

## 科翔证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:易方达基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

## 重要提示

基金管理人及基金托管人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2006年8月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本报告期间:2006年1月1日至2006年6月30日。本报告财务数据未经审计。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读登载于本基金管理人网站www.efunds.com.cn的半年度报告正文。

## 一、基金简介

(一)基金基本情况	
1.基金名称:	科翔证券投资基金
2.基金简称:	基金科翔
3.基金交易代码:	184713
4.基金运作方式:	契约型封闭式
5.基金合同生效日:	2001年5月25日
6.报告期末基金份额总额:	8亿份
7.基金合同存续期:	2001年5月25日至2008年12月13日
8.基金份额上市的证券交易所:	深圳证券交易所
9.上市日期:	2001年6月20日

(二)基金产品说明	
1.投资目标和策略:	科翔证券投资基金是积极成长型基金,主要投资目标是所处行业具有良好发展前景的新兴产业类上市公司。本基金将通过组合投资等措施减少和分散投资风险,努力确保基金资产的安全和长期资本增值。
2.业绩比较基准:	无
3.风险收益特征:	无

(三)基金管理人	
1.名称:	易方达基金管理有限公司
2.信息披露负责人:	张南
3.信息披露电话:	020-38799008
4.客户服务与投诉电话:	40088-18088(免长途话费)或(020)-83918088
5.传真:	020-38794888
6.电子邮箱:	csc@efunds.com.cn

(四)基金托管人	
1.名称:	中国工商银行股份有限公司
2.信息披露负责人:	庄为
3.联系电话:	010-66106912
4.传真:	010-66106804
5.电子邮箱:	custody@icbc.com.cn

(五)信息披露	
信息披露报纸名称:	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载半年度报告正文的管理人互联网网址:	www.efunds.com.cn
基金半年度报告置备地点:	广州市体育西路189号城建大厦27楼

## 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		
序号	项目	2006年1月1日至6月30日
1	基金本期净收益	166,696,584.10
2	基金份额期末净收益	0.2084
3	期末可供分配基金份额收益	0.2171
4	期末基金资产净值	1,569,458,149.27
5	期末基金份额净值	1.9818
6	基金基金份额净值增长率	68.49%

(二)基金净值表现		
1.本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:		
前段	净值增长率(1)	业绩比较基准收益率(2)
过去一个月	7.21%	5.82%
过去三个月	43.33%	5.07%
过去六个月	68.49%	3.73%
过去一年	75.54%	2.92%
过去三年	128.31%	2.63%
自基金合同生效起至今	148.22%	2.31%

2.基金合同生效以来基金累计净值增长率的历史走势图		
---------------------------	--	--

前段	净值增长率(1)	业绩比较基准收益率(2)	(1)-(2)	(2)-(4)
过去一个月	7.21%	5.82%	--	--
过去三个月	43.33%	5.07%	--	--
过去六个月	68.49%	3.73%	--	--
过去一年	75.54%	2.92%	--	--
过去三年	128.31%	2.63%	--	--
自基金合同生效起至今	148.22%	2.31%	--	--

(三)管理人报告		
1.基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(四)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(五)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(六)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(七)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(八)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(九)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(十)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(十一)基金管理人及基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		
1.基金管理人及其管理基金的经验		
2.基金基金经理		

(一)基金会计报表		
1.资产负债表		
	2006-6-30	2005-12-31
资产		
银行存款	4,859,542.56	41,537,323.39
清算备付金	1,068,169.36	153,125.28
交易保证金	204,648.05	1,098,780.49
应收证券清算款	--	16,376,634.15
应收股利	--	--
应收利息	3,869,434.68	3,193,860.95
其他应收款	--	--
股票投资市值	1,250,717,561.59	729,611,386.64
其中:股票投资成本	655,248,832.58	620,354,505.52
债券投资市值	315,311,345.00	200,791,156.20
其中:债券投资成本	315,331,109.99	200,119,679.04
权证投资	345,268.33	334,768.55
其中:权证投资成本	--	--
买入返售证券	--	--
待摊费用	145,923.78	--
其他资产	--	--
资产总计	1,576,511,893.34	993,097,035.56
负债		
应付证券清算款	2,159,617.96	--
应付管理人报酬	1,876,574.17	1,210,163.41
应付托管费	312,762.34	201,693.89
应付佣金	477,136.67	392,666.34
应付利息	--	--
应付收益	--	--
未交税金	--	--
其他应付款	1,997,062.36	1,997,062.36
卖出回购证券款	--	--
短期借款	--	--
预提费用	230,588.57	65,000.00
其他负债	--	--
负债合计	7,063,744.07	3,866,576.00
持有人权益		
实收基金	800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得	595,794,232.35	110,263,126.73
未分配收益	173,663,916.92	79,967,332.82
持有者权益合计	1,569,458,149.27	989,230,459.55
负债及持有人权益总计	1,576,511,893.34	993,097,035.56
基金份额净值	1.9818	1.2365

科翔证券投资基金资产负债表		
2006年6月30日		
	2006-6-30	2005-12-31
资产		
银行存款	4,859,542.56	41,537,323.39
清算备付金	1,068,169.36	153,125.28
交易保证金	204,648.05	1,098,780.49
应收证券清算款	--	16,376,634.15
应收股利	--	--
应收利息	3,869,434.68	3,193,860.95
其他应收款	--	--
股票投资市值	1,250,717,561.59	729,611,386.64
其中:股票投资成本	655,248,832.58	620,354,505.52
债券投资市值	315,311,345.00	200,791,156.20
其中:债券投资成本	315,331,109.99	200,119,679.04
权证投资	345,268.33	334,768.55
其中:权证投资成本	--	--
买入返售证券	--	--
待摊费用	145,923.78	--
其他资产	--	--
资产总计	1,576,511,893.34	993,097,035.56
负债		
应付证券清算款	2,159,617.96	--
应付管理人报酬	1,876,574.17	1,210,163.41
应付托管费	312,762.34	201,693.89
应付佣金	477,136.67	392,666.34
应付利息	--	--
应付收益	--	--
未交税金	--	--
其他应付款	1,997,062.36	1,997,062.36
卖出回购证券款	--	--
短期借款	--	--
预提费用	230,588.57	65,000.00
其他负债	--	--
负债合计	7,063,744.07	3,866,576.00
持有人权益		
实收基金	800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得	595,794,232.35	110,263,126.73
未分配收益	173,663,916.92	79,967,332.82
持有者权益合计	1,569,458,149.27	989,230,459.55
负债及持有人权益总计	1,576,511,893.34	993,097,035.56
基金份额净值	1.9818	1.2365

科翔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		
	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
收入		
股票差价收入	177,615,184.47	51,394,965.33
债券差价收入	149,789,589.77	35,207,904.02
债券投资收益	-2,901,717.70	3,556,093.22
利息收入	20,164,089.48	--
债券利息收入	3,440,740.68	3,245,484.82
存款利息收入	79,669.54	180,251.70
买入返售证券收入	7,042,942.70	9,186,235.23
其他收入	--	--
其他费用	10,918,600.37	9,074,814.11
基金管理人报酬	9,092,216.69	7,459,521.42
基金托管费	1,515,369.37	1,243,253.65
卖出回购证券支出	54.79	36,045.21
利息支出	--	--
其他支出	310,969.52	335,993.83
其中:上市费用	29,752.78	29,752.78
信息披露费	168,603.31	168,603.31
审计费用	32,232.48	32,232.48
基金净收益	166,696,584.10	42,310,151.22
加:未实现利得	485,531,105.62	-2,455,431.13
基金经营业绩	652,227,689.72	39,854,720.09

科翔证券投资基金资产负债表		
2006年6月30日		
	2006-6-30	2005-12-31
资产		
银行存款	4,859,542.56	41,537,323.39
清算备付金	1,068,169.36	153,125.28
交易保证金	204,648.05	1,098,780.49
应收证券清算款	--	16,376,634.15
应收股利	--	--
应收利息	3,869,434.68	3,193,860.95
其他应收款	--	--
股票投资市值	1,250,717,561.59	729,611,386.64
其中:股票投资成本	655,248,832.58	620,354,505.52
债券投资市值	315,311,345.00	200,791,156.20
其中:债券投资成本	315,331,109.99	200,119,679.04
权证投资	345,268.33	334,768.55
其中:权证投资成本	--	--
买入返售证券	--	--
待摊费用	145,923.78	--
其他资产	--	--
资产总计	1,576,511,893.34	993,097,035.56
负债		
应付证券清算款	2,159,617.96	--
应付管理人报酬	1,876,574.17	1,210,163.41
应付托管费	312,762.34	201,693.89
应付佣金	477,136.67	392,666.34
应付利息	--	--
应付收益	--	--
未交税金	--	--
其他应付款	1,997,062.36	1,997,062.36
卖出回购证券款	--	--
短期借款	--	--
预提费用	230,588.57	65,000.00
其他负债	--	--
负债合计	7,063,744.07	3,866,576.00
持有人权益		
实收基金	800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得	595,794,232.35	110,263,126.73
未分配收益	173,663,916.92	79,967,332.82
持有者权益合计	1,569,458,149.27	989,230,459.55
负债及持有人权益总计	1,576,511,893.34	993,097,035.56
基金份额净值	1.9818	1.2365

科翔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		
	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
收入		
股票差价收入	177,615,184.47	51,394,965.33
债券差价收入	149,789,589.77	35,207,904.02
债券投资收益	-2,901,717.70	3,556,093.22
利息收入	20,164,089.48	--
债券利息收入	3,440,740.68	3,245,484.82
存款利息收入	79,669.54	180,251.70
买入返售证券收入	7,042,942.70	9,186,235.23
其他收入	--	--
其他费用	10,918,600.37	9,074,814.11
基金管理人报酬	9,092,216.69	7,459,521.42
基金托管费	1,515,369.37	1,243,253.65
卖出回购证券支出	54.79	36,045.21
利息支出	--	--
其他支出	310,969.52	335,993.83
其中:上市费用	29,752.78	29,752.78
信息披露费	168,603.31	168,603.31
审计费用	32,232.48	32,232.48
基金净收益	166,696,584.10	42,310,151.22
加:未实现利得	485,531,105.62	-2,455,431.13
基金经营业绩	652,227,689.72	39,854,720.09

科翔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		
	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
收入		
股票差价收入	177,615,184.47	51,394,965.33
债券差价收入	149,789,589.77	35,207,904.02
债券投资收益	-2,901,717.70	3,556,093.22
利息收入	20,164,089.48	--
债券利息收入	3,440,740.68	3,245,484.82
存款利息收入	79,669.54	180,251.70
买入返售证券收入	7,042,942.70	9,186,235.23
其他收入	--	--
其他费用	10,918,600.37	9,074,814.11
基金管理人报酬	9,092,216.69	7,459,521.42
基金托管费	1,515,369.37	1,243,253.65
卖出回购证券支出	54.79	36,045.21
利息支出	--	--
其他支出	310,969.52	335,993.83
其中:上市费用	29,752.78	29,752.78
信息披露费	168,603.31	168,603.31
审计费用	32,232.48	32,232.48
基金净收益	166,696,584.10	42,310,151.22
加:未实现利得	485,531,105.62	-2,455,431.13
基金经营业绩	652,227,689.72	39,854,720.09

科翔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		
	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
收入		
股票差价收入	177,615,184.47	51,394,965.33
债券差价收入	149,789,589.77	35,207,904.02
债券投资收益	-2,901,717.70	3,556,093.22
利息收入	20,164,08	