

融鑫证券投资基金 2007年半年度报告摘要

基金管理人: 国投瑞银基金管理有限公司 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、基金托管人及基金销售机构在本基金合同生效后, 均应当按照基金合同的约定, 履行各自职责。

2007年上半年, 融鑫证券投资基金的基金管理人——国投瑞银基金管理有限公司在融鑫证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面, 不存在任何损害基金份额持有人利益的行为, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对国投瑞银基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的融鑫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进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司 2007年6月15日

五、财务会计报告(未经审计)
(一) 半年度会计报表

融鑫证券投资基金 资产负债表 2007年6月30日
单位: 人民币元
资产: 银行存款 17,028,012.29 12,554,202.18
清算备付金 1,967,768.66 8,050,557.36
交易保证金 1,641,160.68 1,098,790.49

融鑫证券投资基金 资产负债表(续) 2007年6月30日
单位: 人民币元
负债: 应付证券清算款 -- --
应付赎回款 -- --
应付赎回费 -- --

融鑫证券投资基金 资产负债表(续) 2007年6月30日
单位: 人民币元
所有者权益: 基金本期净收益 657,989,961.84
加: 期初未分配收益 8,822.33

融鑫证券投资基金 经营业绩表 自2007年1月1日至2007年6月30日
单位: 人民币元
一、收入: 1,832,769,798.81
二、费用: 1,832,769,798.81
三、基金销售服务费 -- --
四、卖出回购证券支出 1,827,232.12

融鑫证券投资基金 基金收益分配表 自2007年1月1日至2007年6月30日
单位: 人民币元
项目 附注 2007-01-01至2007-06-30 2006-01-01至2006-06-30

融鑫证券投资基金 基金收益分配表 自2007年1月1日至2007年6月30日
单位: 人民币元
项目 附注 2007-01-01至2007-06-30 2006-01-01至2006-06-30
一、收入: 1,832,769,798.81
二、费用: 1,832,769,798.81

融鑫证券投资基金 基金收益分配表 自2007年1月1日至2007年6月30日
单位: 人民币元
项目 附注 2007-01-01至2007-06-30 2006-01-01至2006-06-30
一、收入: 1,832,769,798.81

融鑫证券投资基金 基金收益分配表 自2007年1月1日至2007年6月30日
单位: 人民币元
项目 附注 2007-01-01至2007-06-30 2006-01-01至2006-06-30
一、收入: 1,832,769,798.81

融鑫证券投资基金 基金收益分配表 自2007年1月1日至2007年6月30日
单位: 人民币元
项目 附注 2007-01-01至2007-06-30 2006-01-01至2006-06-30
一、收入: 1,832,769,798.81

易情况列示如下:

关联方名称 2007-01-01至2007-06-30 2006-01-01至2006-06-30
1. 股票投资交金额 15,427,194.06 7,807,351.25

* 上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立, 有关交易佣金的计算方式及佣金比率与其他关联方交易佣金的计算方式及佣金比率一致。

除进行证券交易外, 还包括佣金收取方式为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方名称 本期数 上期数 计算标准 计算方式
国投瑞银基金管理有限公司(管理人) 15,427,194.06 7,807,351.25 费率15% 按前一基金资产净值乘以费率每天计提

除进行证券交易外, 还包括佣金收取方式为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方名称 期初持有份额 本期增加份额 本期减少份额 期末持有份额 占总额比例
国投瑞银基金管理有限公司(管理人)* 22,674,461 --- --- 22,674,461 28%

* 除本基金管理人以外, 本基金管理人股东国投信托投资有限公司及其控制的其他机构本期及上期均未投资本基金。

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管, 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:

项目 期末数 期初数
银行存款 17,028,012.29 12,554,202.18

本基金截至2007年6月30日止, 未流通受限不能自由转让的基金资产如下:

股票名称 数量(股) 总资产(元) 总市值(元) 受限期间 估值方法 转让受限原因
农产品 1,661,960 17,800,886.67 36,616,042.00 自2007-05-08起至基金有关信息披露日 按估值日在证券交易所前一交易日的收盘价估值

本基金运用证券交易所上市的债券进行质押式债券回购交易, 于2007年6月30日, 涉及该等回购交易的标准券金额为人民币45,000,000.00元, 该金额相关的债券部分在约定的回购到期日(2007年7月2日)前暂时无法流通。

资产项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)
股票资产(市值) 1,832,769,798.81 76.52

本基金截至2007年6月30日止, 未流通受限不能自由转让的基金资产如下:

行业分类 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔业 --- ---

行业分类 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)
A 农林、牧、渔业 --- ---
B 采掘业 114,405,798.37 4.88

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应查阅登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的半年度报告正文。

(四) 股票投资组合的重大变动(2007年1月1日至2007年6月30日期间)

序号 股票代码 股票名称 累计买入金额(元) 占期初基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38

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(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应查阅登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的半年度报告正文。

(四) 股票投资组合的重大变动(2007年1月1日至2007年6月30日期间)

序号 股票代码 股票名称 累计买入金额(元) 占期初基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38

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(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38

3. 买入股票成本总额及卖出股票收入总额
项目 2007-01-01至2007-06-30
买入股票成本总额 932,065,927.58

债券投资组合
券种项目 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)
国债 194,188,908.50 8.28

* 注: 本基金持有的金融债中有311,613,750.00元为可计入国债投资比例的政策性金融债, 市值占基金资产净值比例为13.29%。

序号 债券名称 债券期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)
1 07进出02 159,879,200.00 6.82

(七) 投资组合报告附注
1. 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查, 且在报告编制前一年内未受到公开谴责、处罚。

2. 基金投资的前十名股票均属于基金合同规定备选股票库之内的股票。

项目 期末金额(元)
应收利息 6,481,632.33

4. 报告期末基金没有投资权证。

基金份额持有人户数、持有人结构
项目 期末持有人结构
基金份额持有人户数 31,964

基金份额持有人户数、持有人结构
项目 期末持有人结构
基金份额持有人户数 31,964

注: 以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

(二) 前十名持有人情况(截止2007-6-30):

序号 持有人名称 持有份额(基金单位) 持有比例(%)
1 新华人寿保险股份有限公司 77,407,980 9.68

注: 以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供。

八、重大事件提示
(一) 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在本基金合同生效后, 均应当按照基金合同的约定, 履行各自职责。

国投瑞银基金管理有限公司第一届董事会第十三次会议审议通过, 同意董日成先生辞去公司副总经理职务, 该事项已按规定向中国证监会和深圳证监局报告, 并于2007年1月6日在中国证监会指定媒体公告。

(二) 基金投资的变更
因工作调整, 免去马志新先生本基金基金经理的职务, 聘请Jin Yi(靳奕)女士任本基金基金经理, 该事项已于2007年2月1日在指定媒体公告并在中国证监会备案。

(三) 基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(四) 本基金管理人股东持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人股东UBS AG于本报告期增持本基金份额6,674,014份, 合计持有本基金29,117,847份, 占本基金总份额的36.94%。

序号 分红除权日期 基金份额分配金额 总收益分配金额
1 2007-2-15 0.1800 144,000,000.00

(六) 本报告期内无涉及本基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门立案调查。

(一) 本基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(二) 本基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(三) 基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(四) 本基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(五) 基金收益分配情况

序号 分红除权日期 基金份额分配金额 总收益分配金额
1 2007-2-15 0.1800 144,000,000.00

(六) 本报告期内无涉及本基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼事项, 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门立案调查。

(一) 本基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(二) 本基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(三) 基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

(四) 本基金管理人持有本基金基金份额的情况说明
本基金管理人于2006年第四季度运用自有资金增持本基金份额17,674,461份, 合计持有本基金22,674,461份, 占本基金总份额的2.83%。

序号 证券公司名称 期末市值(元) 市值占基金资产净值比例(%)
1 国投瑞银基金管理有限公司 420,498,524.45 18.07%

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应查阅登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的半年度报告正文。

(四) 股票投资组合的重大变动(2007年1月1日至2007年6月30日期间)

序号 股票代码 股票名称 累计买入金额(元) 占期初基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应查阅登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的半年度报告正文。

(四) 股票投资组合的重大变动(2007年1月1日至2007年6月30日期间)

序号 股票代码 股票名称 累计买入金额(元) 占期初基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应查阅登载于国投瑞银基金管理有限公司网站(http://www.ubssdic.com)的半年度报告正文。

(四) 股票投资组合的重大变动(2007年1月1日至2007年6月30日期间)

序号 股票代码 股票名称 累计买入金额(元) 占期初基金资产净值比例(%)
1 600036 招商银行 62,230,143.40 3.38