

国投瑞银创新动力股票型证券投资基金 2007 年半年度报告摘要

(上接 A72 版)

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

4.重大会计差错及更正

本报告期内未发生重大会计差错。

5.关联方关系及其交易

(1)主要关联方关系

Table with 2 columns: 企业名称, 与本基金的关系. Lists related parties like 国投瑞银基金管理有限公司, 中国光大银行股份有限公司, etc.

下述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

本基金于报告期内没有通过关联方席位进行的交易。

(3)关联方报酬

A.基金管理人报酬

(a)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

(b)基金管理费每日计算,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给基金管理人。本基金于本期应支付基金管理人管理费共人民币 32,970,329.90 元,其中已支付基金管理人人民币 24,570,928.57 元,尚余人民币 8,399,401.33 元未支付。

B.基金托管人报酬

(a)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

(b)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给基金管理人。本基金于本期应支付基金托管人托管费共人民币 5,495,055.01 元,其中已支付基金托管人人民币 4,095,154.80 元,尚余人民币 1,399,900.21 元未支付。

(4)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中国光大银行保管,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:

Table with 3 columns: 银行存款余额, 自 2006 年 11 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2007 年 6 月 30 日期间, 银行存款产生的利息收入.

(5)与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易 本基金本报告期间没有与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

(6)关联方持有份额

本基金管理人及基金管理人股东及其控制的机构于本报告期间均未持有本基金份额。

6.报告期末流通转让受到限制的基金资产

本报告期末基金未持有流通受限的基金资产。

六、基金投资组合报告(截止 2007 年 6 月 30 日)

(一)基金资产组合情况

Table with 3 columns: 资产项目, 期末金额(元), 占基金总资产的比例(%). Includes 股票合计, 债券合计, 货币合计, etc.

(二)按行业分类的股票投资组合

Table with 3 columns: 行业分类, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists sectors like A 农林牧渔, B 采掘业, etc.

Table with 5 columns: C1 纺织、服装、皮毛, C2 木材、家具, C3 造纸、印刷, etc. Lists various industry categories and their values.

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists top 10 stocks like 招商银行, 中信证券, etc.

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读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(2006-11-15 [基金合同生效日]至 2007-06-30 期间)

1. 累计买入价值超出期末基金资产净值 2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计买入金额(元), 占期末基金资产净值比例(%). Lists stocks like 招商银行, 中信证券, etc.

2. 累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额(元), 占期末基金资产净值比例(%). Lists stocks like 招商银行, 万科 A, etc.

Table with 5 columns: 3, 4, 5, 6, 7, 8, 9, 10, 11, 12, 13, 14, 15, 16, 17, 18, 19, 20. Lists various stocks and their values.

3. 买入股票成本总额及卖出股票收入总额

Table with 2 columns: 项目, 自 2006 年 11 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2007 年 6 月 30 日期间. Lists 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额.

(五)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,且在报告编制日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。

3.其他资产构成

Table with 2 columns: 项目, 期末金额(元). Lists 应收申购款, 交易保证金, 应收股利, 应收利息, 合计.

七、基金份额持有人户数、持有人结构

Table with 5 columns: 基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额, 占总份额比例.

八、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 份额. Lists 基金合同生效日基金份额总额, 期初基金份额总额, etc.

注:本基金报告期内本基金于 2006 年 11 月 15 日合同生效,于 2006 年 12 月 6 日开放基金申购,于 2007 年 1 月 31 日开放基金赎回,于 2007 年 4 月 9 日进行基金份额拆分。

九、重大事件揭示

(一)基金管理人的高管人员变更 经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。该事项已于 2007 年 1 月 6 日在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

(二)基金经理的变更 1.因工作需要,国投瑞银基金管理有限公司决定聘请 Jin Yin(靳奕)女士担任国投瑞银创新动力股票型证券投资基金基金经理,与现任基金经理陈剑平先生共同管理基金。该事项已于 2007 年 2 月 1 日在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

2.因工作需要,国投瑞银基金管理有限公司决定由 Jin Yin(靳奕)女士单独担任国投瑞银创新动力股票型证券投资基金基金经理,陈剑平先生不再担任国投瑞银创新动力股票型证券投资基金基金经理。该事项已于 2007 年 4 月 28 日在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

(三)本基金管理公司的基金从业人员持有本基金份额情况 截至本报告期末,本基金管理公司的基金从业人员持有本基金份额 59916.14 份,占本基金总份额比例为 0.0011%。

(四)基金收益分配情况

Table with 4 columns: 序号, 分红除权日期, 基金份额分配金额, 收益分配金额. Lists 1, 2007-1-30, 0.080, 136,686,008.46, etc.

国投瑞银景气行业证券投资基金 2007 年半年度报告摘要

(上接 A74 版)

2. 累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 累计卖出金额(元), 占期初基金资产净值比例(%). Lists stocks like 中信证券, 万科 A, etc.

Table with 5 columns: 61, 62, 63, 64, 65, 66, 67, 68, 69, 70, 71, 72, 73. Lists various stocks and their values.

3. 买入股票成本总额及卖出股票收入总额

Table with 2 columns: 项目, 2007-01-01至 2007-06-30. Lists 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额.

(一)按券种分类的债券投资组合

Table with 3 columns: 券种项目, 期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists 国债, 金融债, 央行票据, etc.

*注:本基金持有的金融债中有 449,423,195.00 元政策性金融债及央行票据均可计入国债投资比例,市值占基金资产净值比例为 19.23%。

(六)债券投资前五名债券明细

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 债券期末市值(元), 市值占基金资产净值比例(%). Lists 05国开 07, 06农发 13, etc.

(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,且在报告编制日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。

3.其他资产构成

Table with 2 columns: 项目, 期末金额(元). Lists 应收利息, 交易保证金, 应收申购款, 应收股利, 合计.

4.报告期末基金未主动投资权证,因本期申购可分离交易债券获配的权证本期变动明细见下表:

Table with 4 columns: 序号, 权证名称, 获配数量(股), 本期卖出数量(股), 卖出差价收入(元). Lists 1, 武钢 CWB1, 239,978, 0, 0.

七、基金份额持有人户数、持有人结构

Table with 5 columns: 基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额, 机构投资者持有份额, 个人投资者持有份额, 占总份额比例.

八、开放式基金份额变动

Table with 2 columns: 项目, 份额. Lists 基金合同生效日基金份额总额, 期初基金份额总额, etc.

九、重大事件揭示

(一)基金管理人的高管人员变更 经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。该事项已于 2007 年 1 月 6 日在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

(二)基金经理的变更 1.因工作需要,国投瑞银基金管理有限公司决定由陈剑平先生单独担任国投瑞银景气行业证券投资基金基金经理,与现任基金经理陈剑平先生共同管理基金。该事项已于 2007 年 3 月 16 日在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

3.因工作需要,国投瑞银基金管理有限公司决定由袁野先生单独担任国投瑞银景气行业证券投资基金基金经理,陈剑平先生不再担任国投瑞银景气行业证券投资基金基金经理。该事项已于 2007 年 4 月 28 日在中国证监会指定媒体公告并报中国证监会备案。

(三)本基金管理公司的基金从业人员持有本基金份额情况 截至本报告期末,本基金管理公司的基金从业人员持有本基金份额 70452.03 份,占本基金总份额比例为 0.0038%。

(四)基金收益分配情况

Table with 4 columns: 序号, 分红除权日期, 基金份额分配金额, 收益分配金额. Lists 1, 2007-1-18, 1.1984, 389,776,729.79, etc.

(五)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稽查或处罚。

(六)本基金托管人在本报告期内无重大人事变动。

(七)为本基金提供审计服务的会计师事务所情况 本报告期内本基金未更换会计师事务所,仍由安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。

(八)本基金租用专用交易席位事宜的情况 报告期内,本基金通过各证券公司专用交易席位进行的股票、债券及回购交易、佣金和席位租用变化情况如下:

Table with 3 columns: 证券公司名称, 租用席位数量, 合计. Lists 国泰君安证券股份有限公司, 申银万国证券股份有限公司, etc.

2. 股票交易情况

Table with 3 columns: 证券公司名称, 股票成交金额, 占成交总额比例. Lists 中国国际金融有限公司, 中国银河证券股份有限公司, etc.

3. 债券交易情况:本报告期内未发生债券交易

4. 回购交易情况:本报告期内未发生交易所回购交易

5. 佣金情况

Table with 3 columns: 证券公司名称, 应付佣金, 占佣金总额比例. Lists 中国国际金融有限公司, 中国银河证券股份有限公司, etc.

6. 席位租用变化情况:

本基金于报告期内合同生效,交易席位全部为本期新租用的席位。(九)其他重要事项 除上述事项外,本报告期内发生的其他重要事项如下:

Table with 3 columns: 事项名称, 披露及备案日期, 信息披露报纸. Lists 关于基金合同生效公告, 关于基金开放日常申购业务公告, etc.

十、备查文件目录

(一)《关于国投瑞银创新动力股票型证券投资基金募集的批复》(证监基金字[2006]189 号)

(二)《关于国投瑞银创新动力股票型证券投资基金备案确认的函》(基金部函[2006]283 号)

(三)《国投瑞银创新动力股票型证券投资基金基金合同》

(四)《国投瑞银创新动力股票型证券投资基金托管协议》

(五)国投瑞银基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

(六)本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

(七)国投瑞银创新动力股票型证券投资基金 2007 年半年度报告原文 查阅地点:深圳市福田区深南大道投资大厦第三层 网址:http://www.ubssdic.com

国投瑞银基金管理有限公司

二零零七年八月二十七日

Table with 3 columns: 证券公司名称, 债券成交金额, 占成交总额比例. Lists 国泰君安证券股份有限公司, 中信建投证券股份有限公司, etc.

4. 回购交易情况:

Table with 3 columns: 证券公司名称, 回购成交金额, 占成交总额比例. Lists 申银万国证券股份有限公司, 国泰君安证券股份有限公司, etc.

5. 佣金情况

Table with 3 columns: 证券公司名称, 应付佣金, 占佣金总额比例. Lists 国泰君安证券股份有限公司, 申银万国证券股份有限公司, etc.

6. 席位租用变化情况:

Table with 3 columns: 券商名称, 席位变化情况, 新增上海席位, 剔除上海席位. Lists 联合证券有限责任公司, 天一证券有限责任公司.

(九)其他重要事项 除上述事项外,本报告期内发生的其他重要事项如下:

Table with 3 columns: 事项名称, 披露及备案日期, 信息披露报纸. Lists 关于分红与暂停大额申购及基金转换业务公告, 关于开展基金费率优惠活动公告, etc.

十、备查文件目录

(一)《关于同意中融景气行业证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2004]28 号)

(二)《关于国投瑞银基金管理有限公司管理的开放式基金变更名称的函》(基金部函[2005]266 号)

(三)《国投瑞银景气行业证券投资基金基金合同》

(四)《国投瑞银景气行业证券投资基金托管协议》

(五)国投瑞银景气基金管理有限公司营业执照、公司章程及基金管理人业务资格批件

(六)本报告期内在中国证监会指定信息披露报刊上披露的信息公告原文

(七)国投瑞银景气行业证券投资基金 2007 年半年度报告原文 查阅地点:深圳市福田区深南大道投资大厦第三层 网址:http://www.ubssdic.com

国投瑞银基金管理有限公司

二零零七年八月二十七日