

通乾证券投资基金 2006年半年度报告摘要

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

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,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。

二、基金简介
(一)基金基本情况
基金简称:基金通乾
交易代码:500038

三、主要财务指标和基金净值表现
(一)主要财务指标
2006年1月1日至6月30日
基金本期净收益 385,372,122.07元

四、管理人报告
(一)基金管理人及基金经理介绍
1.基金管理人及基金经理的情况
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5月22日成立。

五、投资组合报告
(一)基金投资组合报告
截至2006年6月30日,本基金资产组合情况如下:
1.基金投资组合报告
(1)基金资产组合情况

六、基金业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

七、基金管理人内部控制制度
(一)基金管理人内部控制制度概述
1.基金管理人内部控制制度的重要性

八、基金管理人内部控制制度的执行情况
(一)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

九、基金管理人内部控制制度的执行情况
(二)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十、基金管理人内部控制制度的执行情况
(三)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十一、基金管理人内部控制制度的执行情况
(四)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十二、基金管理人内部控制制度的执行情况
(五)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十三、基金管理人内部控制制度的执行情况
(六)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十四、基金管理人内部控制制度的执行情况
(七)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十五、基金管理人内部控制制度的执行情况
(八)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十六、基金管理人内部控制制度的执行情况
(九)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十七、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十八、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十一)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

十九、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十二)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十三)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十一、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十四)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十二、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十五)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十三、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十六)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十四、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十七)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十五、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十八)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

二十六、基金管理人内部控制制度的执行情况
(十九)基金管理人内部控制制度的执行情况
1.基金管理人内部控制制度的执行情况

更长的增长平台是经济发展路径的必然要求,具有必然性;
(2) 重组 IPO 短期内的确对资金面造成较大压力,改变了市场的供求状态,特别是在当前二级市场已经累积较大升幅的情况下,大量新股 IPO 的推出在分流资金方面的效应得到放大。

下半年价值类资产的相对吸引力存在上升的可能,但从更长期角度看,结构性成长类资产仍然是盈利能力最强且持续性良好的资产类别。我们中、长期看好的结构性成长类资产主要包括:先进制造业特别是装备制造、现代服务业(包括证券、银行、地产、信息传媒服务和旅游服务等)以及品牌消费类资产(食品饮料及商业零售等)等。

下半年基金管理人将对本基金的资产布局进行调整,逐步减持周期性资产,增持结构性成长类资产。与此同时,管理人将进一步强化本基金在资产配置上的风险管理能力,严格控制各类资产的偏离度,努力实现基金净值的稳定持续增长。

中国建设银行股份有限公司根据《通乾证券投资基金基金合同》和《通乾证券投资基金托管协议》,托管通乾证券投资基金(以下简称通乾基金)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在通乾基金的托管过程中,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通乾基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未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。

由通乾基金管理人—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。

六、财务会计报告(未经审计)
(一)基金会计报表

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

通乾证券投资基金 资产负债表 二〇〇六年六月三十日 (续)

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投资

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2006年6月30日

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2006年6月30日

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2006年6月30日

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2006年6月30日

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2006年6月30日

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。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币 16,945,202.03 元。(2005 年同期:14,714,581.58 元)

(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。计算方法如下:

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。计算方法如下:

C 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:

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

关联方名称 2006-6-30 2005-6-30

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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