

# 海富通精选证券投资基金季度报告

(2005 年第三季度)

## 一、 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。

基金托管人交通银行根据本基金合同规定，于 2005 年 10 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

## 二、 基金产品概况

基金简称：海富通精选

基金运作方式：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： 2,383,512,022.69 份

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。

基金业绩比较基准：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。

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：交通银行

### 三、 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） 31,206,892.77
2. 加权平均基金份额本期净收益（人民币元） 0.0121

3. 期末基金资产净值（人民币元） 2,613,774,614.15
4. 期末基金份额净值（人民币元） 1.0966

## （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） | 业绩比较基准收益率标准差（4） | (1) - (3) | (2) - (4) |
|----|----------|-------------|--------------|-----------------|-----------|-----------|
|----|----------|-------------|--------------|-----------------|-----------|-----------|

|         |       |       |       |       |       |        |
|---------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|
| 过去 3 个月 | 7.87% | 0.84% | 5.66% | 0.89% | 2.21% | -0.05% |
|---------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|

### 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 日合同生效日起至 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。

## 四、 管理人报告

## （一） 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。

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。

## （二） 报告期内基金运作合规守信情况的说明

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。

### （三） 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

股权分置问题改革依然是二零零五年第三季度中国证券市场的主题，随着市场对股权分置问题改革形成相对一致的预期，以及政府对资本市场支持政策的逐渐发挥作用，投资者信心有所恢复，市场活跃程度有所改善，上证综指从 1000 点低点反弹超过 20%；进入九月份，部分投资者获利离场，加上敏感的市场又对管理层由于第二批股改试点全部高票通过后态度的微妙变化做出反应，上证综指回吐了三分之一的涨幅。同期内，良好的通胀和利率预期和对低风险资产充沛的资金需求推动债券市场继续上扬，上证国债指数上涨 3.18%，本年度累计涨幅达 13.7%。海富通精选基金在七月份做了一次战术性调整，卖出了食品饮料，公路等部分防御性品种，换入了机械制造等部分高波动率品种；九月份，基金降低了股票的配置比例，回到了略微超比例配置状态。报告期内，基金净值涨幅为 7.87%，同期基金业绩比较基准上涨 5.66%，基金的超额收益为 2.21%。

## 五、 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           | 1,793,918,963.34 | 68.44%    |
| 债券           | 601,386,551.90   | 22.94%    |
| 权证           | 0.00             | 0.00%     |
| 银行存款及清算备付金合计 | 215,237,007.73   | 8.21%     |
| 其他资产         | 10,611,254.64    | 0.41%     |
| 合 计          | 2,621,153,777.61 | 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     | 75,480,000.00  | 2.89%     |
| B 采掘业          | 189,450,000.00 | 7.25%     |
| C 制造业          | 618,727,375.64 | 23.67%    |
| C0 食品、饮料       | 0.00           | 0.00%     |
| 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       | 25,650,000.00  | 0.98%     |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 182,690,000.00 | 6.99%     |

|                  |                  |        |
|------------------|------------------|--------|
| C5 电子            | 0.00             | 0.00%  |
| C6 金属、非金属        | 188,560,000.00   | 7.21%  |
| C7 机械、设备、仪表      | 106,347,717.84   | 4.07%  |
| C8 医药、生物制品       | 115,479,657.80   | 4.42%  |
| C99 其他制造业        | 0.00             | 0.00%  |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 124,400,000.00   | 4.76%  |
| E 建筑业            | 51,700,000.00    | 1.98%  |
| F 交通运输、仓储业       | 359,173,624.20   | 13.74% |
| G 信息技术业          | 45,120,000.00    | 1.72%  |
| H 批发和零售贸易        | 44,300,000.00    | 1.69%  |
| I 金融、保险业         | 25,160,000.00    | 0.96%  |
| J 房地产业           | 0.00             | 0.00%  |
| K 社会服务业          | 176,630,000.00   | 6.76%  |
| L 传播与文化产业        | 83,777,963.50    | 3.21%  |
| M 综合类            | 0.00             | 0.00%  |
| 合计               | 1,793,918,963.34 | 68.63% |

(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 股票名称及代码 数量(股) 期末市值(人民币元)

### 市值占基金资产净值比例

|    |               |            |                |       |
|----|---------------|------------|----------------|-------|
| 1  | 海油工程(600583)  | 5,000,000  | 127,500,000.00 | 4.88% |
| 2  | 上海机场(600009)  | 6,083,540  | 95,389,907.20  | 3.65% |
| 3  | 首创股份(600008)  | 17,000,000 | 89,420,000.00  | 3.42% |
| 4  | 歌华有线(600037)  | 6,400,150  | 83,777,963.50  | 3.21% |
| 5  | 盐湖钾肥(000792)  | 7,000,000  | 81,410,000.00  | 3.11% |
| 6  | G 宝 钢(600019) | 18,000,000 | 77,040,000.00  | 2.95% |
| 7  | 北 大 荒(600598) | 17,000,000 | 75,480,000.00  | 2.89% |
| 8  | 中远航运(600428)  | 8,000,000  | 72,560,000.00  | 2.78% |
| 9  | 烟台万华(600309)  | 6,000,000  | 70,200,000.00  | 2.69% |
| 10 | 天 津 港(600717) | 10,000,000 | 66,000,000.00  | 2.53% |

### (四) 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 | 318,475,551.90 | 12.19% |
|----|----------------|--------|

|      |                |        |
|------|----------------|--------|
| 金融债券 | 282,911,000.00 | 10.82% |
|------|----------------|--------|

|        |                |        |
|--------|----------------|--------|
| 债券投资合计 | 601,386,551.90 | 23.01% |
|--------|----------------|--------|

### (五) 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 |
|----------|---------------|---------|
| 05 农发 07 | 99,950,000.00 | 3.82%   |
| 21 国债    | 98,208,000.00 | 3.76%   |
| 04 国开 12 | 81,776,000.00 | 3.13%   |
| 02 国债    | 58,919,143.60 | 2.25%   |
| 03 国开 29 | 50,990,000.00 | 1.95%   |

（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权证证明细

| 权证名称  | 市值（人民币元） | 市值占净值比例 |
|-------|----------|---------|
| - - - |          |         |

（七） 投资组合报告附注

1. 本基金本期投资的前十名证券中，无报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。
2. 本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 1,312,500.00

应收利息 9,254,912.28

应收申购款 43,842.36

合计 10,611,254.64

#### 4. 基金持有的处于转股期的可转换债券明细

| 债券代码 | 债券名称 | 期末市值（人民币元） | 市值占基金资产净值比例 |
|------|------|------------|-------------|
|------|------|------------|-------------|

- - - -

#### 六、 本基金份额变动情况

| 期初基金份额（份） | 期间总申购份额（份） | 期间总赎回份额（份） | 期末基金份额（份） |
|-----------|------------|------------|-----------|
|-----------|------------|------------|-----------|

2,684,420,402.06 176,146,734.39 477,055,113.76

2,383,512,022.69

#### 七、 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准设立海富通精选证券投资基金的文件
- (二) 海富通精选证券投资基金基金合同
- (三) 海富通精选证券投资基金招募说明书
- (四) 海富通精选证券投资基金托管协议
- (五) 中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六) 报告期内海富通精选证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

文件存放地点：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼本基金管理人办公地址。

文件查阅方式：投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话：021-38784858

公司网址：[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)

海富通基金管理有限公司

2005年10月26日