

科汇证券投资基金 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:交通银行

重要提示
基金管理人的董事会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。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。
基金托管人交通银行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,应阅读刊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

1.基金名称:	科汇证券投资基金
2.基金简称:	基金科汇
3.基金交易代码:	184712
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:	基金将通过创建投资组合等措施减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期资本增值。本基金主要追求资本的长期增值,通过投资于景气状况良好或处于上升期产业中的股票,力争在严格控制风险的同时,能取得较高的资本增值率。
2.投资策略:	“产业景气”体现了本基金的投资理念。即采用由上而下的方法,首先按各产业的景气状况进行资产在产业上配比,然后在景气状况良好或上升的产业中按企业的成长性高低进行资金在股票上的配比。
3.业绩比较基准:	无
4.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:	张味东
3.联系电话:	021-68929917
3.信息披露电话:	1020-38799090
4.客户服务中心电话:	40088-18881(免长途话费)或020-83918088
5.传真:	020-38799488
6.电子邮箱:	cs@efunds.com.cn

(四)基金托管人

1.名称:	交通银行
2.信息披露负责人:	张咏东
3.联系电话:	021-68929917
4.传真:	021-59408266
5.电子邮箱:	zhangy@bankcomm.com

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互联网网址:www.efunds.com.cn
基金半年度报告备查地点: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

1.基金净值表现	2006年6月30日	2006年12月31日
资产:	63,779,536.04	6,699,426.80
银行存款	3,211,609.72	501,444.92
交易保证金	862,698.42	881,465.52
应收证券交易清算款	1,206,773.90	1,517,468.56
应收利息	0.00	0.00
应收利息	3,128,169.65	3,103,767.06
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	1,189,416,199.38	857,601,316.64
其中:股票投资市值	823,773,770.04	699,516,932.78
债券投资市值	311,146,518.36	219,717,151.50
其中:债券投资市值	311,173,136.09	218,102,294.76
权证投资市值	0.00	0.00
其中:权证投资市值	0.00	0.00
买入返售证券	0.00	0.00
待摊费用	242,799.78	0.00
其它资产	0.00	0.00
资产合计:	1,572,192,304.25	1,090,022,040.99

负债:

应付证券清算款	29,637,701.67	0.00
应付管理人报酬	1,964,121.32	1,322,240.06
应付托管费	210,696.89	230,372.36
应付佣金	1,382,203.09	286,216.63
应付利息	0.00	0.00
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	1,316,556.17	1,316,556.17
卖出回购证券款	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	230,588.57	65,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	34,741,857.71	3,190,486.22
持有人权益:	800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得	305,614,812.61	159,699,140.60
未分配收益	372,636,633.93	127,132,414.16
持有人权益合计	1,538,250,446.54	1,086,831,564.76
负债与持有人权益总计	1,572,192,304.25	1,090,022,040.99
基金份额净值	1.9228	1.3685

所附附注为本会计报表的组成部分

三、基金净值表现

1.基金科汇历史各阶段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表:	2006年1月1日至2006年6月30日		
基金名称	净值增长率	业绩比较基准	差额
1.基金科汇	5.77%	4.68%	1.09%
2.沪深300	3.45%	3.72%	-0.27%
3.上证50	5.90%	2.86%	3.04%
4.中证100	7.20%	2.42%	4.78%
5.沪深300	13.51%	2.54%	10.97%
6.自基金合同生效起至今	156.66%	2.26%	154.40%

2.基金科汇累计净值增长率历史走势图

四、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

五、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

六、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

七、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

持较高的股票资产配置比重。
本基金上半年仍以商业和消费品等持续增长类的行业为重点配置对象,保持了重仓股的基本稳定,对预期供给增加较多的煤炭行业进行了减持,增加了对医药行业的投资。
在上半年股票市场的上涨过程中,本基金组合中的一些持续增长类型的股票表现超越市场总体,但一些受宏观政策影响的地产类股票表现不及指数,综合结果使基金净值在上半年增长56.90%,总体表现依然明显好于比较基准。
2.对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
从上半年的宏观经济数据看,经济运行总体良好,消费稳定增长,出口和外汇储备增长超预期,固定资产投资增速仍然较高。这一方面反映中国经济内生增长的动力强劲,另一方面也反映了经济仍偏热现象,以调整汇率和提高利率等市场化工具为主要手段的宏观调控在所难免。
从市场角度分析,经过上半年的市场快速上涨,目前市场整体的估值水平已经趋于合理,价值重估的空间已经不大,后续的投资机会主要来自企业经营水平提升和技术创新带来的业绩增长,而这需要日积月累才能实现。因此,希望市场短期继续大幅上涨有些不太现实,同时,基金净值也不太可能保持像上半年那样的大幅增长。
上半年股权分置问题已经基本解决,新老划断和市场化发行已经实施,资本市场运行的基础健康了许多。可以预期,上市公司各方利益更加趋于一致,公司治理情况将得到很大改善,那些为投资者创造价值的企业会在金融通的市场中获得更多的关注和资源,利用资本市场进行企业再融资和产业整合的案例将大量增加,整体上,兼并收购等带来的投资机会值得期待。
从行业角度分析,前几年经济中明显存在的煤、电、油、运等瓶颈逐渐解决,上半年金属资源类价格也有了大幅提升,产业链上下游的供需关系逐渐趋于均衡,行业性的投资机会将不明显,良好的管理和持续的创新能力是企业提升价值的关键,尤其是那些自具竞争力突出,同时能利用行业整合快速做大做强公司将作为股东创造大值的价值。

本基金下半年的投资重点仍以持续增长类的行业,通过深入研究努力找出那些有长期核心竞争力优势的企业进行投资,来分享经济增长的成果。同时,努力发掘兼并收购等行业整合带来的投资机会,争取为持有人带来更好的回报。

四、托管人报告
2006年上半年,托管人在科汇证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。
2006年上半年,易方达基金管理有限公司在科汇证券投资基金运作过程中,基金资产净值的计算,基金费用开支等项上,托管人未发生损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。
2006年上半年,由易方达基金管理有限公司编制并经理人复核审查的有关科汇证券投资基金的半年度报告中财务指标、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真实、准确、完整。

五、财务会计报告

资产:	2006年6月30日	2006年12月31日
银行存款	3,211,609.72	501,444.92
交易保证金	862,698.42	881,465.52
应收证券交易清算款	1,206,773.90	1,517,468.56
应收利息	0.00	0.00
应收利息	3,128,169.65	3,103,767.06
其他应收款	0.00	0.00
股票投资市值	1,189,416,199.38	857,601,316.64
其中:股票投资市值	823,773,770.04	699,516,932.78
债券投资市值	311,146,518.36	219,717,151.50
其中:债券投资市值	311,173,136.09	218,102,294.76
权证投资市值	0.00	0.00
其中:权证投资市值	0.00	0.00
买入返售证券	0.00	0.00
待摊费用	242,799.78	0.00
其它资产	0.00	0.00
资产合计:	1,572,192,304.25	1,090,022,040.99

负债:

应付证券清算款	29,637,701.67	0.00
应付管理人报酬	1,964,121.32	1,322,240.06
应付托管费	210,696.89	230,372.36
应付佣金	1,382,203.09	286,216.63
应付利息	0.00	0.00
应付收益	0.00	0.00
未交税金	0.00	0.00
其他应付款	1,316,556.17	1,316,556.17
卖出回购证券款	0.00	0.00
短期借款	0.00	0.00
预提费用	230,588.57	65,000.00
其他负债	0.00	0.00
负债合计	34,741,857.71	3,190,486.22
持有人权益:	800,000,000.00	800,000,000.00
未实现利得	305,614,812.61	159,699,140.60
未分配收益	372,636,633.93	127,132,414.16
持有人权益合计	1,538,250,446.54	1,086,831,564.76
负债与持有人权益总计	1,572,192,304.25	1,090,022,040.99
基金份额净值	1.9228	1.3685

所附附注为本会计报表的组成部分

六、投资组合报告

行业类别	市值(元)	占基金资产净值比例
A 农林牧渔	0.00	0.00%
B 制造业	576,838,132.17	37.60%
C 采掘业	147,600,491.48	9.69%
C1 纺织服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	5,471,769.00	0.35%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	4,786,044.00	0.31%
C6 金属、非金属	164,769,056.70	10.71%
C7 机械、设备、仪表	166,677,992.79	10.84%
C8 医药、生物制品	87,532,776.20	5.69%
C9 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	34,203,985.56	2.22%
G 信息技术业	53,978,929.79	3.51%
H 房地产业	241,562,067.09	15.70%
I 商业、贸易	94,347,252.84	6.17%
J 房地产业	14,467,000.00	0.94%
K 社会服务业	81,165,703.78	5.28%
L 传播与文化产业	92,283,107.16	6.00%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	1,189,416,199.38	77.32%

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

七、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

八、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

九、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

十、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

十一、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

十二、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

十三、基金管理人及基金经理简介

姓名	净增长率	业绩比较基准	差额
①-③	-	-	-
②-④	-	-	-

注:1.基金合同中关于基金投资比例的约定:
(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%,本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(3)遵守中国证监会规定的其它比例限制。
因基金规模或市场原因导致投资组合不符合上述规定时,基金管理人应在合理期限内进行调整,以符合上述规定。法律法规另有规定时,从其规定。
本基金在本报告期内遵守上述投资比例的规定进行证券投资。
2.本基金基金合同未规定业绩比较基准

附注3: 关联方关系及关联方交易

(1)主要关联方关系

企业名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
交通银行	基金托管人
广发证券股份有限公司(简称“广发证券”)	基金管理人股东
广东粤财信托投资有限公司	基金发起人、基金管理人股东
广东美的电器股份有限公司	基金管理人股东
重庆国际信托投资有限公司	基金管理人股东
广州市广国国有资产经营有限公司	基金管理人股东

以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
(2)通过主要关联方席位进行的交易

关联方名称	2006年1月1日至2006年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
a) 股票买卖	本期成交金额	本期成交金额
广发证券	292,797,638.73	159,138,380.66
b) 债券买卖	本期成交金额	本期成交金额
广发证券	96,633,963.30	11,911,242.00
c) 债券回购	本期成交金额	本期成交金额
广发证券	0.00	0.00
d) 基金	本期佣金金额	本期佣金金额
广发证券	239,119.44	129,562.30

本基金于本报告期及2005年同期均无通过主要关联方席位进行权证买卖交易。
说明:
基金交易佣金=股票买卖*佣金费率
沪深交易所佣金=股票买卖*佣金费率*佣金费率
沪市交易所佣金=股票买卖*佣金费率*佣金费率*佣金费率
深交所交易所佣金=股票买卖*佣金费率*佣金费率*佣金费率
向关联方支付的交易佣金采用公允的交易佣金比率计算。关联方席位租用合同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
基金管理人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:
H=1.5%*当年天数
H为每日应支付的基金管理费
R为前一日基金资产净值
基金管理人每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共计人民币9,508,349.37元,2006年同期人民币8,364,840.12元,其中已支付基金管理人人民币7,644,228.06元,尚余人民币1,864,121.32元未支付。
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:
H=E*0.25%*当年天数
H为每日应支付的基金托管费
E为前一日基金资产净值
基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人托管费共计人民币1,584,724.91元,2006年同期人民币1,394,140.04元,其中已支付基金托管人人民币1,274,039.02元,尚余人民币310,685.89元未支付。
(4)与关联方进行的银行间同业市场债券(含回购)交易
本基金于2006年上半年以及2005年同期均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。
(5)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保管,并按银行同业存款利率计息。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:

项目	2006年1月1日至2006年6月30日	2006年1月1日至2006年6月30日
期初持有基金份额	40,001,381	19,999,000
加:本期买入	13,772,387	0
减:本期卖出	0	0
期末持有基金份额	53,773,768	19,999,000
占基金资产净值比例	6.72%	2.50%

基金管理人2006年上半年及2005年同期持有本基金基金份额变动相关的交易费用按交易所公布的基金交易费率计算并支付。
B 基金管理人主要股东及其控制的机构所持有的本基金份额

关联方名称	2006年6月30日	2006年12月31日		
持有基金份额	占基金份额比例	持有基金份额	占基金份额比例	
广东粤财信托投资有限公司	2,030,000	0.25%	1,330,000	0.17%

附注4:报告期末流通转让受到限制的基金资产
本基金截至2006年6月30日止因新股锁定期而流通转让受到限制的资产情况如下:

股票代码	股票名称	数量	总股本	占股本	占净资产	限售期限	受限原因
00088	中信银行	1,241,000	3,322,280,000	0.25%	0.26%	2008年7月5日	新股上市
00204	华微电子	900,000	42,300,000	30%	1.07%	2006年6月25日	新股上市

六、投资组合报告

1. 本报告期末基金投资组合情况

项目	金额(元)	占基金资产净值比例
股票	1,189,416,199.38	75.61%
债券	311,146,518.36	19.79%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	66,991,144.76	4.26%
应收证券清算款	1,206,773.90	0.08%
其他资产	4,233,667.85	0.27%
总计	1,572,192,304.25	100%

2. 报告期末按行业分类的股票投资组合