华夏大盘精选证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人：华夏基金管理有限公司 基金托管人：中国银行股份有限公司

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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2006年8月15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。

本报告期自2006年1月1日起至2006年6月30日止。本报告中的财务资料未经审计。

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，应阅读半年度报告正文。

一、基金简介

（一）基金基本情况

1、基金名称：华夏大盘精选证券投资基金

2、基金简称：华夏大盘精选

3、基金代码：000011（前端收费模式）；000012（后端收费模式）

4、基金运作方式：契约型开放式

5、基金合同生效日：2004年8月11日

6、报告期末基金份额：680,425,023.32份

7、基金合同存续期：不定期

8、上市交易所：无

9、基金上市日期：无

（二）基金产品说明

1、基金投资目标：追求基金资产的长期增值

2、基金投资策略：本基金主要采取“自下而上”的个股精选策略，根据细致的财务分析和深入的上市公司调研，精选出业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行集中投资。考虑到我国股票市场的波动性，基金还将在资产配置层面辅以风险管理策略，即根据对宏观经济、政策形势和证券市场走势的综合分析，监控基金资产在股票、债券和现金上的配置比例，以避免市场系统性风险，保证基金所承担的风险水平合理。

3、业绩比较基准：新华富时中国A200指数×80%+新华富时中国国债指数×20%

4、风险收益特征：本基金在证券投资基金中属于中等风险的品种，其长期平均的预期收益和风险高于债券基金和混合基金，低于成长型股票基金。

（三）基金管理人有关情况

1、基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.

2、注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区A区

3、办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层

4、邮政编码：100032

5、法定代表人：凌新源

6、信息披露负责人：张弘弢

7、联系电话：（010）88066688

8、传真：（010）88066566

9、国际互联网址：www.ChinaAMC.com

10、电子邮箱：chinaAMC@ChinaAMC.com

（四）基金托管人有关情况

1、法定名称：中国银行股份有限公司

2、注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号

4、邮政编码：100818

5、法定代表人：肖钢

6、信息披露负责人：宁敏

7、联系电话：（010）66594977

8、传真：（010）66594942

9、电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

（五）信息披露事宜

1、信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》

2、登载半年度报告正文的管理人互联网网址：www.ChinaAMC.com

3、基金半年度报告置备地点：本报告在基金管理人和基金托管人的住所有置备，投资者可要求查阅、复制。

二、主要财务指标和基金净值表现

重要提示：下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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（一）主要会计数据和财务指标

序号	主要会计数据和财务指标	2006年1月1日至2006年6月30日
1	基金本期净收益	347,366,901.45元
2	基金份额本期净收益	0.5572元
3	期末可供分配基金收益	285,096,434.87元
4	期末可供分配基金份额收益	0.4190元
5	期末基金资产净值	1,147,255,818.24元
6	期末基金份额净值	1.686元
7	基金加权平均净值收益率	44.22%
8	本期基金份额净值增长率	91.47%
9	基金份额累计净值增长率	91.66%

（二）基金净值表现

1、基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

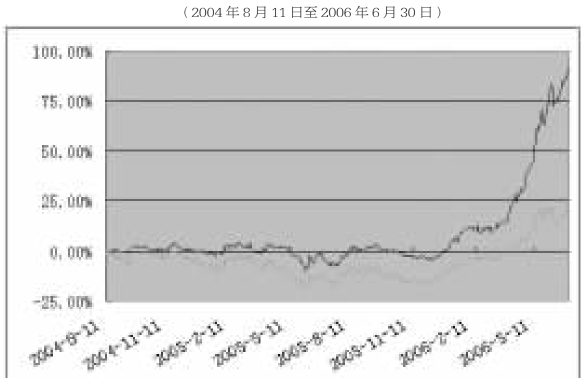
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.81%	1.61%	0.99%	1.36%	9.82%	0.25%
过去三个月	64.06%	1.56%	21.97%	1.33%	42.09%	0.23%
过去六个月	91.47%	1.34%	36.65%	1.09%	54.82%	0.25%
过去一年	99.64%	1.07%	40.56%	0.95%	59.08%	0.12%
自基金合同生效日至今	91.66%	0.99%	20.74%	1.06%	70.92%	-0.07%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

华夏大盘精选证券投资基金累计份额净值增长率

与同期业绩比较基准收益率的历史走势图

（2004年8月11日至2006年6月30日）



注：1、本基金合同于2004年8月11日生效，2004年9月15日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金主要投资于股票，股票资产比例范围为40%~95%。为了满足投资者的赎回要求，基金保留的现金以及投资于到期日在1年以内的国债、政策性金融债、债券回购、中央银行票据等短期金融工具的资产比例不低于5%。本基金其余资产可投资于债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，如法律法规或监管部门对债券投资比例有相关规定的，则从其规定。本基金按规定在合同生效后三个月内达到上述规定的投资比例。

3、自2006年5月24日起，蒋征先生不再担任华夏大盘精选证券投资基金基金经理。

三、管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司。华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准的首批全国性基金管理公司之一，注册资本13800万元。公司总部设在北京，在北京、上海和深圳设有分公司。

截至2006年6月，公司管理资产规模近439亿元人民币，管理着兴华、兴和、兴科、兴安、兴业5只封闭式基金，华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板ETF 8只开放式基金，以及亚洲债券基金二期中国子基金和全国社保基金投资组合，是国内管理基金数目最多的基金管理公司，也是管理资产规模最大的基金管理公司之一。

2、基金经理简介

王亚伟先生，经济学硕士。曾任中信国际合作公司业务经理，华夏证券有限公司研究经理。1998年加入华夏基金管理有限公司，历任兴华证券投资基金基金经理助理、基金经理，华夏成长证券投资基金基金经理。现任华夏基金管理有限公司总经理助理、华夏大盘精选证券投资基金基金经理。

（二）报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

1、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

2、内部监察工作报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金持有人利益出发，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内，本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面：

（1）加强了监察稽核工作力度，颁布实施了合规谈话、稽核记分制等制度。

（2）通过一线部门预警控制，监察部门定期检查、不定期抽查等工作方法，保证了公司所管理的所有基金合法合规运作，未出现重大违规事件，为公司业务开拓奠定了良好的基础。

（3）根据监管部门的要求，定期完成季度及年度监察稽核报告，报公司领导及证监会。

（4）对主要业务部门的制度执行情况进行了稽核。

（5）组织学习和宣传《证券投资基金管理公司治理准则（试行）》等法规。

（6）研究开发有关系统，加强公司合规文化宣传。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，保障了基金持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

1、本基金业绩表现

截至2006年6月30日，本基金份额净值为1.686元，本报告期份额净值增长率为91.47%，同期业绩比较基准增长率为36.65%。

2、行情回顾及运作分析

（1）宏观经济状况

2006年上半年中国经济继续保持快速增长，GDP同比增长10.9%，增速比去年同期快0.9个百分点，尤其2季度的GDP同比增幅高达11.3%。投资增速反弹，全社会固定资产投资增长29.8%。消费保持较快增长，社会消费品零售总额同比增长13.3%。进出口增长较快，总额7957亿美元，同比增长23.4%，贸易顺差614亿美元，其中6月份贸易顺差达到145亿元，创下历史新高。上半年居民消费价格总水平同比上涨1.3%，虽然涨幅比去年同期低1个百分点，但6月份上涨1.5%，连续三个月上升，6月份工业品出厂价格同比上涨3.5%，原材料、燃料、动力购进价格上涨6.6%，显示通胀压力加大。

（2）证券市场状况

上半年股票市场在高增长、低通胀、宽货币的宏观面支持下，借助股权分置改革、上市公司业绩增长、人民币升值、流动性过剩等催化因素，走出了强劲的单边上涨行情，上证综指和深证成指的涨幅分别达到44%和50%。相比之下，债券市场乏善可陈。

（3）投资策略和业绩表现

华夏大盘精选基金去年年底大幅提高了股票投资比例，并在今年上半年始终保持高股票投资比例，从而较好地把握了本轮上涨行情。通过自下而上精选个股与动态调整不断优化相结合的方式，在实现净值稳定增长的同时，将组合整体风险控制在较低的水平。上半年华夏大盘精选基金净值增长率为91.47%，明显超越基准，同时净值波动率与基准相比并没有明显增加。

个股选择方面同时强调业绩的增长潜力和估值的合理，低位布局的新能源、军工、电力设备、食品饮料、电子以及资源类股票贡献了良好的收益。基于动态调整的思路，本基金逐步减持了估值偏高的食品饮料、商业零售和军工类股票，增加了钢铁、有色、传媒、机械股的投资。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、宏观经济展望

预计下半年经济仍能保持快速增长，但随着通货膨胀压力的加大，宏观调控的力度会有所加强，尤其是在控制信贷和房地产投资方面。受此影响经济增速会出现回落，但仍能保持在9%以上。

2、证券市场展望

经过上半年的恢复性上涨，中国股市整体低估的现象已经明显改观，继续大幅上涨的动力减弱，同时受宏观调控力度加大、新股发行和再融资节奏加快、“小非”逐步开始流通等因素的影响，下半年市场的震荡会有所加剧。操作策略上，本基金将适当提高组合的防御性，回避估值偏高的行业和个股，通过挖掘尚未被充分关注的局部投资机会，在控制组合整体风险的同时努力提高收益。

华夏大盘精选基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金持有人谋求长期、稳定的回报。

四、托管人报告

本托管人依据《华夏大盘精选证券投资基金基金合同》与《华夏大盘精选证券投资基金托管协议》，自2004年8月11日起托管华夏大盘精选证券投资基金（以下称“华夏大盘精选基金”或“本基金”）的全部资产。现根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号<半年度报告的内容与格式>》及其他相关规定，出具本托管人报告。

1、本托管人在托管华夏大盘精选基金期间，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和本基金合同以及托管协议的规定，诚信地履行了基金托管人的职责，不存在损害华夏大盘精选基金持有人利益的行为。

（1）本托管人履行安全保管基金资产的全部资产的职责，保证基金资产与自有资产等非基金资产严格分开，维护基金的独立账户，与本托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行了严格的分账管理。

（2）本托管人严格根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和本基金合同以及托管协议的规定执行基金管理人的投资指令，及时、准确地完成了本基金的各项资金清算交割。本托管人对于本基金的任何资产的运用、处分和分配，均具备正当依据。

（3）本托管人对与本基金资产相关的重大合同原件、因履行基金托管人职责而生成或收悉的记录基金业务活动的原始凭证、记账凭证、基金账册、交易记录等有妥善的保管。

2、本托管人在2006上半年度依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏大盘精选证券投资基金基金合同》及《华夏大盘精选证券投资基金托管协议》对华夏基金管理有限公司管理的本基金的运作进行了必要的监督。

（1）其在基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》、本基金合同以及托管协议的规定；未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

（2）本托管人如实、及时、独立地向中国证监会提交了关于本基金投资运作方面的报告。

3、本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整。

中国银行股份有限公司

2006年8月15日

五、财务会计报告

（一）基金会计报表

华夏大盘精选证券投资基金

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	7a	179,427,461.05	24,916,518.47
清算备付金	7b	6,088,798.11	854,417.06
交易保证金	7b	1,459,321.54	753,583.19
应收证券清算款		24,436,520.06	1,800,659.54
应收股利		495,000.00	-
应收利息	7c	36,516.80	748,685.37
应收申购款		20,088,864.41	-
其他应收款		10,600,000.00	-
股票投资市值		964,067,478.42	647,949,326.87
其中：股票投资成本		784,022,192.92	634,747,691.45
债券投资市值		-	43,530,788.45
其中：债券投资成本		-	43,546,989.16
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
资产总计		1,206,699,960.39	720,553,978.95
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		8,918,434.30	6,925,878.37
应付赎回款		2,269,207.47	5,802,601.65
应付赎回费		8,572.30	2,021.82
应付管理人报酬		1,221,392.03	870,031.41
应付托管费		203,565.31	145,005.22
应付佣金	7d	4,947,304.05	1,473,640.00
应付收益		40,825,503.21	-
其他应付款	7e	856,764.98	852,729.00
预提费用	7f	193,398.50	90,000.00
负债合计		59,444,142.15	16,161,907.47
持有人权益			
实收基金	7g	680,425,023.32	703,592,998.49
未实现利得/(损失)	7h	181,734,360.05	(4,928,871.90)
未分配收益		285,096,434.87	5,727,944.89
持有人权益合计		1,147,255,818.24	704,392,071.48
(2006年6月30日每份基金份额净值：1.686元)			
(2005年末每份基金份额净值：1.001元)			
负债及持有人权益总计		1,206,699,960.39	720,553,978.95

华夏大盘精选证券投资基金

2006年1月1日至2006年6月30日止期间

经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	本期数	上年同期数
收入/(损失)			
股票差价收入/(损失)	7i	332,290,513.66	(3,991,500.21)
债券差价收入/(损失)	7j	340,709.78	(855,678.25)
权证差价收入	7k	14,178,125.80	-
债券利息收入		27,756.92	2,000,805.72
存款利息收入		318,424.57	332,338.53
股利收入		6,174,445.35	6,512,870.57
买入返售证券收入		-	-
其他收入	7l	960,558.78	209,979.32
收入合计		354,290,534.86	4,208,815.68
费用			
基金管理人报酬		(5,758,106.51)	(8,046,468.35)
基金托管费		(959,684.38)	(1,341,078.07)
卖出回购证券支出		-	(25,598.41)
其他费用	7m	(205,842.52)	(211,257.39)
其中：信息披露费		(148,767.52)	(145,570.97)
审计费		(44,630.98)	(49,588.57)
费用合计		(6,923,633.41)	(9,624,402.22)
基金净收益/(损失)		347,366,901.45	(5,415,586.54)
加：未实现利得/(损失)		166,859,850.79	(32,552,159.53)
基金经营业绩		514,226,752.24	(37,967,746.07)
本期基金净收益/(损失)		347,366,901.45	(5,415,586.54)
加：期初基金净收益		5,727,944.89	9,053,490.08
本期申购基金份额的损益平准金		126,720,177.43	2,187,780.02
本期赎回基金份额的损益平准金		(77,605,265.47)	(4,059,540.75)
可供分配基金净收益		402,209,758.3	1,766,142.81
减：本期已分配基金净收益		(117,113,323.43)	-
期末基金净收益		285,096,434.87	1,766,142.81

华夏大盘精选证券投资基金

2006年1月1日至2006年6月30日止期间

基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		本期数	上年同期数
期初基金净值		704,392,071.48	1,160,876,035.77
本期经营活动			
基金净收益/(损失)		347,366,901.45	(5,415,586.54)
未实现利得/(损失)		166,859,850.79	(32,552,159.53)
经营活动产生的基金净值变动数		514,226,752.24	(37,967,746.07)
本期基金份额交易			
基金申购款		812,891,811.59	223,555,160.32
其中：分红再投资		17,605,660.46	-
基金赎回款		(767,141,493.64)	(389,130,597.09)
基金份额交易产生的基金净值变动数		45,750,317.95	(165,575,436.77)
本期向基金持有人分配收益		-	-
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		(117,113,323.43)	-
期末基金净值		1,147,255,818.24	957,332,852.93

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

（二）会计报表附注

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

1、主要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

2、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

3、重大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
华夏基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、 基金注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
北京市国有资产经营有限责任公司	基金管理人的股东
西南证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
北京证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国科技证券有限责任公司	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）基金管理人报酬

支付基金管理人华夏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1.50%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×1.50%/当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬5,758,106.51元(上年同期：8,046,468.35元)。

（3）基金托管费

支付基金托管人中国银行股份有限公司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×0.25%/当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费959,684.38元(上年同期：1,341,078.07 元)。

（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银行股份有限公司保管，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179,427,461.05元(2005年6月30日：36,986,968.41元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为282,998.96元（上年同期：320,594.51元)。

（5）与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

本基金在本报告期和上年同期与基金托管人中国银行股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易如下：

	2006年1月1日至2006年6月30日止期间	2005年1月1日至2005年6月30日止期间
买入债券结算金额	-	-
卖出债券结算金额	39,892,000.00	-
卖出回购证券结算金额	-	-
卖出回购证券利息支出	-	-

（6）本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构在本报告期末及上年同期末未持有基金份额。

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

流通受限制不能自由转让的股票

本基金截至2006年6月30日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末估值总额
方案实施阶段停牌							
600088	中视传媒	2006-06-09	14.50	2006-07-04	13.20	999,918	14,498,811.00
600236	桂冠电力	2006-06-13	6.04	2006-07-06	5.50	4,200,000	25,368,000.00
600970	G中材	2006-06-16	26.84	2006-07-06	23.80	1,394,551	37,429,748.84
600217	秦岭水泥	2006-06-27	2.60	2006-07-13	2.03	4,000,000	10,400,000.00
600506	香梨股份	2006-06-09	4.20	2006-07-18	3.29	1,499,922	6,299,672.40
600716	耀华玻璃	2006-06-30	3.61	2006-07-21	2.68	5,204,115	18,786,855.15
合计						17,298,506	112,783,087.39

根据中国证券监督管理委员会的政策规定，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，根据中国证券监督管理委员会证监发行字[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日止持有的因获配新股流通受限制股票情况如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数	成本	市值	占净值比
公开发行股票									
中工国际	2006-06-02	2006-06-19	2006-09-19	7.40	17.52	38,791	287,053.40	679,618.32	0.06%
同洲电子	2006-06-09	2006-06-27	2005-09-27	16.00	40.79	17,211	275,376.00	702,036.69	0.06%
合计							562,429.40	1,381,655.01	0.12%

六、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额（元）	占基金总资产的比例
股票	964,067,478.42	79.89%
债券	-	-
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	185,516,259.16	15.37%
其他资产	57,116,222.81	4.73%
合计	1,206,699,960.39	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	股票市值（元）	市值占基金资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	33,738,203.04	2.94%
B	采掘业	13,255,026.18	1.16%
C	制造业	583,053,615.07	50.82%
C0	其中：食品、饮料	37,736,859.60	3.29%
C1	纺织、服装、皮毛	52,792,070.36	4.60%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	45,429,790.02	3.96%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	26,320,000.00	2.29%
C5	电子	26,750,793.90	2.33%
C6	金属、非金属	182,794,755.53	15.93%
C7	机械、设备、仪表	192,689,530.10	16.80%
C8	医药、生物制品	18,539,815.56	1.62%
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	37,429,748.84	3.26%
F	交通运输、仓储业	88,684,189.79	7.73%
G	信息技术业	40,806,834.43	3.56%
H	批发和零售贸易	19,597,639.32	1.71%
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	5,254,608.84	0.46%
K	社会服务业	56,237,530.22	4.90%
L	传播与文化产业	57,113,522.45	4.98%
M	综合类	28,896,560.24	2.52%
	合计	964,067,478.42	84.03%

（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）	期末市值（元）	占净值比例
1	600787	G中储	14,000,000	79,660,000.00	6.94%
2	000617	石油济柴	2,700,093	55,999,928.82	4.88%
3	600169	G太重	8,706,267	51,541,100.64	4.49%
4	600963	G岳纸	6,700,559	45,429,790.02	3.96%
5	600677	G航通	4,206,255	37,856,295.00	3.30%
6	600970	中材国际	1,394,551	37,429,748.84	3.26%
7	002028	思源电气	1,418,150	30,802,218.00	2.68%
8	000888	G峨眉山	4,505,957	30,189,911.90	2.63%
9	000878	G云铜	3,000,000	29,640,000.00	2.58%
10	600071	G光学	7,299,950	27,082,814.50	2.36%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站www.ChinaAMC.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

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

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的比例
1	600787	G中储	70,933,781.93	10.07%
2	000617	石油济柴	52,971,564.42	7.52%
3	000002	G万科A	50,897,339.33	7.23%
4	600028	中国石化	47,910,977.44	6.80%
5	002024	苏宁电器	45,761,531.30	6.50%
6	000878	G云铜	45,490,538.57	6.46%
7	000917	G电广	41,625,223.61	5.91%
8	000960	G锡业	38,744,294.80	5.50%
9	600331	G宏达	38,586,045.08	5.48%
10	600963	G岳纸	38,503,027.21	5.47%
11	600584	G苏长电	37,038,756.10	5.26%
12	600096	G云天化	36,697,247.89	5.21%
13	600282	南钢股份	35,700,226.48	5.07%
14	000612	焦作万方	34,871,961.75	4.95%
15	600812	华北制药	33,139,076.23	4.70%
16	600037	G歌华	30,048,162.35	4.27%
17	600151	G航天	28,736,283.24	4.08%
18	000758	G中色	28,566,952.07	4.06%
19	600010	G包钢	27,813,716.93	3.95%
20	600160	G巨化	26,849,604.63	3.81%
21	000024	G招商局	26,256,303.15	3.73%
22	600236	G桂冠	25,923,582.99	3.68%
23	600472	G包铝	25,341,230.54	3.60%
24	600677	G航通	24,816,913.30	3.52%
25	600716	耀华玻璃	24,485,982.51	3.48%
26	600029	南方航空	23,823,734.57	3.38%
27	000888	G峨眉山	23,374,888.29	3.32%
28	600296	兰州铝业	22,404,521.95	3.18%
29	600832	G明珠	22,325,238.54	3.17%
30	600786	东方锅炉	22,254,526.98	3.16%
31	600814	G解百	21,324,560.04	3.03%
32	600102	莱钢股份	20,775,389.82	2.95%
33	600363	G联创	20,693,050.05	2.94%
34	600217	G秦岭	20,538,446.01	2.92%
35	000652	G泰达	20,253,927.02	2.88%
36	000036	G华联	19,753,307.80	2.80%
37	000663	永安林业	19,753,200.61	2.80%
38	600062	G双鹤	19,235,681.68	2.73%
39	600271	G航信	18,819,723.71	2.67%
40	600828	G成商	18,391,387.13	2.61%
41	000069	G华侨城	18,349,784.38	2.61%
42	600050	G联通	17,730,176.48	2.52%
43	000793	G燃气	17,683,528.27	2.51%
44	002029	七匹狼	17,630,781.51	2.50%
45	000625	G长安	17,334,091.26	2.46%
46	600088	G中视	16,741,743.16	2.38%
47	600309	G万华	16,577,936.97	2.35%
48	600790	轻纺城	16,180,058.00	2.30%
49	000707	G双环	16,050,197.04	2.28%
50	600640	G国脉	15,836,162.76	2.25%
51	600249	G两面针	15,724,794.75	2.23%
52	600161	G天坛	15,646,301.67	2.22%
53	600481	G双良	15,494,520.70	2.20%
54	600970	G中材	15,120,571.84	2.15%
55	600006	东风汽车	15,104,083.18	2.14%
56	002045	广州国光	15,042,778.33	2.14%
57	600497	G驰宏	14,970,711.79	2.13%
58	600636	G三爱富	14,858,500.31	2.11%
59	000099	G海直	14,794,574.53	2.10%
60	600270	外运发展	14,742,954.54	2.09%
61	600572	G康恩贝	14,649,948.31	2.08%
62	002001	新和成	14,538,901.54	2.06%
63	000012	G南玻	14,484,373.22	2.06%
64	600118	G卫星	14,231,488.73	2.02%
65	600016	G民生	14,088,468.68	2.00%
66	600205	山东铝业	14,066,945.74	2.00%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的股票明细

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的比例
1	600028	中国石化	109,770,177.09	15.58%
2	000758	G中色	58,899,655.07	8.36%
3	000002	G万科A	53,177,762.67	7.55%
4	600009	G沪机场	52,488,973.37	7.45%
5	002024	苏宁电器	50,947,130.13	7.23%
6	000612	焦作万方	41,799,234.17	5.93%
7	600050	G联通	39,050,773.36	5.54%
8	600096	G云天化	38,923,296.04	5.53%
9	600177	G雅戈尔	38,424,884.78	5.46%
10	600151	G航天	37,302,967.65	5.30%
11	000911	G南糖	32,659,325.08	4.64%
12	600786	东方锅炉	30,013,664.82	4.26%
13	000036	G华联	29,838,854.95	4.24%
14	002029	七匹狼	29,180,083.17	4.14%
15	600363	G联创	29,051,881.28	4.12%
16	600787	G中储	28,102,999.42	3.99%
17	600037	G歌华	28,058,957.77	3.98%
18	600688	上海石化	27,226,298.24	3.87%
19	600062	G双鹤	26,924,746.15	3.82%
20	600296	兰州铝业	26,861,146.60	3.81%
21	000652	G泰达	26,573,217.76	3.77%
22	600472	G包铝	26,099,750.19	3.71%
23	600002	齐鲁石化	26,061,772.95	3.70%
24	600160	G巨化	26,044,318.79	3.70%
25	000917	G电广	25,737,345.72	3.65%
26	600741	G沪巴士	25,427,857.81	3.61%
27	600584	G苏长电	25,081,716.32	3.56%
28	600011	G华能	24,572,718.97	3.49%
29	000878	G云铜	24,148,576.49	3.43%
30	600832	G明珠	23,277,617.74	3.30%
31	600029	南方航空	23,158,120.95	3.29%
32	000024	G招商局	23,136,784.13	3.28%
33	600331	G宏达	23,128,569.99	3.28%
34	600282	南钢股份	23,017,607.56	3.27%
35	600249	G两面针	23,014,505.81	3.27%
36	600814	G解百	22,450,434.66	3.19%
37	000930	G丰原	22,309,460.42	3.17%
38	600970	G中材	22,211,920.07	3.15%
39	000400	G许继	21,762,976.10	3.09%
40	600337	G美克	21,541,226.60	3.06%
41	600497	G驰宏	21,326,904.61	3.03%
42	000012	G南玻	21,226,333.58	3.01%
43	600812	华北制药	20,301,190.47	2.88%
44	600309	G万华	20,036,858.15	2.84%
45	600677	G航通	19,913,867.59	2.83%
46	000960	G锡业	19,637,866.40	2.79%
47	000866	扬子退市	18,934,713.76	2.69%
48	600418	G江汽	18,930,160.08	2.69%
49	000625	G长安	18,665,302.63	2.65%
50	600161	G天坛	18,602,465.37	2.64%
51	600271	G航信	18,384,772.76	2.61%
52	000707	G双环	18,221,251.76	2.59%
53	000069	G华侨城	18,158,325.60	2.58%
54	600572	G康恩贝	17,983,029.10	2.55%
55	600481	G双良	17,577,104.47	2.50%
56	600270	外运发展	17,492,464.03	2.48%
57	000997	G新大陆	17,399,339.86	2.47%
58	600790	轻纺城	17,314,481.37	2.46%
59	600205	山东铝业	16,838,469.85	2.39%
60	600089	G特变	16,825,056.81	2.39%
61	600809	G汾酒	16,713,349.09	2.37%
62	002045	广州国光	16,372,663.90	2.32%
63	000099	G海直	16,263,966.25	2.31%
64	000806	G银河	16,221,848.16	2.30%
65	000869	G张裕	16,180,764.96	2.30%
66	600521	G华海	16,089,287.51	2.28%
67	000969	G安泰A	15,185,645.78	2.16%
68	600016	G民生	14,533,054.78	2.06%
69	600217	G秦岭	14,361,345.33	2.04%
70	600006	东风汽车	14,215,031.58	2.02%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
2,529,526,503.99	2,713,238,644.00

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合

截至本报告期末，本基金未持有债券。

（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

截至本报告期末，本基金未持有债券。

（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

（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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

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的。

3、报告期末基金持有的权证及报告期内获得的权证

（1）报告期末持有权证明细

截至本报告期末，本基金未持有权证。

（2）报告期内获得权证明细

	权证名称	数量（份）	成本总额（元）
被动持有权证	深能JTP1	1,323,000	-
	万华HXP1	299,988	-
	万华HXB1	199,992	-
	雅戈QCP1	2,657,701	-
	雅戈QCB1	379,672	-
	沪场JTP1	2,025,000	-
主动投资权证	-	-	-

4、基金的其他资产构成

单位：元

交易保证金	1,459,321.54
应收利息	36,516.80
应收证券清算款	24,436,520.06
应收股利	495,000.00
应收申购款	20,088,864.41
其他应收款	10,600,000.00
合计	57,116,222.81

5、至本报告期末，本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

七、基金份额持有人户数和持有人结构

截至2006年6月30日华夏大盘精选基金持有人情况如下：

（一）报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	7,860户
报告期末平均每户持有的基金份额	86,568.07份

再注短砧进历科析深号安持有人结构

	持有份额（份）	占基金总份额比例
机构投资者持有的基金份额	421,743,525.62	61.98%
个人投资者持有的基金份额	258,681,497.70	38.02%
合计	680,425,023.32	100.00%

八、开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	1,927,966,142.50
本报告期期初基金份额总额	703,592,998.49
本报告期期间基金总申购份额	624,275,993.82
本报告期期间基金总赎回份额	647,443,968.99
本报告期期末基金份额总额	680,425,023.32

九、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）经华夏基金管理有限公司第二届董事会2006年第二次会议决议，免去李操纲先生公司副总经理职务。

（三）本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

（四）本报告期本基金投资策略未发生改变。

（五）本基金2006年上半年向投资者每10份基金份额分红1.80元。

（六）本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

（七）本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。

（八）选择证券经营机构交易席位的情况

为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；

2、公司财务状况良好；

3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

根据以上标准，本期分别选择了国金证券、申万证券、中金公司、国泰君安、兴业证券、联合证券、齐鲁证券、中信建投、金信证券共计9个席位作为华夏大盘精选基金专用交易席位，其中中金公司为本期新增加的券商席位。席位佣金为股票成交金额的1‰扣除应由券商负担的交易手续费、证管费及结算风险金。

各席位交易量及佣金提取情况如下：

2006年1月1日至2006年6月30日租用各券商席位的数量、股票交易量及佣金情况如下：

单位：元

序号	券商名称	租用该券商席位的数量	股票交易量	占股票交易总量比例	应付佣金	占应付佣金总量比例
1	国金证券	1	1,517,891,382.42	28.99%	1,244,654.68	29.50%
2	申万证券	1	1,070,149,225.14	20.44%	837,405.10	19.85%
3	中金公司	1	927,098,490.64	17.71%	725,462.96	17.20%
4	国泰君安	1	737,516,225.71	14.09%	604,759.27	14.34%
5	兴业证券	1	566,522,023.72	10.82%	464,542.45	11.01%
6	联合证券	1	416,785,571.56	7.96%	341,761.79	8.10%
	合计	6	5,235,962,919.19	100.00%	4,218,586.25	100.00%

2006年1月1日至2006年6月30日各券商债券、回购交易量情况如下：

单位：元

序号	券商名称	债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例
1	国金证券	26,477,533.40	100.00%	-	-
	合计	26,477,533.40	100.00%	-	-

（九）其他重大事件

1、本基金管理人于2006年6月28日发布华夏基金管理有限公司深圳分公司迁址公告；

2、本基金管理人于2006年6月28日发布华夏大盘精选证券投资基金第三次分红公告；

3、本基金管理人于2006年6月12日发布华夏基金管理有限公司深圳分公司迁址公告；

4、本基金管理人于2006年6月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金资产支持证券投资方案的公告；

5、本基金管理人于2006年5月29日发布华夏大盘精选证券投资基金第二次分红公告；

6、本基金管理人于2006年5月24日发布华夏基金管理有限公司关于调整基金经理的公告；

7、本基金管理人于2006年5月13日发布华夏基金管理有限公司公告，免去李操纲先生公司副总经理职务；

8、本基金管理人于2006年4月25日发布公告，对通过网上交易申购或转入本公司旗下前端收费模式开放式基金的投资者进行费率优惠；

9、本基金管理人于2006年4月13日发布华夏基金管理有限公司上海分公司迁址公告；

10、本基金管理人于2006年2月24日发布华夏大盘精选证券投资基金第一次分红公告；

11、本基金管理人于2006年2月15日发布公告，对旗下部分开放式基金的销售费率实行优惠；

12、本基金管理人于2006年2月6日发布华夏基金管理有限公司关于旗下开放式基金代销机构华夏证券股份有限公司变更为中信建投证券有限责任公司的公告；

13、本基金管理人于2006年1月24日发布公告，新增齐鲁证券有限责任公司为旗下开放式基金代销机构；

14、本基金管理人于2006年1月9日发布公告，新增华西证券有限责任公司为旗下开放式基金代销机构。

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站www.ChinaAMC.com查阅上述公告。

华夏基金管理有限公司

二〇〇六年八月二十四日