海富通精选证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人名称:海富通基金管理有限公司 基金托管人名称:交通银行股份有限公司

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。本半年度报告已经董事会全体独立董事签字同意,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 22 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。

本报告财务资料未经审计。

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,应阅读半年度报告正文。

第一章:基金简介

一、基金简称:海富通精选

交易代码:519011

运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2003 年 8 月 22 日

报告期末基金份额总额:1,488,080,207.24 份

二、基金投资目标:本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略,实施全程风险管理,在保证资产良好流动性的前提下,在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。

基金投资策略:本基金的投资策略分两个层次:第一层次为适度主动的资产配置,以控制或规避市场系统性风险;第二层次为积极主动的精选证券,以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。

业绩比较基准:上证综合指数×65%+上证国债指数×35%

风险收益特征:本基金属于证券投资基金中风险程度适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券,识别和控制风险,实现风险限度内的超额回报。

三、基金管理人名称:海富通基金管理有限公司

信息披露负责人:奚万荣

联系电话:021-68604999-591

传真:021-50479057

电子邮箱:wrxi@hftfund.com

四、基金托管人名称:交通银行股份有限公司

信息披露负责人:张咏东

联系电话:021-68888917

传真:021-58408836

电子邮箱:zhangyd@bankcomm.com

五、登载本报告正文的基金管理人互联网网址:http://www.hftfund.com

本报告置备地点:基金管理人及基金托管人的住所

第二章:主要财务指标和基金净值表现

一、主要财务指标

1.	基金本期净收益(人民币元)	604,859,062.14
2.	加权平均基金份额本期净收益(人民币元)	0.3403
3.	期末可供分配基金份额收益(人民币元)	0.1898
4.	期末基金资产净值(人民币元)	2,190,778,468.52
5.	期末基金份额净值(人民币元)	1.4722
6.	本期基金份额净值增长率	56.61%

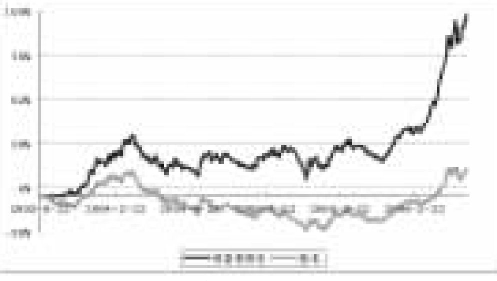
注:以上财务指标中"本期"指 2006 年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日止期间,所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、基金净值表现

1、本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表:

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)	业绩比较基准标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去 1 个月	3.83%	1.38%	1.03%	1.11%	2.80%	0.27%
过去 3 个月	37.42%	1.31%	18.08%	1.12%	19.34%	0.19%
过去 6 个月	56.61%	1.05%	27.48%	0.92%	29.13%	0.13%
过去 1 年	68.76%	0.91%	35.33%	0.84%	33.43%	0.07%
自基金合同生效起起至今	98.87%	0.94%	14.79%	0.87%	84.08%	0.07%

2、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图:



注:按照本基金合同规定,本基金自 2003 年 8 月 22 日成立起至 2004 年 2 月 22 日为建仓期。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十八条(三)、(六)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

第三章:管理人报告

第一节:基金管理人及基金经理情况

一、基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准,由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。本海富通精选证券投资基金是基金管理人管理的第一只开放式基金;除本基金外,基金管理人目前还管理着另外四只开放式基金——海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金。

二、基金经理简介

陈洪先生,清华大学管理学硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003 年至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选证券投资基金基金经理、海富通股票证券投资基金基金经理、海富通收益增长基金基金经理,2006 年 5 月起,任海富通基金管理有限公司副总经理。

郑拓先生,CFA,美国芝加哥大学 MBA。历任黑龙江省进出口公司业务代表,君安证券公司黑龙江公司投资经理,广达投资公司投资经理,加拿大 Donier International 企业融资经理,美国 Robert W. Baird 投资银行基金分析师。2003 年 7 月加入海富通基金管理公司,任投资部股票分析师。2004 年 4 月起担任海富通精选证券投资基金基金经理助理。2005 年 4 月起担任海富通精选证券投资基金基金经理,2005 年 7 月起,兼任海富通股票证券投资基金基金经理,2006 年 5 月起,兼任海富通强化回报混合型证券投资基金基金经理。

第二节:报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《海富通精选证券投资基金基金合同》、《海富通精选证券投资基金基金招募说明书》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

第三节:报告期内基金投资策略和业绩表现的说明

二零零六年上半年,以上证综指为代表的 A 股市场呈现大幅上涨的态势,仅 3 月初和 6 月初指数出现短暂回调,半年累计上涨幅度达到 44%,上涨幅度之大近年少见。中国宏观经济强劲的增长势头和股权分置改革彻底扭转了长年以来资本市场的悲观预期,A 股市场投资价值得到了 QFII 和国内社会资金的普通认同,构为 A 股市场持续上涨的根源。但在海外证券市场大幅回落、国际金属价格大幅波动、政府加息及地产等调控政策的影响下,5 月中旬之后 A 股市场呈现出宽幅震荡的格局。就债券市场而言,06 年一季度债市继续资金拉升行情,二季度开始随着宏观经济政策以及市场资金面的松紧,债券市场大幅波动。行业方面,天相 33 个行业指数中,除了石化、钢铁、电力、房地产等权重板块上涨幅度低于指数涨幅外,24 个行业指数涨幅都超过 44%,食品、有色、日用化工、机械四个行业指数涨幅甚至超过了 100%。

二零零六年一至六月份,A 股市场出现普涨行情,800 多家上市公司股价上涨幅度超过了上证综指。有色金属、机械装备、食品饮料等行业和新能源、军工、天津开发等主题都提供了众多投资机会。此外,股权分置改革后大股东、管理层和流通股东利益结合达到了前所未有的紧密,上市公司业绩承诺和大股东资产注入计划都意味着利润提升和释放的动力得到大大提升,上市公司价值中枢也因此得到明显提高,个股行情此起彼伏,成为市场持续活跃的基石。基于上述市场状况,海富通精选基金一直保持相对比较基准较高的仓位水平,充分发挥自下而上选择个股的风格,挖掘价值低估品种获取超额收益。债券投资上,海富通精选基金采取主动防御、规避风险的策略,保持较低的债券比例,投资高流动性品种。5–6 月,随着 A 股市场的大幅震荡海富通精选基金净值也出现了波动,6 月中旬之后上证综指重新活跃基金净值也创出此轮上涨的新高

报告期内,海富通精选基金净值上涨 56.61% ,同期业绩基准上涨 27.48%,超额收益为 29.13%。

第四节:简要展望

海富通认为, 虽然对中国经济走势的判断还需要未来两季度宏观数据进一步支持,但可能性较大的情形是投资等宏观指标有所回落,但仍然能维持在较高水平,面对宏观经济高速增长,政府可能会出台升值、加息等调控政策来抑制经济过快增长,但"硬着陆"风险预计相对有限。以此为背景,上市公司盈利平均水平依然有望保持相对较快增长。

股权分置改革已经取得了阶段性的重大成果,中国证券市场正面临划时代的新历史时刻。全流通后随着市值考核、股权激励等的逐步落实,大股东、管理层利益将直接和上市公司股价挂钩,为做大作强上市公司提供了制度上的保障,由此将涌现一批具备投资价值的上市公司,个股行情势必会此起彼伏。当然,前期大幅上涨引发的估值提高、高油价等诱发的全球经济放缓预期、加息等政府宏观调控政策的出台也都给未来 A 股市场整体走势带来了诸多的不确定性。至于债券投资,预期央行将继续收紧银根,加息预期逐渐浓厚,市场利率、尤其是中长端利率仍有较大的上升空间,海富通精选基金将继续执行短久期的防御策略。

第四章:托管人报告

2006 年上半年,托管人在海富通精选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,海富通基金管理有限公司在海富通精选证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现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, 由海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通精选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。

第五章:财务会计报告

第一节:半年度会计报表

一、资产负债表

2006年 6 月 30 日资产负债表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	附注	2006年 6 月 30 日	2005年 12 月 31 日
资产			
银行存款		102,132,437.44	12,024,340.27
结算备付金		285,746,362.84	107,457,572.86
交易保证金		1,362,698.42	1,312,500.00
应收证券清算款		13,628,328.77	10,446,412.26
应收股利		1,712,700.00	0.00
应收利息	1	6,637,316.35	3,543,142.15
应收申购款		850,938.93	220,782.76
股票投资市值		1,623,533,098.10	1,859,474,473.34
其中:股票投资成本		1,100,708,738.06	1,709,997,420.36
债券投资市值		443,518,880.50	529,669,063.00
其中:债券投资成本		444,674,697.91	530,418,413.60
权证投资市值		0.00	0.00
其中:权证投资成本		0.00	0.00
资产总计		2,479,122,761.35	2,524,148,286.64
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		198,341,030.62	0.00
应付赎回款		2,240,270.70	7,600,761.32
应付赎回费		2,498.96	10,392.65
应付管理人报酬		2,587,158	3,182,429.51
应付托管费		431,193.00	530,404.92
应付佣金	2	1,769,457.10	1,108,710.49
应付利息		19,017.15	0.00
其他应付款	3	733,987.60	733,987.60
卖出回购证券款		82,000,000.00	0.00
预提费用	4	219,679.70	440,000.00
负债合计		288,344,292.83	13,606,686.49
持有人权益			
实收基金	5	1,488,080,207.24	2,325,708,828.22
未实现利得	6	420,192,865.29	183,316,171.71
未分配基金净收益 /(累计基金净损失)		282,505,395.99	1,516,600.22
持有人权益合计		2,190,778,468.52	2,510,541,600.15
(2006 年 6 月 30 日每单位基金资产净值:1.4722 元)			
(2005 年 12 月 31 日每单位基金资产净值:1.0795 元)			
负债及持有人权益总计		2,479,122,761.35	2,524,148,286.64

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、经营业绩表、收益分配表

2006年半年度经营业绩、收益分配表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	附注	2006.1.1–2006.6.30	2005.1.1–2005.6.30
收入			
股票差价收入	7	556,517,333.98	48,766,011.88
债券差价收入 /(损失)	8	(2,541,716.79)	9,014,601.95
权证差价收入		46,170,516.16	0.00
债券利息收入		6,791,757.84	10,028,304.71
存款利息收入		1,084,180.42	701,695.68
股利收入		16,075,425.03	32,197,116.84
买入返售证券收入		63,753.42	0.00
其他收入	9	537,213.12	397,140.98
收入合计		624,698,463.18	101,104,872.04
费用			
基金管理人报酬		16,416,038.92	21,540,575.39
基金托管费		2,736,006.52	3,590,095.93
卖出回购证券支出		450,659.63	0.00
其他费用	10	236,695.97	232246.88
其中:信息披露费		168,603.31	168,917.11
审计费用		51,076.39	49,588.57
费用合计		19,839,401.04	25,362,918.20
基金净收益		604,859,062.14	75,741,953.84
加:未实现估值增值 /(减值)变动数	6	372,940,840.25	(59,811,211.60)
基金经营业绩		977,799,902.39	15,930,742.24
基金净收益		604,859,062.14	75,741,953.84
加:年 /(期)初基金净收益		1,516,600.22	(31,026,514.52)
本年 /(期)申购基金份额的损益平准金		22,640,563.00	(4,077,382.33)
本年 /(期)赎回基金份额的损益平准金		(39,099,426.62)	(3,344,568.13)
可供分配基金净收益		589,916,798.74	43,982,625.12
减:本年 /(期)已分配基金净收益	11	307,411,402.75	52,225,009.80
未分配基金净收益 /(累计基金净损失)		282,505,395.99	(8,242,384.68)

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

三、基金净值变动表

2006年半年度基金净值变动表

(除特别注明外,金额单位为人民币元)

	2006.1.1–2006.6.30	2005.1.1–2005.6.30
年 /(期)初基金净值	2,510,541,600.15	2,815,902,681.89
本年 /(期)经营活动		
基金净收益	604,859,062.14	75,741,953.84
未实现估值增值 /(减值)变动数	372,940,840.25	(59,811,211.60)
经营活动产生的基金净值变动数	977,799,902.39	15,930,742.24
本年 /(期)基金份额交易		
基金申购款	578,451,723.45	806,225,400.11
其中:分红再投资	22,492,867.40	4,432,845.83
基金赎回款	(1,568,603,354.72)	(856,741,836.92)
基金份额交易产生的基金净值变动数	(990,151,631.27)	(50,516,436.81)
本年 /(期)向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	(307,411,402.75)	(52,225,009.80)
年 /(期)末基金净值	2,190,778,468.52	2,729,091,977.52

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

第二节:半年度会计报表附注

一、基金基本情况

海富通精选证券投资基金经中国证券监督管理委员会证监基金字【2003】85 号《关于同意海富通精选证券投资基金设立的批复》核准募集设立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为交通银行;有关基金设立文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案;基金合同于 2003 年 8 月 22 日生效,该日的基金份额总额为 3,698,432,268.39 份基金单位。

二、会计政策、会计估计

(一)本报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

(二)主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b)基金买卖股票、债券的差价收入,自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%(此前按 100%)计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(d) 基金买卖股票于 2005 年 1 月 24 日前按照 0.2%的税率缴纳股票交易印花税,自 2005 年 1 月 24 日起减按 0.1%的税率缴纳。

(e)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

三、本报告期无重大会计差错。

四、关联方关系及关联方交易

1. 关联方

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
交通银行	基金托管人、基金代销机构
海通证券股份有限公司("海通证券")	基金管理人的股东、基金代销机构
富通基金管理公司 (Fortis Investment Management S.A.)	基金管理人的股东

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. 关联方交易

通过关联方席位进行的交易:

	2006年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日					
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		交易佣金	
	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	佣金 人民币元	占本期佣金总量的比例
海通证券	459,734,839.30	10.07%	79,530,986.70	10.08%	370,639.70	9.98%

	2005年 1 月 1 日至 2005 年 6 月 30 日					
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		交易佣金	
	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	成交量 人民币元	占本期成交量的比例	佣金 人民币元	占本期佣金总量的比例
海通证券	581,041,534.38	11.71%	55,520,810.90	11.63%	465,117.73	11.61%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务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. 基金管理人报酬

支付基金管理人海富通基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数

本基金在 2006 年度上半年度需支付基金管理人报酬 16,416,038.92 元 (2005 年上半年度:21,540,575.39 元)。

4. 基金托管人报酬

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,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 X 0.25% / 当年天数

本基金在 2006 年度上半年度需支付基金托管费 2,736,006.52 元 (2005 年上半年度:3,590,095.93 元)。

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 102,132,437.44 元 (2005 年 6 月 30 日:54,379,216.13 元) 。2006 年上半年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 238,352.72 元(2005 年上半年度:442,318.29 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,相关余额 285,746,362.84 元(2005 年上半年度:8,943,347.57 元) 计入结算备付金科目。

6. 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在 2006 年上半年度与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

	2006年 1 月 1 日至 2006 年 6 月 30 日	2005年 1 月 1 日至 2005 年 6 月 30 日
买入债券结算金额	0.00	91,764,831.23
卖出债券结算金额	100,935,479.45	0.00
卖出回购证券协议金额	0.00	0.00
卖出回购证券利息支出	0.00	0.00

7. 关联方及其控制的机构本期末持有本基金份额为 0.00 份,2005 年上半年度和 2006 年上半年度均未持有本基金份额。

五、报告期末流通转让受到限制的基金资产

根据中国证监会的政策规定,2000 年 5 月 18 日起新股发行时不再单独向基金配售新股。基金可比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外,根据中国证监会证监发行字[2002]54 号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题的补充通知》及其配套规定,自 2002 年 5 月 20 日起,恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股票市值参与配售,但累计申购总额不得超过基金按规定可申购的总额。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

本基金截至 2006 年 6 月 30 日由于认购新股、增发新股或股权分置改革而持有的流通受限制股票情况如下:

资产名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限原因	上市日期
中工国际	116,373	861,160.20	2,038,854.96	市值	网下新股中签	2006.9.19
同洲电子	34,423	550,768.00	14,041,14.17	市值	网下新股中签	2006.9.27
大同煤业	846,469	5,722,130.44	8,650,913.18	市值	网下新股中签	(50%)2006.9.25 (50%)2006.12.25
中国银行	150,902	464,778.16	464,778.16	成本	网下新股中签	(50%)2006.10.9 (50%)2007.1.5
	2,713,000	8,356,040.00	835,6040.00	成本	网上新股中签	2006.7.5
G天 威	2,000,000	35,200,000.00	43,760,000.00	市值	增发新股	——
四川双马	3,490,495	20,806,829.29	20,000,536.35	市值	股权分置改革	2006.7.4
亚泰集团	3,000,000	8,210,005.09	13,110,000.00	市值	股权分置改革	2006.8.10
合计	12,351,662	80,171,711.18	96,381,122.65			

第六章:投资组合报告

一、报告期末基金资产组合情况

项目名称	项目市值(人民币元)	占基金资产总值比例
股 票	1,623,533,098.10	65.49%
债 券	443,518,880.50	17.89%
权 证	0.00	0.00%
银行存款及清算备付金合计	387,878,800.28	15.64%
其他资产	24,191,982.47	0.98%
合 计	2,479,122,761.35	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值(人民币元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	175,250,913.18	8.00%
C 制造业	679,186,619.88	31.00%
C0 食品、饮料	190,040,974.18	8.67%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	27,120,000.00	1.24%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	118,900,000.00	5.43%
C5 电子	0.00	0.00%
C6 金属、非金属	76,430,536.35	3.49%
C7 机械、设备、仪表	208,495,109.35	9.52%
C8 医药、生物制品	58,200,000.00	2.65%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	42,551,458.20	1.94%
E 建筑业	16,600,614.20	0.76%
F 交通运输、仓储业	235,680,025.20	10.76%
G 信息技术业	169,109,988.39	7.72%
H 批发和零售贸易	91,480,197.75	4.18%
I 金融、保险业	85,920,818.16	3.92%
J 房地产业	44,409,340.00	2.03%
K 社会服务业	2,038,854.96	0.09%
L 传播与文化产业	44,220,000.00	2.02%
M 综合类	37,084,268.18	1.69%
合计	1,623,533,098.10	74.11%

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比例%
1.	600717	G天津港	12,900,003	108,360,025.20	4.95%
2.	000858	G五粮液	7,000,067	101,780,974.18	4.65%
3.	600009	G沪机场	7,000,000	100,870,000.00	4.60%
4.	600583	G海 工	4,000,000	91,600,000.00	4.18%
5.	600718	G东 软	7,000,322	83,793,854.34	3.82%
6.	600036	G招 行	10,000,000	77,100,000.00	3.52%
7.	600028	中国石化	12,000,000	75,000,000.00	3.42%
8.	600519	G茅 台	1,500,000	71,160,000.00	3.25%
9.	000792	G钾 肥	3,000,000	60,900,000.00	2.78%
10.	600161	G天 坛	4,000,000	58,200,000.00	2.66%

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 www.hftfund.com 的半年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

(一)报告期内累计买入、卖出价值占期初基金资产净值比例大于 2%的股票明细。

累计买入			
股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
000858	G 五粮液	89,657,074.53	3.57%
600717	G 天津港	86,344,421.32	3.44%
600550	G 天 威	70,392,882.72	2.80%
000002	G 万科 A	61,057,963.40	2.43%
600688	上海石化	57,312,305.05	2.28%
600316	洪都航空	55,377,950.44	2.21%
600900	G 长 电	54,322,873.89	2.16%
000825	G 太 钢	53,773,521.54	2.14%
000898	G 鞍 钢	44,390,623.31	1.77%
600036	G 招 行	44,369,686.07	1.77%
600050	G 联 通	42,041,400.40	1.67%
600161	G 天 坛	40,154,721.72	1.60%
000099	G 海 直	37,134,490.84	1.48%
000100	GTCL集团	34,221,838.62	1.36%
600875	G 东 电	33,118,519.63	1.32%
000402	G 金融街	32,067,110.44	1.28%
600636	G 三爱富	31,016,925.26	1.24%
600001	G 邯 钢	30,836,540.19	1.23%
000501	G 武商 A	28,151,272.77	1.12%
000837	G 秦发展	27,873,349.82	1.11%
累计卖出			
股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
600583	G 海 工	121,549,194.18	4.84%
000858	G 五粮液	120,816,598.37	4.81%
600008	G 首 创	101,290,508.66	4.03%
600519	G 茅 台	95,967,696.51	3.82%
600037	G 歌 华	80,535,689.32	3.21%
600598	G 北大荒	79,847,365.45	3.18%
600688	上海石化	73,099,109.27	2.91%
000792	G 钾 肥	70,428,653.77	2.81%
600028	中国石化	67,368,901.81	2.68%
600309	G 万 华	66,888,774.01	2.66%
600662	强生控股	66,811,480.64	2.66%
600886	G 华 靖	56,948,066.47	2.27%
600550	G 天 威	56,548,397.84	2.25%
600717	G 天津港	54,392,819.30	2.17%
600205	山东铝业	54,160,355.51	2.16%
600900	G 长 电	54,094,894.64	2.15%
600521	G 华 海	50,725,256.46	2.02%
600316	洪都航空	48,465,871.54	1.93%
000898	G 鞍 钢	47,781,167.98	1.90%
600406	国电南瑞	45,923,818.91	1.83%

(二)报告期内买入股票成本总额及卖出股票收入总额

单位: 人民币 元

买入股票成本总额	1,746,077,829.94
卖出股票收入总额	2,903,805,960.74

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值(人民币元)	市值占净值比例
国债	301,893,080.50	13.78%
金融债券	141,625,800.00	6.46%
债券投资合计	443,518,880.50	20.24%

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

债券名称	市值(人民币元)	市值占净值比例
21国债(3)	118,211,321.50	5.40%
20国债(10)	92,367,159.00	4.22%
21国债(15)	63,264,600.00	2.89%
03国开 29	50,990,000.00	2.33%
00国开 13	40,016,000.00	1.83%

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证明细

无。

八、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没有被监管部门立案调查,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、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股票。

3、基金其他资产的构成

其他资产	金额(人民币元)
交易保证金	1,362,698.42
应收利息	6,637,316.35
应收申购款	850,938.93
证券清算款	13,628,328.77
应收股利	1,712,700.00
合计	24,191,982.47

4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5、基金在报告期内的权证投资明细

权证代码	权证名称	投资类别	数量	成本(人民币元)
580997	招行 CMP1	股权分置被动持有	6,007,705	0.00
580996	沪场 JTP1	股权分置被动持有	5,250,000	0.00
580004	首创 JTB1	股权分置被动持有	330,000	0.00
580005	万华 HXB1	股权分置被动持有	800,000	0.00
580993	万华 HXP1	股权分置被动持有	1,200,000	0.00
580991	海尔 JTP1	股权分置被动持有	3,494,150	0.00
580990	茅台 JCP1	股权分置被动持有	4,160,000	0.00
038008	钾肥 JTP1	股权分置被动持有	1,600,000	0.00

第七章:基金份额持有人情况

本基金份额持有人情况如下:

总份额 / 比例					持有人户数	户均持有份额(份)
个人(份)	比例	机构(份)	比例	合计(份)		
249,332,727.28	16.76%	1,238,747,479.96	83.24%	1,488,080,207.24	6,481	229,606.57

第八章:基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下:

基金合同生效日基金份额总额	本期期初基金份额	本期期间总申购份额	本期期间总红利再投资份额	本期期间总赎回份额	本期期末基金份额
3,698,432,268.39	2,325,708,828.22	463,035,010.09	18,252,005.16	1,318,915,636.23	1,488,080,207.24

第九章:重大事件揭示

一、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

二、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动。

2006年 5 月 27 日,基金管理人海富通基金管理有限公司("本公司")在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布关于副总经理的任命公告,决定聘请陈洪、阎小庆先生担任本公司副总经理。

2006 年 1 月 25 日,交通银行股份有限公司在《证券时报》、《金融时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于阮红基金托管行业高管任职资格的公告》。

2006 年 7 月 18 日,交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于住所变更的公告》。交通银行股份有限公司住所由"上海市仙霞路 18 号"变更为"上海市浦东新区银城中路 188 号"。

三、本基金的管理人、基金财产、基金托管业务报告期内无诉讼事项。

四、报告期内本基金投资策略未发生改变。

五、基金收益分配事项

本基金分别于 1 月 25 日、4 月 12 日、5 月 12 日在 《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布第七、第八和第九次分红预告,分别向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.25、0.80 和 0.70 元,共计 1.75 元。

六、报告期内,本基金未改聘为其审计的会计师事务所

七、本基金的管理人、托管人及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

八、报告期内本基金租用证券公司专用交易席位未发生变更,情况如下:

代号	券商名称	席位数量	股票成交金额(元)	占股票成交总额	债券成交金额(元)	占债券成交总额	权证成交金额(元)	占权证成交总额
1	海通证券	2	459,734,839.30	10.07%	79,530,986.70	10.08%	4,938,224.94	10.69%
2	招商证券	1	165,274,310.02	3.62%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
3	申银万国	1	380,374,767.26	8.33%	25,804,689.50	3.27%	5,080,703.50	10.99%
4	长江证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
5	中信建投	1	296,931,119.69	6.51%	5,030,500.00	0.64%	12,497,360.02	27.04%
6	国泰君安	2	460,545,144.71	10.09%	49,240,471.30	6.25%	6,785,527.41	14.68%
7	中金公司	1	1,140,939,289.68	24.99%	333,957,309.30	42.34%	8,149,855.08	17.63%
8	闽发证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
9	联合证券	1	181,090,036.58	3.97%	15,088,000.00	1.91%	0.00	0.00%
10	兴业证券	1	67,358,837.08	1.48%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
11	平安证券	1	119,587,846.79	2.62%	6,035,400.00	0.77%	0.00	0.00%
12	光大证券	1	621,698,102.86	13.62%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
13	国元证券	1	525,918,969.38	11.52%	274,003,408.40	34.74%	8,765,061.89	18.97%
14	广发证券	1	145,225,680.83	3.18%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
15	两地合计	16	4,564,678,944.18	100.00%	788,690,765.20	100.00%	46,216,732.84	100.00%

代号	券商名称	债券回购成交金额(元)	占债券回购成交总额	实付佣金(元)	实付佣金比率
1	海通证券	0.00	0.00%	370,639.70	9.97%
2	招商证券	0.00	0.00%	129,329.86	3.48%
3	申银万国	0.00	0.00%	316,450.83	8.52%
4	长江证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
5	中信建投	460,000,000.00	62.84%	250,360.75	6.74%
6	国泰君安	0.00	0.00%	373,405.57	10.05%
7	中金公司	190,000,000.00	25.96%	937,813.36	25.24%
8	闽发证券	0.00	0.00%	0.00	0.00%
9	联合证券	0.00	0.00%	148,339.43	3.99%
10	兴业证券	0.00	0.00%	55,234.10	1.49%
11	平安证券	0.00	0.00%	98,000.44	2.64%
12	光大证券	0.00	0.00%	486,485.67	13.09%
13	国元证券	82,000,000.00	11.20%	435,755.03	11.73%
14	广发证券	0.00	0.00%	113,639.62	3.06%
15	两地合计	732,000,000.00	100.00%	3,715,454.36	100.00%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

(1)专用席位的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及专用席位租用意见。

(2)专用席位的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行专用席位的选择:

1. 推荐。投资部业务人员推荐,经投资部部门会议讨论,形成重点评估的证券公司备选池,从中进行甄选。原则上,备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

2. 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定,进行主观性评议,独立的评分,形成证券公司排名及专用席位租用意见,经公司业务管理委员会同意后,报董事会核准。

3. 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后,由基金管理人的董事会核准。

(九)其他在报告期内发生的重大事件,以及基金管理人判断为重大事件的事项。

1、2006 年 1 月 17 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通基金管理有限公司关于旗下基金代销机构华夏证券变更为中信建投证券的公告。

2、2006 年 1 月 18 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了《关于推出旗下海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金和海富通股票证券投资基金之间优惠转换费率的公告》。

3、2006 年 2 月 22 日, 本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司在 《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了增加注册资本和变更股东出资比例的公告,海富通基金管理有限公司的注册资本由人民币 1 亿元增加至人民币 1.5 亿元,双方的出资比例从原来的 67%:33%变更为 51%:49%。

4、2006 年 4 月 15 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了《海富通精选证券投资基金更新招募说明书》。

5、2006 年 1 月 17 日、6 月 13 日本基金的管理人海富通基金管理有限公司就增加中银国际证券有限责任公司、招商银行股份有限公司为本基金的代销机构在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登公告。

6、2006 年 6 月 16 日,本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于推出旗下基金优惠申购和转换费率的公告。

海富通基金管理有限公司

2006 年 8 月 24 日