

海富通精选贰号混合型证券投资基金

2007 年半年度报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2007.8.28

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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、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，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。

本报告期为 2007 年 4 月 9 日（基金合同生效日）起至 2007 年 6 月 30 日止。本报告中财务资料未经审计。

目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标和基金净值表现.....	2
三、管理人报告.....	3
（一）基金管理人及基金经理情况.....	3
（二）报告期内基金运作的合规守信情况的说明.....	4
（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释.....	4
（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	5
四、托管人报告.....	5
五、财务会计报告.....	5
（一）半年度会计报表.....	5
（二）半年度会计报表附注.....	8
六、投资组合报告.....	16
七、基金份额持有人情况.....	21
八、开放式基金份额变动情况.....	21
九、重大事件揭示.....	21
十、备查文件.....	23

一、基金简介

（一）基金基本资料

- 1、基金名称：海富通精选贰号混合型证券投资基金
- 2、基金简称：海富通贰号
- 3、交易代码：519015
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2007 年 4 月 9 日
- 6、报告期末基金份额总额：8,999,838,981.53 份
- 7、基金合存续期：无
- 8、基金份额上市的证券交易所：无
- 9、上市日期：无

（二）基金产品说明

1、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。

2、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。

3、业绩比较基准： $MSCI\ China\ A \times 65\% + 上证国债指数 \times 35\%$

4、风险收益特征：本基金属于证券投资基金中风险度适中的品种。

（三）基金管理人

- 1、名称：海富通基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼
- 3、办公地址：上海浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼
- 4、邮政编码：200121
- 5、法定代表人：邵国有
- 6、信息披露负责人：奚万荣
- 7、联系电话：021-68604999-591
- 8、传真：021-50479057
- 9、电子邮箱：wrxix@hftfund.com

（四）基金托管人

- 1、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

信息披露报纸名称：《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》

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

(六)其他有关资料

1、基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

办公地址：北京市西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

二、主要财务指标和基金净值表现

所述基金业绩指标不包括持有人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	
1	基金本期净收益	188,388,372.23 元
2	基金份额本期净收益	0.0209 元
3	期末可供分配基金收益	190,871,015.71 元
4	期末可供分配基金份额收益	0.0212 元
5	期末基金资产净值	10,161,074,443.74 元
6	期末基金份额净值	1.129 元
7	基金加权平均净值收益率	1.9575%
8	本期基金份额净值增长率	12.90%
9	基金份额累计净值增长率	12.90%

注：本基金合同生效日为 2007 年 4 月 9 日，以上财务指标中“本期”指 2007 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2007 年 6 月 30 日止期间。

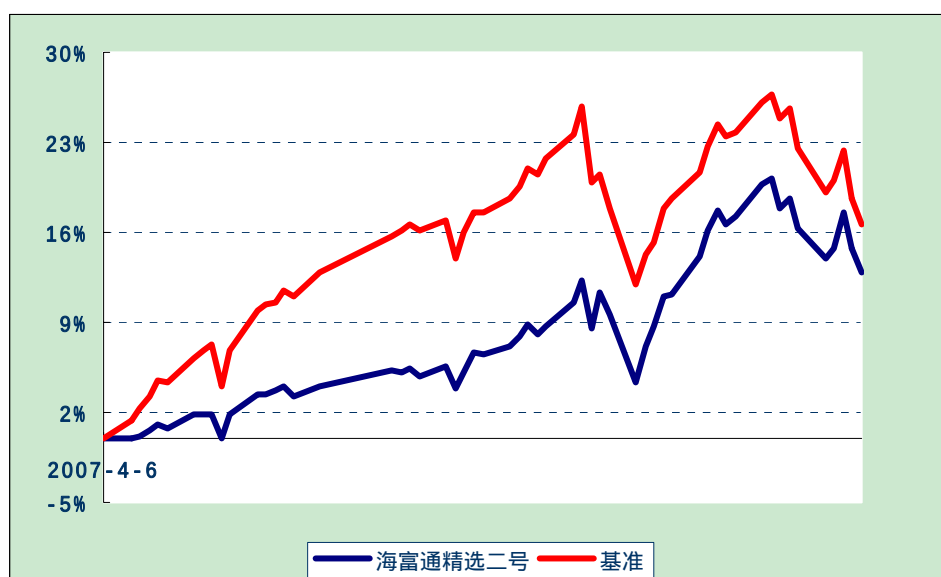
（二）基金净值表现

1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较：

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 1 个月	1.44%	2.05%	-3.27%	2.06%	4.71%	-0.02%
自基金合同生效起至今	12.90%	1.54%	16.61%	1.77%	-3.71%	-0.24%

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
海富通精选贰号混合型证券投资基金基金（海富通贰号）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对比

（2007 年 4 月 9 日（基金合同生效日）至 2007 年 6 月 30 日）



注：1、本基金合同自 2007 年 4 月 9 日起生效，截至报告日本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金仍处于建仓期内。

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

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比利时富通基金管理公司于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。海富通精

选贰号混合型证券投资基金是基金管理人管理的第七只开放式基金，除本基金外，本基金管理人目前还管理着另外六只开放式基金——海富通精选证券投资基金、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、海富通强化回报混合型证券投资基金和海富通风格优势股票型证券投资基金。

2、基金经理简介

陈洪先生，副总经理兼投资总监，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 4 月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选基金基金经理，2005 年 7 月至 2006 年 9 月任海富通股票基金基金经理，2006 年 3 月至 9 月任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，2007 年 2 月起兼任海富通风格优势基金基金经理，2007 年 4 月起兼任海富通精选贰号基金基金经理。

丁俊先生，硕士。2002 年 7 月至 2006 年 4 月就职于平安资产管理公司，曾任权益投资部研究主管，2006 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通精选基金、海富通风格优势基金和海富通精选贰号基金基金经理助理。

（二）报告期内基金运作的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、《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》、《海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书》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

二零零七年上半年，A 股市场延续了二零零六年的单边上扬，截至 6 月 30 日上证综指涨幅达到 42.8%。强劲的宏观经济和持续超越预期的上市公司业绩成为指数不断创出新高的根本动力。由此激发的股市赚钱效应也唤醒了储蓄资金的投资意识，新增资金源源不断涌入 A 股市场。但低价绩差股的持续暴涨导致了 A 股市场的结构性泡沫。同时政府为抑制流动性和宏观经济热度，陆续出台了发行特别国债、降低出口退税、QDII 等政策。在此综合影响下 A 股市场再次出现了宽幅振荡走势，一批得益于宏观经济高速增长而业绩超越预期的蓝筹公司成为市场稳定的中流砥柱，市场重新回归到价值判断时代。就债券市场而言，2007 上半年货币政策继续保持紧缩，债券市场收益率迅速走高。财政部发行特别国债被市场预期以后，收益率曲线趋于陡峭。行业方面，天相行业指数中有 22 个涨幅超过了 100%，贸易、综合、化纤、纺织服装和交通仓储涨幅居前。

海富通精选贰号基金成立之后，主要从以下方面来建仓：一是基于人民币加速升值的判断，重点配置了保险、地产等受益行业的龙头公司；二是在二零零六年涨幅相对滞后的行业如家电、汽车中，积极挖掘低估的优势公司加以持有；三是自下而上选择宏观经济高速增长背景下业绩有望继续超越预期的公司。由于指数上升过程中，建仓速度难以跟上市场上涨幅度，故净值涨幅低于同期业绩基准。至于债券投资，海富通精选贰号基金债券组合保持低仓位和短久期策略，规避了债券下跌的风险。

报告期内，海富通精选贰号基金净值增长率为 12.9%，同期基金业绩比较基准收益率为 16.61%，超额收益为-3.71%。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海富通认为，未来中国经济依然将在出口、消费、投资三架马车齐头并进的拉动下保持高速增长态势，为 A 股市场持续走牛奠定坚实的基础。而政府为防止经济由偏快向过快发展，预计还将继续落实和出台市场化的宏观调控政策。但也应该看到，市场化的宏观调控政策有利于优化经济发展结构，拉长经济上升周期，促进上市公司业绩继续保持高速增长。

基于此海富通精选贰号基金将着重关注以下投资方向：一是继续把握人民币加速升值的主线，在金融、地产、航空等受益行业中积极寻觅优势公司；二是针对国家陆续推出的节能减排、淘汰落后产能等相关政策，选择能够从中获益的龙头公司；三是关注外延式增长，挖掘有实质性变化的资产重组和注入；四是继续寻觅全球产业转移和中国产业结构升级下存在飞跃发展机会的公司；五是选择能在奥运经济中切实受益且能以此为契机提升自身核心竞争力的公司。至于债券投资上，宏观经济因素以及宏观政策面的判断是决定下半年行情的主要因素，其他如债券供给压力加大，大盘股加速发行，对债券价格有负面影响。海富通精选贰号基金将继续强化流动性管理，主要投资短期债券以获取稳定收益，控制风险。

四、托管人报告

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对海富通精选贰号混合型证券投资基金（以下称“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，不存在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。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对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进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本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真实、准确和完整。

五、财务会计报告

（一）：半年度会计报表

1、资产负债表

2007 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	2007 年 6 月 30 日
资产		
银行存款		1,425,789,862.03

结算备付金		51,967,102.92
交易保证金		500,000.00
应收证券清算款		72,498,199.79
应收股利		359,965.26
应收利息	1	21,692,800.54
应收申购款		11,290,729.41
其他应收款		-
股票投资市值		7,023,398,431.39
其中：股票投资成本		6,070,413,775.59
债券投资市值		1,666,315,889.58
其中：债券投资成本		1,666,315,889.58
权证投资市值		-
其中：权证投资成本		-
买入返售证券		-
资产总计		10,273,812,980.92

负债及持有人权益

负债		
应付证券清算款		-
应付赎回款		87,977,747.97
应付赎回费		317,872.84
应付管理人报酬		12,822,551.98
应付托管费		2,137,091.99
应付佣金	2	8,603,138.36
应付利息		-
其他应付款	3	750,000.00
卖出回购证券款		-
预提费用	4	130,134.04
负债合计		112,738,537.18

持有人权益		
实收基金	5	8,999,838,981.53
未实现利得	6	970,364,446.50
未分配基金净收益		190,871,015.71
持有人权益合计		10,161,074,443.74

(2007 年 6 月 30 日每单位基金资产净值：1.129 元)

负债及持有人权益总计		10,273,812,980.92
------------	--	-------------------

后附会计报表附注为本会计报表的组成部

分。

2、经营业绩表及收益分配表

2007 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	2007.4.9 (基金合同生效日 - 2007.6.30)
收入		
股票差价收入	7	182,036,183.75
债券差价收入	8	(840,798.16)
权证差价收入		-
债券利息收入		3,761,904.40
存款利息收入		6,388,501.50
股利收入		25,973,406.28
买入返售证券收入		7,040,470.84
其他收入	9	2,662,390.97
收入合计		227,022,059.58
费用		
基金管理人报酬		(32,298,262.08)
基金托管费		(5,383,043.66)
卖出回购证券支出		(786,669.59)
其他费用	10	(165,712.02)
其中：信息披露费		(81,639.63)
审计费用		(48,494.41)
费用合计		(38,633,687.35)
基金净收益		188,388,372.23
加：未实现估值增值/(减值)变动数	6	952,984,655.80
基金经营业绩		1,141,373,028.03
基金净收益		188,388,372.23
加：年/(期)初基金净收益		-
本年/(期)申购基金份额的损益平准金		18,411,793.05
本年/(期)赎回基金份额的损益平准金		(15,929,149.57)
可供分配基金净收益		190,871,015.71
减：本年/(期)已分配基金净收益	11	-
未分配基金净收益		190,871,015.71

后附会计报表附注为本会计报表的组成部

分。

3、基金净值变动表

2007 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)

	2007.4.9 (基金合同生效日) - 2007.6.30
年/(期)初基金净值	8,599,641,740.00
本年/(期)经营活动	
基金净收益	188,388,372.23
未实现估值增值/(减值)变动数	952,984,655.80
经营活动产生的基金净值变动数	1,141,373,028.03
本年/(期)基金份额交易	
基金申购款	2,057,130,133.31
其中：分红再投资	-
基金赎回款	(1,637,070,457.60)
基金份额交易产生的基金净值变动数	420,059,675.71
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	
年/(期)末基金净值	10,161,074,443.74

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 半年度会计报表附注

1. 本基金的基本情况

海富通精选贰号混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]63号《关于同意海富通精选贰号混合型证券投资基金募集的批复》核准，由基金发起人海富通基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通股票证券投资基金基金合同》发起。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 8,596,643,748.57 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 031 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 4 月 9 日正式

生效，基金合同生效日的基金份额总额为 8,599,641,740.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 2,997,991.43 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

2、列示本报告期所采用的主要会计政策和会计估计。

(a) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2007 年 4 月 9 日(基金合同生效日)至 2007 年 6 月 30 日。

(b) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(c) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(d) 基金资产的估值原则

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，自2006年11月13日起，基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交

易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(v) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(e) 证券投资基金成本计价方法

(i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按附注3(e)(iii)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(f) 收入/(损失)的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(g) 费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(h) 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

(i) 未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(j) 损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(k) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至少一次，最多六次，单次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%；但若当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。基金当期收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

3、本报告期无重大会计差错。

4、本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易

(1) 关联方关系发生变化的情况

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)(1)	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

中国银行股份有限公司由中国银行整体改建而成，于 2004 年 8 月 26 日依法成立，并自成立之日起完整承继中国银行的资产、负债和所有业务。

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

无通过关联方席位进行的交易。

本会计期间内，无关联方持有本基金份额。

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 × 1.5% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 32,298,262.08 元。

基金托管费

支付基金托管人中国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 × 0.25% / 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 5,383,043.66 元。

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保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 1,425,789,862.03 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 6,211,294.10 元。

本基金用于证券交易结算的资金通过“中国银行股份有限公司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 51,967,102.92 元计入结算备付金科目。

本基金在 2007 年上半年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

2007 年 4 月 9 日
至 2007 年 6 月 30 日

买入债券结算金额	-
卖出债券结算金额	-
卖出回购证券协议金额	1,157,800,000.00
卖出回购证券利息支出	786,669.59

5.、基金会计报表重要项目说明

(1) 应收利息

2007 年 6 月 30 日
(单位：人民币 元)

应收银行存款利息	425,443.15
应收结算备付金利息	21,046.68
应收直销认申购款利息	308.03
应收债券利息	21,246,002.68
	21,692,800.54

(2) 应付佣金

2007 年 6 月 30 日
(单位：人民币 元)

国元证券	2,840,581.44
中信证券	2,564,614.16
申银万国	3,197,942.76
	8,603,138.36

(3) 其他应付款

	2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
应付券商席位保证金	750,000.00
	<u>750,000.00</u>

(4) 预提费用

	2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
信息披露费	81,639.63
审计费用	48,494.41
	<u>130,134.04</u>

(5) 实收基金

	基金份额数
	(单位：人民币 元)
2007 年 4 月 9 日(基金合同生效日)	8,599,641,740.00
本年申购	1,866,116,601.99
其中：红利再投资	-
本年赎回	(1,465,919,360.46)
2007 年 6 月 30 日	<u>8,999,838,981.53</u>

(6) 未实现利得

	未实现估值 增值/(减值) (a)	未实现利得/ (损失)平准金	单位：人民币 元 合计
2007 年 4 月 9 日(基金合同生效日)	-	-	-
本年净变动数	952,984,655.80	-	952,984,655.80
本年申购基金份额	-	172,601,738.27	172,601,738.27
其中：红利再投资	-	-	-
本年赎回基金份额	-	(155,221,947.57)	(155,221,947.57)
2007 年 6 月 30 日	<u>952,984,655.80</u>	<u>17,379,790.70</u>	<u>970,364,446.50</u>

(a) 未实现估值增值/(减值)按投资类别分项列示如下：

	2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
股票投资	952,984,655.80
权证投资	-
	<u>952,984,655.80</u>

(7) 股票差价收入

2007 年 4 月 9 日（基金合
同生效日） - 2007 年 6 月
30 日

（单位：人民币 元）

卖出股票成交总额	2,416,759,283.55
减：应付佣金总额	(2,034,785.73)
减：卖出股票成本总额	(2,232,688,314.07)
	<u>182,036,183.75</u>

（8）债券差价收入

2007 年 4 月 9 日（基金合
同生效日） - 2007 年 6 月
30 日

（单位：人民币 元）

卖出债券结算金额	1,762,689,817.27
减：应收利息总额	(7,764,467.37)
减：卖出债券成本总额	(1,755,766,148.06)
	<u>(840,798.16)</u>

（9）其他收入

2007 年 4 月 9 日（基金合
同生效日） - 2007 年 6 月
30 日

（单位：人民币 元）

赎回基金补偿收入	1,990,352.76
转换基金补偿收入	21,046.28
其他	650,991.93
	<u>2,662,390.97</u>

（10）其他费用

2007 年 4 月 9 日（基金合
同生效日） - 2007 年 6 月
30 日

（单位：人民币 元）

信息披露费	81,639.63
审计费用	48,494.41
交易所回购交易费用	26,331.82
其他	9,246.16
	<u>165,712.02</u>

（11）收益分配

无。

（12）报告期内本基金因股权分置改革而获得非流通股东支付的现金对价

无。

(13) 本报告期末基金未持有银行定期存款。待摊费用期末无余额。股票投资市值为 7,023,398,431.39 元, 成本为 6,070,413,775.59 元, 投资估值增值为 952,984,655.80 元。

6、报告期末流通转让受到限制的基金资产的说明

序号	流通受限 证券名称	类型	流通受限 截止日期	数量(股)	报告期末市值 (元)	占基金净 值的比例
1	天津普林	网下申购	2007.8.16	95,400	1,670,454.00	0.02%
2	东南网架	网下申购	2007.8.30	46,891	1,089,746.84	0.01%
3	安纳达	网下申购	2007.8.30	14,784	337,223.04	0.01%
4	实益达	网下申购	2007.9.13	25,390	1,198,154.10	0.01%
5	中国远洋	网下申购	2007.9.26	2,247,222	41,034,273.72	0.40%
合计					45,329,851.70	0.45%

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
股票投资	7,023,398,431.39	68.36%
债券投资	1,666,315,889.58	16.22%
银行存款及清算备付金合计	1,477,756,964.95	14.38%
应收证券清算款	72,498,199.79	0.71%
权证投资	-	0.00%
其他资产	33,843,495.21	0.33%
合计	10,273,812,980.92	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)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	75,920,379.60	0.75%
B 采掘业	136,042,063.80	1.34%
C 制造业	2,665,034,192.63	26.23%
C0 食品、饮料	278,105,009.72	2.74%
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	152,601,590.07	1.50%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	304,227,959.84	2.99%
C5 电子	2,868,608.10	0.03%

C6 金属、非金属	443,388,620.72	4.36%
C7 机械、设备、仪表	1,396,569,785.35	13.75%
C8 医药、生物制品	87,272,618.83	0.86%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	264,822,089.92	2.61%
E 建筑业	1,089,746.84	0.01%
F 交通运输、仓储业	547,154,342.32	5.38%
G 信息技术业	386,212,299.83	3.80%
H 批发和零售贸易	134,470,537.88	1.32%
I 金融、保险业	1,448,466,768.75	14.26%
J 房地产业	978,971,369.70	9.63%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	183,258,272.12	1.80%
M 综合类	201,956,368.00	1.99%
合计	7,023,398,431.39	69.12%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	期末数量(股)	期末市值 (人民币元)	市值占基金 资产净值%
1	000402	金 融 街	16,000,457	464,013,253.00	4.57%
2	600786	东方锅炉	6,001,631	377,982,720.38	3.72%
3	600000	浦发银行	10,000,068	365,902,488.12	3.60%
4	601318	中国平安	5,000,036	357,552,574.36	3.52%
5	000157	中联重科	6,999,880	269,495,380.00	2.65%
6	600519	贵州茅台	1,999,904	239,348,510.72	2.36%
7	000002	万 科 A	12,000,027	229,440,516.24	2.26%
8	600797	浙大网新	25,000,162	219,501,422.36	2.16%
9	600030	中信证券	3,999,889	211,874,120.33	2.09%
10	600415	小商品城	1,999,568	201,956,368.00	1.99%
11	000652	泰达股份	6,999,935	197,958,161.80	1.95%
12	600309	烟台万华	3,500,000	187,460,000.00	1.85%
13	000338	潍柴动力	2,386,620	187,349,670.00	1.84%
14	600037	歌华有线	6,999,934	183,258,272.12	1.80%
15	000527	美的电器	6,000,470	182,414,288.00	1.80%
16	600036	招商银行	7,000,093	172,062,285.94	1.69%
17	600015	华夏银行	14,000,000	168,560,000.00	1.66%
18	600718	东软股份	4,000,741	166,710,877.47	1.64%
19	600019	宝钢股份	15,000,000	165,000,000.00	1.62%
20	000825	太钢不锈	8,000,000	160,480,000.00	1.58%
21	600963	岳阳纸业	6,000,849	152,601,590.07	1.50%
22	600900	长江电力	10,000,056	151,200,846.72	1.49%

23	601006	大秦铁路	9,000,000	136,260,000.00	1.34%
24	000983	西山煤电	4,819,060	136,042,063.80	1.34%
25	600628	新世界	7,000,028	134,470,537.88	1.32%
26	600016	民生银行	10,710,000	122,415,300.00	1.20%
27	600585	海螺水泥	1,999,807	117,908,620.72	1.16%
28	600176	中国玻纤	8,376,312	116,430,736.80	1.15%
29	000027	深能源 A	5,000,935	113,621,243.20	1.12%
30	000024	招商地产	2,017,798	99,073,881.80	0.98%
31	000528	柳 工	4,000,026	98,000,637.00	0.96%
32	600383	金地集团	2,796,948	95,711,560.56	0.94%
33	600085	同仁堂	2,268,589	87,272,618.83	0.86%
34	600897	厦门空港	4,351,640	76,675,896.80	0.75%
35	002069	獐 子 岛	1,000,005	75,920,379.60	0.75%
36	600495	晋西车轴	2,742,773	74,877,702.90	0.74%
37	600376	天鸿宝业	1,965,334	73,012,158.10	0.72%
38	600765	力源液压	1,905,736	67,177,194.00	0.66%
39	000768	西飞国际	1,915,541	59,132,750.67	0.58%
40	600029	南方航空	6,534,500	56,066,010.00	0.55%
41	601398	工商银行	10,000,000	50,100,000.00	0.49%
42	000800	一汽轿车	3,999,942	43,599,367.80	0.43%
43	601919	中国远洋	2,247,222	41,034,273.72	0.40%
44	601111	中国国航	4,000,000	39,160,000.00	0.39%
45	000848	承德露露	1,336,431	38,756,499.00	0.38%
46	002013	中航精机	1,883,509	36,540,074.60	0.36%
47	600641	万业企业	1,000,000	17,720,000.00	0.17%
48	002134	天津普林	95,400	1,670,454.00	0.02%
49	002137	实 益 达	25,390	1,198,154.10	0.01%
50	002135	东南网架	46,891	1,089,746.84	0.01%
51	002136	安 纳 达	14,784	337,223.04	0.00%
		股票投资合计：		7,023,398,431.39	69.12%

（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%或前 20 名的股票明细

序号	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
1	000402	金 融 街	377,094,909.72	3.71%
2	600786	东方锅炉	313,261,213.61	3.08%
3	600000	浦发银行	307,036,066.62	3.02%
4	000157	中联重科	303,652,340.98	2.99%
5	600036	招商银行	272,177,564.11	2.68%

6	601318	中国平安	264,944,435.74	2.61%
7	600797	浙大网新	263,551,654.10	2.59%
8	600028	中国石化	262,921,484.41	2.59%
9	600030	中信证券	221,318,763.76	2.18%
10	000793	华闻传媒	219,667,835.05	2.16%
11	600009	上海机场	216,291,069.65	2.13%
12	601006	大秦铁路	215,560,782.72	2.12%
13	000825	太钢不锈	214,968,840.66	2.12%
14	000002	万 科 A	202,808,297.25	2.00%
15	600519	贵州茅台	199,359,284.16	1.96%
16	600019	宝钢股份	199,043,504.60	1.96%
17	000338	潍柴动力	190,115,356.38	1.87%
18	600037	歌华有线	184,732,355.95	1.82%
19	600309	烟台万华	180,127,746.22	1.77%
20	600015	华夏银行	173,886,728.91	1.71%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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的比例
1	600028	中国石化	321,523,918.15	3.16%
2	600009	上海机场	222,146,956.20	2.19%
3	000793	华闻传媒	182,845,392.93	1.80%
4	600036	招商银行	160,967,506.63	1.58%
5	600641	万业企业	133,936,627.75	1.32%
6	600011	华能国际	131,919,019.22	1.30%
7	600795	国电电力	127,950,447.00	1.26%
8	600886	国投电力	109,196,337.95	1.07%
9	000157	中联重科	107,300,423.10	1.06%
10	000825	太钢不锈	101,552,163.88	1.00%
11	601006	大秦铁路	90,030,204.58	0.89%
12	000012	南 玻 A	86,138,999.78	0.85%
13	600312	平高电气	81,169,595.37	0.80%
14	601398	工商银行	71,781,548.65	0.71%
15	600309	烟台万华	65,894,095.67	0.65%
16	600533	栖霞建设	56,873,589.26	0.56%
17	000777	中核科技	50,764,764.75	0.50%
18	600183	生益科技	35,471,515.99	0.35%
19	000539	粤电力 A	34,529,512.57	0.34%
20	600019	宝钢股份	33,440,752.18	0.33%

3、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	卖出股票收入总额
8,303,102,089.66	2,416,759,283.55

（五）报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值（元）	占基金资产净值比例
1	国 债	59,833,020.00	0.59%
2	金融债券	321,223,020.00	3.16%
3	央行票据	1,202,935,052.05	11.84%
4	企业债	82,324,797.53	0.81%
	合 计	1,666,315,889.58	16.40%

（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

序号	债券名称	市值（元）	占基金资产净值比例
1	07 央票 04	970,045,479.45	9.54%
2	07 央票 56	193,986,394.52	1.91%
3	01 国开 09	171,269,220.00	1.69%
4	07 进出 04	99,952,300.00	0.98%
5	07 国债 10	59,833,020.00	0.59%

（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）基金在报告期内的权证投资明细

无。

（九）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	500,000.00
应收股利	359,965.26
应收利息	21,692,800.54
应收申购款	11,290,729.41
买入返售证券	-
合计	33,843,495.21

4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细
无。

5、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
无。

6、报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

七、基金份额持有人情况

（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：	316,336
报告期末平均每户持有的基金份额：	28,450.25

（二）报告期末基金份额持有人结构

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额：	8,999,838,981.53	100.00%
其中：机构投资者持有的基金份额	83,639,798.68	0.93%
个人投资者持有的基金份额	8,916,199,182.85	99.07%

（三）公司从业人员持有的基金份额的总量及占该只基金份额的比例

无。

八、开放式基金份额变动情况

单位：份	
基金合同生效日的基金份额总额	8,599,641,740.00
报告期期初份额总额	8,599,641,740.00
报告期期末基金份额总额	8,999,838,981.53
报告期间基金总申购份额	1,866,116,601.99
报告期间基金总赎回份额	1,465,919,360.46

九、重大事件揭示

- 1、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。
- 2、报告期内，基金管理人、基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。
- 3、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。

4、报告期内本基金投资策略未发生改变。

5、基金收益分配事项

报告期内，本基金未进行收益分配。

6、报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

8、本报告期内本基金合同生效，基金租用证券公司专用交易席位情况如下：

代号	券商名称	股票成交金额（元）	占股票成交总额	权证成交金额（元）	占权证成交总额
1	国元证券	3,482,601,465.47	32.80%	8,995,264.08	19.07%
2	中信证券	3,277,440,291.66	30.87%	-	0.00%
3	申银万国	3,858,028,790.86	36.33%	38,164,390.21	80.93%
	合计	10,618,070,547.99	100.00%	47,159,654.29	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	国元证券	8,848,300,000.00	84.16%	2,840,581.44	33.02%
2	中信证券	-	0.00%	2,564,614.16	29.81%
3	申银万国	1,665,900,000.00	15.84%	3,197,942.76	37.17%
	合计	10,514,200,000.00	100.00%	8,603,138.36	100.00%

上述佣金按市场佣金率计算，已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。

9、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.) 2007年3月22日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通精选贰号基金基金合同、招募说明书、及发售公告。
- (2.) 2007年3月26日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通精选贰号基金限额发售方式的特别提醒。
- (3.) 2007年4月3日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通精选贰号基金提前结束募集的公告。
- (4.) 2007年4月10日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通精选贰号基金合同生效公告。
- (5.) 2007年5月16日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于旗下海富通精选贰号基金增加代销机构的公告。
- (6.) 2007年5月16日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通精选贰号基金开放申购、赎回和转换业务的公告。
- (7.) 2007年5月19日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》

上刊登了关于开通浦发银行网上交易的公告。

(8.)2007 年 5 月 21 日,本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通精选贰号基金在中信建投证券开展网上交易费率优惠活动的公告。

十、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立海富通精选贰号混合型证券投资基金的文件
- 2、海富通精选贰号混合型证券投资基金基金合同
- 3、海富通精选贰号混合型证券投资基金招募说明书
- 4、海富通精选贰号混合型证券投资基金托管协议
- 5、中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- 6、报告期内海富通精选贰号混合型证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

(二) 存放地点：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼基金管理人办公地址。

(三) 查阅方式：投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

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 或 40088-40099

网址：www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司

2007 年 8 月 28 日