

裕华证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:博时基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示
本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。

Table with 2 columns: Item and Amount. Rows include 预提费用, 负债合计, 持有人权益, etc.

2. 裕华证券投资基金经营业绩表
2006年1月1日至2006年6月30日止期间 单位:人民币元

Table with 3 columns: Item, 本期数, 上年同期数. Rows include 一、收入, 1. 股票差价收入, 2. 债券差价收入, etc.

3. 裕华证券投资基金收益分配表
2006年1月1日至2006年6月30日止期间 单位:人民币元

Table with 3 columns: Item, 本期数, 上年同期数. Rows include 本期基金净收益, 加:期初基金净收益, 可供分配基金净收益, etc.

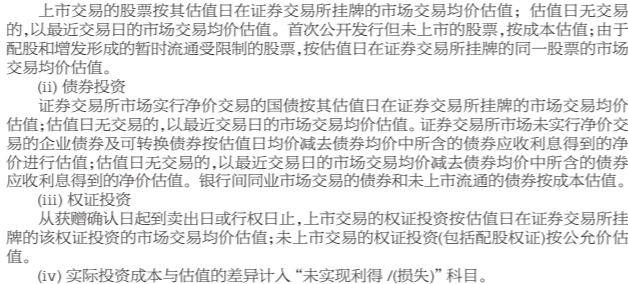
4. 裕华证券投资基金净值变动表
2006年1月1日至2006年6月30日止期间 单位:人民币元

Table with 3 columns: Item, 本期数, 上年同期数. Rows include 期初基金净值, 本期经营活动, 基金净收益, etc.

1. 历史各时间区间基金净值增长率表

Table with 6 columns: 1-6, ①净值增长率, ②净值增长率标准差, etc.

2. 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率的走势图



三、基金管理人报告
(一)基金管理人及基金基金经理简介

博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(二)报告期内基金运作情况摘要
在本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其各项实施细则、《裕华证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

(三)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(四)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(五)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(六)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(七)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(八)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(九)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(十)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(十一)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(十二)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(十三)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

(十四)基金管理人及基金基金经理简介
博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:
日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。

本基金在本期需支付基金托管人托管费757,659.09元(2005年同期:654,420.14元)。
(e)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,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为1,122,320.31元(2005年同期:24,719,756.07元);本期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为44,187.07元(2005年同期:179,078.93元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,于2006年6月30日的相关余额6,766,315.17元计入“清算备付金”科目(2005年同期为12,126,133.11元)。
(d)与关联方通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易
本基金在本报告期内没有与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

(g)基金管理人、股东及实际控制人持有的基金份额
2006年1月1日-2006年6月30日
2006年1月1日-2006年6月30日

3. 流通受限不能自由转让的基金资产
(a) 依照中国证监会《上市公司证券发行管理办法》和《关于首次公开发行股票实行询价制度若干问题的通知》等文件的规定,基金通过网下询价认购的股票,在新股上市后的约定期限内不能自由转让,通过网下申购的增发新股则根据参与申购对象的性质确定所获配股票的流通日期。本基金期末持有的流通受限的新股如下:

Table with 7 columns: 股票名称, 成功申购日期, 上市日期, 可流通日期, 申购价格(元), 期末持仓股数, 期末市值(元), 期末估值(元).

(b) 本基金截至2006年6月30日止持有以下因股权激励或资产重组等原因停牌,且预期将在上市公司完成或与流通股股东的沟通协商程序后或在股权激励规定的程序结束后复牌的:

Table with 7 columns: 股票代码, 股票名称, 停牌日期, 期末持仓股数(股), 复牌日期, 复牌收盘价(元), 期末市值(元), 期末估值(元).

六、投资组合报告
(一)报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例.

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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

(三)报告期末按市值占基金资产净值前10名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 股票数量, 市值占基金资产净值比例.

七、投资组合报告
(一)报告期末基金资产组合情况

Table with 4 columns: 序号, 项目, 金额(元), 占基金总资产的比例.

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

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

(三)报告期末按市值占基金资产净值前10名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 股票数量, 市值占基金资产净值比例.

八、基金管理人报告
(一)基金管理人及基金基金经理简介

博时基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]26号文批准设立。公司股东为中信信托投资股份有限公司、中国长城资产管理公司、招商证券股份有限公司和厦门厦建设计集团有限责任公司,注册资本为1亿元人民币。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例.

3. 报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额.

(五)报告期末按品种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例.

(六)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例.

(七)投资组合报告附注
1. 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内有严重违规行为,受到处罚;
2. 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票;

3. 基金的其他资产包括:交易保证金516,554.04元,应收利息817,173.37元;
4. 报告期末未持有处于转股期的可转换债券;
5. 报告期末本基金没有持有权证投资的投资;

Table with 3 columns: 代码, 名称, 数量(份), 成本总额(元).

6. 报告期内本基金未持有资产支持证券;
7. 由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。
七、基金持有人户数、持有人结构及前十名持有人(截止2006年6月30日)

Table with 2 columns: 基金持有人户数, 平均每户持有基金份额.

(二)基金持有人结构

Table with 3 columns: 机构投资者, 个人投资者, 合计.

(三)基金前十名持有人

Table with 5 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占基金份额的比例.

2. 支付佣金(2006年1月1日至2006年6月30日)

Table with 4 columns: 序号, 券商名称, 支付佣金, 占报告期佣金总额的比例.

3. 证券公司席位变更情况
本基金在报告期内撤销了宏源证券在上交所和深交所的各1个席位,北京证券在上交所的1个席位。

九、备查文件目录
1. 中国证监会批准裕华证券投资基金设立的文件
2. 《裕华证券投资基金基金合同》
3. 《裕华证券投资基金基金托管协议》
4. 基金管理人业务资格批准文件、营业执照和公司章程

5. 裕华证券投资基金各年度审计报告正本
6. 报告期内裕华证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
存放地点:基金管理人、基金托管人处
查阅方式:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件
投资者对本报告如有任何疑问,可咨询本基金管理人博时基金管理有限公司
客户服务中心电话:010-65171156
全国统一客服热线:95105688

基金管理人:博时基金管理有限公司
2006年8月28日