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占基金资产净值比例

(七)基金投资前五名权证明细
权证名称 市值(元) 占基金资产净值比例

(八)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;

Table with 2 columns: 项目, 金额(元)

Table with 5 columns: 权证名称, 期间获配数量, 买入成本(元), 期间卖出数量(份), 卖出收入(元)

注:本基金报告期内投资的权证源于股权分置改革对价支付,非本基金主动投资

6.本报告期末内本基金未投资资产支持证券。

Table with 2 columns: 项目, 2006年6月30日

Table with 2 columns: 项目, 2006年6月30日

Table with 2 columns: 项目, 2006年6月30日

(一)本报告期末未开基金基金份额持有人大会。

(二)本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

(三)基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

(四)本基金报告期内,基金财产、基金托管业务在报告期内无诉讼事项。

(五)本基金投资策略在本报告期内未发生变更。

(六)本基金在本报告期收益分配事项。

Table with 4 columns: 公告日, 权益登记日, 除权日, 每10份基金份额分红数

(七)本报告期末,基金管理人、托管人及其高级管理人员均无受监管部门稽查或处罚的情形。

(八)本基金在报告期内未改聘为其审计的会计师事务所

(九)基金租用证券公司专用交易席位的情况

本基金选择了中信建投(原华夏证券)、国泰君安、兴业证券、民生证券、大通证券、联合证券、第一创业、东方证券、银华万国、上海证券、大鹏证券、华泰证券、第一证券、华林证券、银河证券和中信万通作为本基金专用交易席位。

其中中信万通上海席位为本报告期新增席位。

截止2006年6月30日,本基金通过各机构的交易席位的成交及佣金情况如下:

Table with 5 columns: 券商名称, 席位数量(个), 股票成交金额(元), 占本期该类交易成交总金额比例, 席位佣金(元)

Table with 5 columns: 券商名称, 席位数量(个), 股票成交金额(元), 占本期该类交易成交总金额比例, 席位佣金(元)

Table with 5 columns: 券商名称, 债券成交金额(元), 占本期该类交易成交总金额比例, 债券回购成交金额(元), 占本期该类交易成交总金额比例

(八)其他重大事项
1.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。

2.从2006年2月27日起,本基金开通与融通易支付货币市场证券投资基金份额之间的基金转换业务。

3.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。

4.2006年7月18日,交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于住所变更的公告》。