

汇添富优势精选混合型证券投资基金 2006年半年度报告摘要

报告期间:2006年1月1日至2006年6月30日 基金管理人:汇添富基金管理有限公司 基金托管人:中国工商银行股份有限公司

第一节 重要提示

基金管理人——汇添富基金管理有限公司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...

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2006年8月2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。本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,报告正文同时登载于基金管理人网站(http://www.htfund.com)。

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表示其未来表现。投资者有风险,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。

第二节 基金简介

一、基金名称:汇添富优势精选混合型证券投资基金

基金简称:添富优势

交易代码:519008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2006年8月26日

报告期末基金份额总额:975,397,737.84份

二、基金投资基本情况

投资目标:投资于具有持续竞争优势的企业,分享其在中国经济持续增长过程中长期优异的业绩,为基金份额持有人谋求长期稳定的投资回报。

投资策略:本基金采用适度动态资产配置策略,同时运用汇添富持续竞争优势企业评估体系自上而下精选个股,并对投资组合进行积极有效的风险管理(详见本基金合同和招募说明书)。

业绩比较基准:70%*沪深300指数收益率+30%*上证国债指数收益率。

风险收益特征:本基金是精选股票,并进行积极风险控制的混合型基金,本基金的风险和预期收益比较均衡,在证券投资基金中属于风险适中的基金品种。

三、基金管理人名称:汇添富基金管理有限公司

信息披露负责人:李文

联系电话:021-28932888

传真:021-28932988

电子邮箱:service@htfund.com

四、基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人:汪为

联系电话:010-66106912

传真:010-66106904

电子邮箱:custody@icbc.com.cn

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

本报告期内,上海市宣城市路99号世纪国际大厦21层

第三节 主要财务指标、基金净值表现

一、主要财务指标

Table with 2 columns: Item and Value. Rows include 1. 基金本期净收益 246,511,517.73, 2. 基金本期净收益占基金资产净值的比例 0.3160, etc.

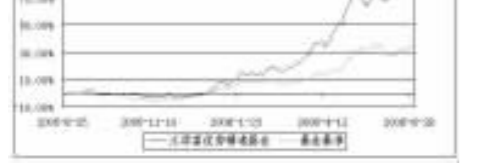
注:上述财务指标中“本期”指2006年1月1日至2006年6月30日期间,上述本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:开放式基金的申购赎回费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、基金净值表现

1. 本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比表:

Table with 6 columns: Period, Net Growth Rate (1), Benchmark Growth Rate (2), Difference (3), Difference (4), Difference (5), Difference (6). Rows for 1 month, 3 months, 6 months.

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:根据本基金合同所规定的资产配置投资,股票资产40%-95%,债券资产0%-50%,现金类资产不低于5%。2006年6月30日实际履行情况为:股票资产占基金资产净值为90.41%,债券资产占基金资产净值为2.93%,现金类资产占基金资产净值为9.39%。

第四节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理情况

基金管理人汇添富基金管理有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航集团控股有限公司共同出资设立,经中国证监会证监基金字[2006]15号文批准,于2006年2月3日正式成立,注册资本为1亿元人民币。截止至2006年6月30日,本基金管理人管理二只开放式基金——汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金。

二、基金经理简介

卢庆先生,6年证券从业经历,浙江大学生命科学院理学硕士。曾任申银万国证券研究所行业分析师,此后加入富国基金管理有限公司,任行业分析师及投资策略小组成员。2005年4月加入汇添富基金管理有限公司。

徐慧女士,6年证券从业经历,复旦大学金融学博士研究生。曾任群益国际控股有限公司宏观经济分析师,从事宏观经济和上市公司研究,负责证券交易、基金投资等工作。2004年11月加入汇添富基金管理有限公司。

三、报告期内基金运作遵规守信情况说明

本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《汇添富优势精选混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益,无损害基金持有人合法权益的行为。本基金无重大违法违规行为,本基金投资符合有关法规及基金合同的约定。

四、报告期内基金投资策略和业绩表现说明与解释

2006年上半年,中国证券市场经历了全球宏观流动性冲击所造成的短期大幅震荡,但并未改变其强势特征,市场表现极为优异。

从宏观面分析,我国宏观经济持续稳定发展,其中今年GDP增长完全超过年初预期,支持证券市场持续上扬;从市场面分析,证券市场制度建设日趋完善,特别新股发行制度改革使得“制度性溢价”现象消除;从基本盘面分析,上市公司盈利改善并可持续增长,同时相比其他资产吸引力增强,引发了一轮持续性的投资热潮。

回顾我们的投资策略,基于对中国证券市场长期走牛的信心以及挑选高质量证券做中长期投资布局的投资理念,我们遵循了“相对均衡配置、适度个股集中、适时动态调整”的投资风格,始终保持了较高的仓位,并通过积极的行业配置和个股选择来规避可能的风险,从而充分分享了证券市场整体上扬所带来的收益。

在行业配置上,我们延续一贯以来对于消费和服务的重视,坚定投资于一批能够受惠于中国经济内生增长的企业。目前这类股票的短期估值似乎相对较高,但我们认为在实际投资中应动态跟踪来审视,毕竟它们能够通过持续稳定的增长来享受成长性乃至稀缺性溢价;同时,我们继续看好资源和能源、技术和新兴产业,有选择性地重点投资了部分相关行业的龙头企业。我们深信中国从大国走向强国的过程中,节能降耗的因素将有利于新能源和可替代能源企业的脱颖而出,而部分企业在产品、服务方面的创新也必将得到市场的充分认可。当然,我们也基于对经济形势和国家政策的理解,适度减少对地产行业投资的投入,增加了符合经济结构调整、受益于投资拉动的相关行业配置比重,取得了良好的收益。

五、报告期内,本基金净值持续增长

六、宏观市场、证券市场及行业走势展望

展望未来,由于宏观调控改变行业预期,融资加快影响市场心理,部分个股受未来业绩等因素,证券市场面临短期的波动,结构性分化在所难免,但不破不立,目前持仓上仓位调整有利于未来更加持续健康稳定地发展。我们维持对证券市场长期向好的判断不变。

我们将以基本面为出发点,重个股,轻市场,围绕“成长、创新、活力”三大投资主题,挖掘分国内需求增长、经济结构调整、产业整合,具备可持续及高质量盈利能力的企业,积极进行投资组合的结构调整。当然,人民币升值及其相关企业的投资机会也是我们重点关注对象。

第五节 托管人报告

2006年上半年,本托管人在对汇添富优势精选混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006年上半年,汇添富优势精选混合型证券投资基金的基金管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富优势精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等方面上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各方面均严格按照基金合同的约定进行。

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司在2006年上半年编制和披露的汇添富优势精选混合型证券投资基金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检查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2006年8月2日

第六节 财务会计报告(未经审计)

一、半年度会计报表

(由于本基金于2006年8月25日成立,无比较经营业绩表、收益分配表以及基金净值变动表的上年度可比期间,特此说明)

(一) 2006年6月30日资产负债表

Table with 5 columns: Item, Note, 2006年12月31日, 2006年6月30日. Rows include 资产, 负债, 所有者权益, etc.

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

Table with 5 columns: Item, Note, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 收入, 费用, 基金管理人报酬, etc.

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(三) 收益分配表

Table with 5 columns: Item, Note, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 本期基金净收益, 加:期初未分配收益, etc.

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(四) 基金净值变动表

Table with 5 columns: Item, Note, 2006年1月1日至2006年6月30日. Rows include 期初基金净值, 本期经营活动, 基金净收益, etc.

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

(一) 基金基本情况

汇添富优势精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证监会监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]105号文《关于同意汇添富优势精选混合型证券投资基金募集的批复》批准,由汇添富基金管理有限公司作为基金发起人,向社会公开发行募集并于2006年8月26日正式成立。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次发行募集规模为1,025,106,827.47份基金份额。本基金的基金管理人为汇添富基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

(二) 主要会计政策和会计估计

本报告所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表保持一致,本报告期末无重大会计差错的内容和更正信息。

(三) 主要税项

1. 印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金管理人运用基金买卖股票按照2%的税率征收印花税。

根据财税[2005]111号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,从2005年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税率,由现行的2%调整为1%。

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,自2005年6月13日起,基金作为流通股股东在股权分置改革中收到非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税,企业所得和个人所得税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不征收营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股息、红利收入,在扣除基金管理人、基金托管人和基金销售企业在向基金派发股息、红利收入和债券的利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2006]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额。

(四) 关联方关系及其交易

1. 主要关联方关系

Table with 4 columns: 企业名称, 与本基金的关系, 关联方名称, 交易品种, 本期成交金额(元), 占本期关联交易金额比例. Rows include 汇添富基金管理有限公司, 中国工商银行股份有限公司, etc.

上述数据按市场公允价值计算,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清算风险基金后的净额列示。

3. 关联方报酬

(1) 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,逐日累计至每月月末,按月支付,本基金期初支付基金管理人管理费人民币1176501.26元,本期应支付人民币8002373.44元,其中已支付基金管理人人民币7228976元,尚余人民币1960198.70元未支付。

(2) 基金托管人报酬

基金托管费 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,逐日累计至每月月末,按月支付,本基金期初支付基金托管人托管费人民币196083.54元,本期应支付人民币1333728.89元,其中已支付基金托管人人民币1204779.31元,尚余人民币129034.52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工商银行股份有限公司保管,并按银行同业存款利率计息,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: Item, 2006年6月30日, 2006年1月1日至2006年6月30日期间. Rows include 银行存款余额, 银行存款产生的利息收入.

5. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

6. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

7. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

8. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

9. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

10. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

11. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

12. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

13. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

14. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

15. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

16. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

17. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

18. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

19. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

20. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

21. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

22. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

23. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

24. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

25. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

26. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

27. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

28. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

29. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

30. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

31. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

32. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

33. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

34. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

35. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

36. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

37. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

38. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

39. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

40. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

41. 关联方持有基金份额(单位:份)

Table with 3 columns: Item, 2006年1月1日至2006年6月30日, 2006年6月30日. Rows include 期初持有基金份额, 加:本期申购/申购, etc.

42. 关联方持有基金份额(单位:份)