

科讯证券投资基金 2007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2007年8月10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:2007年1月1日至2007年6月30日。
本季度财务数据未经审计。
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。

五、财务会计报告(未经审计)
(一) 基金会计报表
1、资产负债表
科讯证券投资基金
资产负债表
2007年6月30日
单位:人民币元

Table with columns: 关联方名称, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 广发证券, 债券买卖, 广发证券, 债券回购, 广发证券, 权证买卖, 广发证券, 债券买卖, 广发证券.

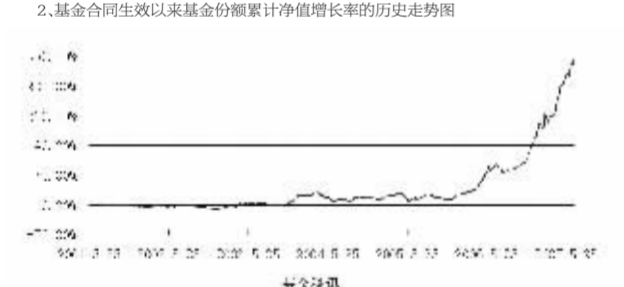
Table with columns: 基金名称, 基金简称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 报告期末基金份额总额, 基金合同存续期限, 基金份额上市证券交易所, 上市日期. Rows include 科讯证券投资基金, 基金简称: 科讯, 基金代码: 500029, etc.

Table with columns: 资产, 负债, 所有者权益. Rows include 银行存款, 清算备付金, 交易保证金, 应收证券清算款, 应收股利, 其他应收款, 股票投资市值, etc.

二、主要财务指标和基金净值表现
(单位:人民币元)
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。

Table with columns: 财务指标, 2007年1月1日至2007年6月30日. Rows include 1.基金本期净收益, 2.基金本期基金份额净值, 3.期末可供分配基金份额收益, etc.

Table with 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, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④. Rows include 过去1个月, 过去3个月, 过去6个月, 过去1年, 过去3年, 基金合同生效至今.



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;
本基金在本期间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。

Table with columns: 基金名称, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 营业收入, 股票差价收入, 债券差价收入, 权证差价收入, 债券利息收入, 存款利息收入, 股利收入, 买入返售证券收入, 其他收入, 费用, 基金管理人报酬, 基金托管费, 基金销售费, 卖出回购证券支出, 利息支出, 其他费用.

科讯证券投资基金
经营业绩表
自2007年1月1日至2007年6月30日止期间
单位:人民币元

Table with columns: 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 收入, 股票差价收入, 债券差价收入, 权证差价收入, 债券利息收入, 存款利息收入, 股利收入, 买入返售证券收入, 其他收入, 费用, 基金管理人报酬, 基金托管费, 基金销售费, 卖出回购证券支出, 利息支出, 其他费用.

科讯证券投资基金
收益分配表
自2007年1月1日至2007年6月30日止期间
单位:人民币元

Table with columns: 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 本期基金净收益, 加:期初基金净收益, 减:本期基金净支出, 可供分配基金净收益, 基本本期已分配基金净收益, 期末基金净收益.

Table with columns: 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 一、期初基金净值, 二、本期经营活动: 基金净收益, 未实现利得, 经营活动产生的基金净值变动数, 三、本期向持有人分配收益, 向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数, 四、期末基金净值.

附注1. 本基金半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。
附注2. 重大会计差错的内容和更正金额
本报告期无重大会计差错。
附注3. 关联方关系及关联方交易
(1) 主要关联方关系

Table with columns: 企业名称, 与本基金的关系. Rows include 易方达基金管理有限公司(基金管理人), 交通银行股份有限公司(基金托管人), 广发证券股份有限公司(基金管理人股东), etc.

本报告期经易方达基金管理有限公司(以下简称“本公司”)2007年第一次临时股东大会审议通过,并报经中国证监会证监基金字[2007]75号文批准,重庆国际信托投资有限公司将其持有的本公司股权(占本公司总股本16.67%)全部转让给广东省广晟资产经营有限公司。此次股权转让的交易变更登记手续已办理完毕。
本次股权转让后,广东粤财信托投资有限公司、广发证券股份有限公司、广东美的电器

说明:
基金交易佣金的计算方法如下:
沪市交易佣金=股票买(卖)成交金额*1%-股票买(卖)手续费(买卖成交金额*0.11%)-股票买(卖)证管费(买卖成交金额*0.04%)-证券结算风险金(股票成交金额*0.03%+国债现货成交金额*0.01%+国债回购金额*相应费率)
深市交易佣金=股票买(卖)成交金额*1%-股票买(卖)手续费(买卖成交金额*0.1875%)-证券结算风险金(股票成交金额*0.03%+国债现货成交金额*0.01%+国债回购金额*相应费率)
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:
H=E*1.5%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值
基金管理人报酬按日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前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16,113,197.17元(2006年1-6月人民币8,203,202.15元),其中已支付基金管理人人民币13,133,266.70元,尚余人民币2,979,940.47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前两个工作日内从基金资产中一次性支付。本基金于本期应支付基金托管人托管费共计人民币2,685,532.98元(2006年1-6月人民币1,367,200.29元),其中已支付基金托管人人民币2,188,876.22元,尚余人民币496,656.76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
本报告期及2006年同期间本基金均无通过关联方进行的银行间同业市场债券(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,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:

Table with columns: 关联方名称, 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 银行存款余额, 银行存款产生的利息收入, 6) 本基金参与关联方承销证券的情况, 7) 关联方投资本基金的情况.

Table with columns: 2007-6-30, 2006-6-30. Rows include 银行存款余额, 银行存款产生的利息收入, 6) 本基金参与关联方承销证券的情况, 7) 关联方投资本基金的情况.

Table with columns: 2007年1月1日至2007年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期买入, 减:本期卖出, 期末持有基金份额, 基金管理人持有基金份额占期末基金份额总额的比例, 6) 本基金参与关联方承销证券的情况, 7) 关联方投资本基金的情况.

Table with columns: 2007年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 广发证券股份有限公司, 附注1. 报告期末流通受限的基金资产无.

Table with columns: 项目名称, 金额(元), 占基金资产总额比例. Rows include 股票, 权证, 债券, 银行存款和清算备付金合计, 应收证券清算款, 其他资产, 总计.

Table with columns: 行业类别, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include A.农林、牧、渔, B.采掘业, C.制造业, D.食品饮料, E.医药生物, F.交通运输、仓储业, G.信息技术, H.批发和零售贸易, I.金融、保险业, J.房地产业, K.社会服务业, L.传播与文化业, M.综合类, 合计.

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1. 000061 中国重汽, 2. 000886 双汇发展, 3. 600519 贵州茅台, 4. 600896 金龙汽车, 5. 601288 中国人寿, 6. 600030 中信证券, 7. 600377 美菱股份, 8. 600000 浦发银行, 9. 600799 大通银行, 10. 600428 中远航运.

Table with columns: 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比例. Rows include 1. 600019 宝钢股份, 2. 601288 中国人寿, 3. 600030 中信证券, 4. 600006 鲁商置业, 5. 600000 浦发银行, 6. 601288 中国人寿, 7. 000717 韶钢松山, 8. 000729 燕京啤酒, 9. 600000 浦发银行, 10. 601288 中国人寿, 11. 600019 宝钢股份, 12. 600000 浦发银行, 13. 600519 贵州茅台, 14. 600000 浦发银行, 15. 600799 大通银行, 16. 002131 宝通软件, 17. 002128 属天兴业, 18. 600307 赛迪股份, 19. 002131 宝通软件, 20. 002131 宝通软件.

Table with 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. Rows include 1. 600019 宝钢股份, 2. 600729 燕京啤酒, 3. 600006 鲁商置业, 4. 000886 双汇发展, 5. 600519 贵州茅台, 6. 601288 中国人寿, 7. 600896 金龙汽车, 8. 600030 中信证券, 9. 000625 长安汽车, 10. 600315 上海家化, 11. 000661 中国重汽, 12. 000629 攀钢钒钛, 13. 000639 粤电力A, 14. 601003 柳钢股份, 15. 601288 中国人寿, 16. 601972 招商轮船, 17. 000877 云铝股份, 18. 601318 中国平安, 19. 000002 万科A, 20. 600000 长江电力.

Table with columns: 项目, 金额(元). Rows include 买入股票的成本总额, 卖出股票的收入总额.

Table with columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1. 金融债券, 2. 国债, 3. 央行票据, 4. 企业债券, 5. 可转债, 合计.

Table with columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占基金资产净值比例. Rows include 1. 06双发11, 2. 06国开12, 3. 06国开18, 4. 07国开01, 5. 06双发08, 合计.

7. 投资组合报告附注
(1) 投资者欲了解本报告期内本基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于基金管理人网站www.efunds.com.cn的半年度报告正文。
(2) 本报告期内前十名股票的投资主体本期未出现被监管部门立案调查的情况, 报告编制前一年内未受到公开谴责或处罚。
(3) 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
(4) 其他资产:

Table with columns: 名称, 金额(元). Rows include 交易保证金, 应收股利, 应收利息, 待摊费用, 其他资产, 合计.

(5) 本报告期末基金持有的处于转股期的可转换债券明细
本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券
(6) 本报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细
权证代码, 权证名称, 数量(份), 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例.

(7) 报告期内获得的权证明细
权证代码, 权证名称, 数量(份), 成本总额, 投资类别. Rows include 600013 武钢CW81, 合计.

(8) 本报告期末投资资产支持证券的情况
本报告期末本基金未投资资产支持证券。
七、基金持有人户数情况
基金份额持有人户数:
报告期末基金份额持有人户数: 26,046户
报告期末平均每户持有的基金份额: 31,941.23份

Table with columns: 类型, 持有基金份额, 占已发行份额. Rows include 基金份额总额, 其中:机构投资者持有的基金份额, 个人投资者持有的基金份额.

Table with columns: 序号, 持有人名称, 期末持有份额, 持有比例. Rows include 1. 新华人寿保险股份有限公司, 2. 中国人寿保险股份有限公司, 3. 中国人寿保险(集团)公司, 4. 易方达基金管理有限公司, 5. 太平人寿保险有限公司, 6. 招商证券股份有限公司-招商银行股份有限公司-招商证券基金宝集合资产管理计划, 7. 华夏银行股份有限公司, 8. 中国平安人寿保险股份有限公司, 9. 新华人寿保险股份有限公司-分红-个人分红, 10. UBS AG.

八、重大事项揭示
1. 本报告期内未召开基金份额持有人大会。
2. 本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门未发生重大人事变动。
3. 报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。
4. 报告期内本基金的投资策略、本基金管理人的内部决策程序未有重大变化。
5. 本报告期内基金收益分配情况

Table with columns: 序号, 分红公告日, 权益登记日, 每10份基金份额应分派金额(元), 收益分配金额(元). Rows include 第1次分红, 第2次分红, 第3次分红, 累计收益分配金额.

6. 本报告期内本基金未改聘会计师事务所。
7. 本报告期内基金管理人及托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。
8. 本基金租用专用交易席位的情况
本基金租用中国证券监督管理委员会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》(证监基金[1998]29号)的有关规定要求及本基金管理人的《基金专用交易席位租用制度》, 决定租用东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、中信建投证券有限责任公司各两个交易席位, 国泰君安证券股份有限公司、华泰证券有限责任公司、天同证券有限责任公司、湘财证券有限责任公司、东北证券有限责任公司、东海证券有限责任公司、红塔证券股份有限公司各一个交易席位。本报告期无新增或减少交易席位。

Table with columns: 基金名称, 数量(股), 市值(元), 持仓比例, 期初持仓比例, 持仓比例变动, 持仓比例变动原因, 持仓比例变动原因, 持仓比例变动原因. Rows include 新华人寿, 中国人寿, 招商证券, 广发证券, 华夏银行, 中国平安, 新华人寿, 华泰证券, 天同证券, 湘财证券, 东北证券, 东海证券, 红塔证券, 合计.

9. 本报告期基金披露过的其他重要事项:
公告事项, 披露日期. Rows include 易方达基金管理有限公司关于修改封闭式基金收益分配条款的公告, 科讯证券投资基金收益分配公告, 对市场出现冒用我名义进行非法证券活动特别提示, 科讯证券投资基金2006年度收益分配公告, 关于旗下基金赎回款项可转回的公告, 易方达基金管理有限公司关于股权转让的公告, 关于五一假期易方达基金管理有限公司网站和客户服务热线暂停使用的公告, 易方达基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告, 科讯证券投资基金收益分配公告.

注: 上述公告均披露于中国证券报、上海证券报、证券时报
易方达基金管理有限公司
2007年8月25日