

普丰证券投资基金 2005 年半年度报告

基金管理人：鹏华基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行

送出日期： 2005年8月26日

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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2005年8月26日复核了本报告中的财务指标、基金净值表现、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。

目 录

一、基金简介.....	3
二、主要财务指标和基金净值表现（未经审计）.....	4
三、基金管理人报告.....	6
四、基金托管人报告.....	7
五、基金财务会计报告（未经审计）.....	8
六、基金投资组合报告.....	19
七、基金份额持有人结构.....	42
八、重大事件揭示.....	43
九、备查文件目录.....	45

一、基金简介

(一) 基金名称：普丰证券投资基金

基金简称：基金普丰

交易代码：184693

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999年7月14日

报告期末基金份额总额：30亿份

基金合同存续期：15年

基金份额上市交易的证券交易所：深圳证券交易所

上市日期：1999年7月30日

(二) 基金投资目标：导入指数化投资概念，增加投资广度，分散投资风险，同时贯彻绩优、成长的选股原则。通过指数化投资和优化组合投资两种模式的积极结合，实现风险与收益的有效平衡，力争使基金取得超过市场平均收益率以上的投资收益，实现基金财产的长期稳定增值。

基金投资策略：本基金将指数化投资与优化组合投资有机结合，在进一步分散风险的同时，积极投资绩优股和成长股，将基金财产按一定比例分为指数化投资部分、债券投资部分和优化组合投资部分，力争在降低风险的同时，实现基金财产增值。

基金业绩比较基准：无

基金风险收益特征：无

(三) 基金管理人

法定名称：鹏华基金管理有限公司

注册及办公地址：深圳市深南东路5047号发展银行大厦18、27层

邮政编码：518001

法定代表人：孙枫
信息披露负责人：程国洪
联系电话：0755-82353668 82080663
传真：0755-82080742
电子邮箱：ph@mail.phfund.com.cn

(四) 基金托管人

法定名称：中国工商银行
注册及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码：100032
法定代表人：姜建清
信息披露负责人：庄为
联系电话：010-66107333
传真：010-66106904
电子邮箱：custody@icbc.com.cn

(五) 信息披露

报纸名称：中国证券报，证券时报，上海证券报
登载半年度报告正文的管理人互联网网址：<http://www.phfund.com.cn>
基金半年度报告置备地点：深圳市深南东路 5047 号发展银行大厦 18、27 层鹏华基金管理
有限公司
北京市西城区复兴门内大街 55 号中国工商银行

二、主要财务指标和基金净值表现（未经审计）

（一）财务指标

单位：人民币元

序号	项 目	2005年6月30日
1	基金本期净收益	-185,524,826.47

2	基金份额本期净收益	0.0618
3	期末可供分配基金收益	-392,192,352.75
4	期末可供分配基金份额收益	-0.1307
5	期末基金资产净值	2,607,807,647.25
6	期末基金份额净值	0.8693
7	基金加权平均净值收益率	-6.99%
8	本期基金份额净值增长率	-1.94%
9	基金份额累计净值增长率	6.97%

提示：上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,封闭式基金交易佣金等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

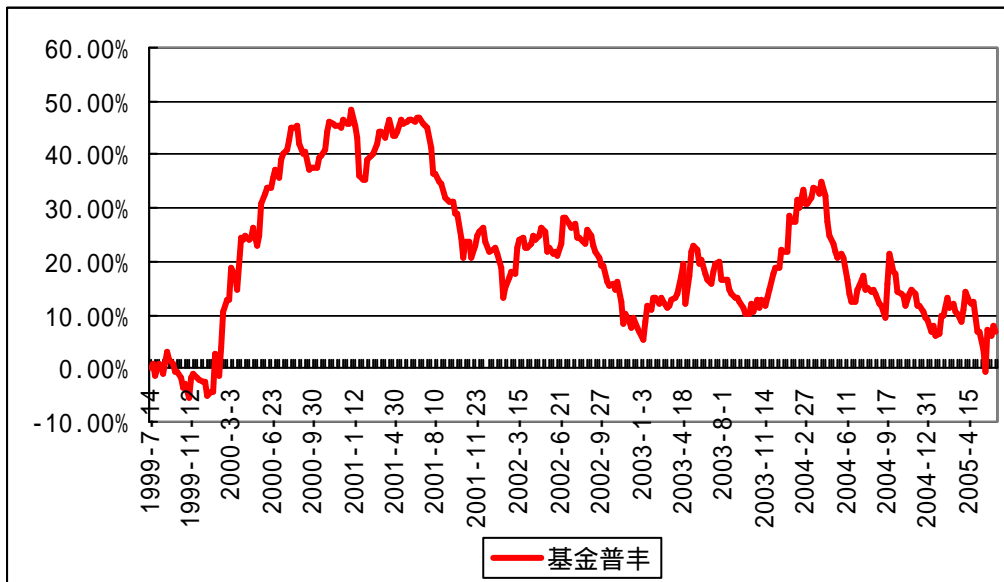
(二) 基金净值表现

(1) 本基金历史各时间段基金份额净值增长率

	净值增长率	净值增长率标准差
过去一个月	3.33%	4.57%
过去三个月	-1.67%	3.37%
过去六个月	-1.94%	2.67%
过去一年	-4.95%	2.33%
过去三年	-16.53%	1.98%
自基金成立起至今	6.97%	2.01%

注：基金合同中未规定业绩比较基准。

(2) 本基金自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况走势图



三、基金管理人报告

（一）基金管理人简介

鹏华基金管理有限公司成立于 1998 年 12 月 22 日，业务范围包括基金设立、募集、管理基金业务及中国证监会批准的其他业务。公司股东由国信证券有限公司、方正证券有限责任公司、安信信托投资股份有限公司、安徽国元信托投资有限责任公司组成。公司原注册资本 8,000 万元人民币，后于 2001 年 9 月完成增资扩股，增至 15,000 万元人民币。公司目前管理四只封闭式基金、五只开放式基金和三只社保组合。伴随着中国证券市场的发展壮大，面对中国入世后的机遇和挑战，身处中国基金业高速发展的历史时刻，鹏华基金管理有限公司将在进一步提高基金管理水平、完善市场服务体系、新业务开发、国际合作等多方面加快步伐，努力进取，继续诚实信用、勤勉尽责地为广大基金投资者服务，为中国基金业的健康发展做出应有贡献。

（二）基金经理简历

易贵海，基金普丰基金经理，男，1964 年出生，经济学硕士。历任大鹏证券资产管理中心部门经理，兆富投资有限公司投资部经理，长盛基金管理有限公司同盛基金经理助理、基金经理。2004 年 2 月加入鹏华基金管理有限公司。

（三）基金运作的合规守信情况说明

基金运作合规性声明：本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《普丰证券投资基金基金合同》的约定，本着“诚实信用、勤勉尽责，取信于市场、取信于社会”的原则管理和运用基金财产，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，忠实履行基金管理职责。2005 年上半年本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定。

（四）投资策略和业绩表现说明

上半年深沪股市在全流通和国际化的大旗下，继续价值回归之路，振荡下行。在垃圾股和问题股暴跌的同时，基金重仓持有的蓝筹股在 2 季度亦出现了大幅度的下跌，基金净值普遍负增长。上半年普丰基金净值增长率为-1.94%，同期深圳综合指数为-17.4%，上证综合指数为-14.65%。

上半年普丰基金坚持既定的稳健防御的行业配置策略，并且自下而上严格精选个股，使得基金业绩有了明显的提升，但由于受指数投资部分拖累，仍然使基金份额持有人蒙受了损失，在此深表歉意。

上半年深沪股市的下跌，原因是多方面的，除了宏观经济的波动，更多的是来自于对历史遗留问题的清理和解决。应该看到，股权分置的改革短期对市场是阵痛，但功在千秋，利在长远。

(五) 市场展望

展望下半年，由于宏观经济形势的不明朗，股权分置改革对投资预期的短期干扰，下半年仍难以出现反转行情。但估值水平不断下降，随着管理层对直接融资重要性的逐步认识，股权分置改革成效的逐渐显现，深沪股市必将逐步走出历史的低谷。但全流通和国际化的现实，将使市场继续两极分化，清除杂草，继续结构调整和优化仍将是战胜市场的不二法则。下半年股权分置改革试点将继续深化，“寻宝”游戏仍将占据市场的重要地位，考虑股权分置改革后的估值变化将成为影响股票结构分化的重要因素。

从行业层面来看，由于估值水平的改变以及宏观经济的微妙变化，上下游比较，谁优谁劣，已不能简单定论。不看好周期类中的钢铁，估值上有优势的银行和电力应有表现的机会。

四、基金托管人报告

2005 年上半年度，本托管人在对普丰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。

2005 年上半年度普丰证券投资基金管理人——鹏华基金管理有限公司在投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对普丰证券投资基金管理人——鹏华基金管理有限公司在 2005 年上半年度所编制和披露的普丰证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容具有真实、准确和完整性。

中国工商银行资产托管部

2005 年 7 月 22 日

五、基金财务会计报告（未经审计）

（一）基金会计报表

1、普丰证券投资基金本报告期末与前一个年度末的比较式资产负债表

单位：人民币元

项目	行次	2005年6月30日	2004年12月31日
资产			
银行存款	1	114,815,744.43	97,477,477.17
清算备付金	2	5,271,131.73	-
交易保证金	3	1,250,000.00	1,000,000.00
应收证券清算款	4	17,772,471.61	10,137,648.81
应收股利	5	332,203.13	-
应收利息[说明(1)]	6	11,117,552.12	6,859,408.74
应收申购款	7	-	-
其他应收款	8	-	-
股票投资 - 市值[说明(2)]	9	1,803,838,086.01	1,890,920,004.31
其中：股票投资成本[说明(2)]	10	1,845,377,046.90	2,050,729,337.63
债券投资 - 市值[说明(2)]	11	661,146,918.57	673,378,840.36
其中：债券投资成本[说明(2)]	12	657,826,500.90	685,570,752.55
配股权证	13	-	-
买入返售证券	14	-	-
待摊费用	15	-	-
其他资产	16	-	-
资产总计	17	2,615,544,107.60	2,679,773,379.39
负债		-	-
应付证券清算款	18	0.00	12,567,540.86
应付赎回款	19	-	-
应付赎回费	20	-	-
应付管理人报酬	21	2,647,111.06	2,858,891.16
应付托管费	22	529,422.19	571,778.23
应付佣金[说明(3)]	23	1,553,968.06	1,357,405.54
应付利息	24	-	-
应付收益	25		
未交税金	26	2,777,850.17	2,767,992.17

其他应付款项	27	-	-
卖出回购证券款	28	-	-
短期借款	29	-	-
预提费用[说明(4)]	30	228,108.87	100,000.00
其他负债	31	-	-
负债合计		7,736,460.35	20,223,607.96
持有人权益	32	-	-
实收基金	33	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得	34	-38,218,543.22	-172,001,245.51
未分配收益	35	-353,973,809.53	-168,448,983.06
持有人权益合计	36	2,607,807,647.25	2,659,549,771.43
负债及持有人权益总计	37	2,615,544,107.60	2,679,773,379.39

2、普丰证券投资基金本报告期及上年度可比期间的比较式经营业绩表

单位：人民币元

项目	行次	2005年6月30日	2004年6月30日
收入：	1	-165,269,850.11	173,426,365.69
股票差价收入[说明(5)]	2	-193,474,322.84	176,253,998.80
债券差价收入[说明(6)]	3	-302,148.20	-20,887,739.05
债券利息收入	4	8,654,413.33	9,536,648.45
存款利息收入	5	876,435.80	1,037,078.07
股利收入	6	18,921,699.28	7,354,792.42
买入返售证券收入	7	-	-
其他收入[说明(7)]	8	54,072.52	131,587.00
费用：	9	20,254,976.36	23,884,023.79
基金管理人报酬	10	16,488,221.30	19,136,527.06
基金托管费	11	3,297,644.20	3,827,305.37
卖出回购证券支出	12	219,533.14	675,316.25
利息支出	13	-	-
其他费用[说明(8)]	14	249,577.72	244,875.11
其中：上市年费	15	29,752.78	29,835.26
信息披露费	16	148,767.52	149,179.94
审计费	17	49,588.57	49,726.04
其他	18	21,468.85	16,133.87
基金净收益	19	-185,524,826.47	149,542,341.90
加：未实现资本利得	20	133,782,702.29	-374,296,457.76
基金经营业绩	21	-51,742,124.18	-224,754,115.86

3、普丰证券投资基金本报告期及上年度可比期间的比较式收益分配表

单位：人民币元

项目	行次	2005年6月30日	2004年6月30日
本期基金净收益	1	-185,524,826.47	149,542,341.90
加：期初基金净收益	2	-168,448,983.06	-59,559,111.01
加：本期损益平准金	3	-	-
可供分配基金净收益	4	-353,973,809.53	89,983,230.89
加：以前年度损益调整	5	-	-
减：本期已分配基金净收益	6	-	-
期末基金净收益	7	-353,973,809.53	89,983,230.89

4、普丰证券投资基金本报告期及上年度可比期间的比较式基金净值变动表

单位：人民币元

项目	行次	2005年6月30日	2004年6月30日
一、期初基金净值	1	2,659,549,771.43	2,968,523,319.21
二、本期经营活动	2		
基金净收益	3	-185,524,826.47	149,542,341.90
未实现利得	4	133,782,702.29	-374,296,457.76
经营活动产生的基金净值变动数	5	-51,742,124.18	-224,754,115.86
三、本期基金份额交易	6	-	-
基金申购款	7	-	-
基金赎回款	8	-	-
基金份额交易产生的基金净值变动数	9	-	-
四、本期向持有人分配收益	10	-	-
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数	11	-	-
五、以前年度损益调整	12	-	-
因损益调整产生的净值变动数	13	-	-
六、期末基金净值	14	2,607,807,647.25	2,743,769,203.35

(二) 会计报表附注

1、基金的基本情况

普丰证券投资基金(以下简称“本基金”)由国信证券有限责任公司、方正证券有限责任公司、安信信托投资股份有限公司、安徽国元信托投资有限责任公司、鹏华基金管理有限公司共五家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和基金合同发起，经中国证券监督管理委员会(证监基字[1999]20号文)批准，基金合同于1999年7月14日生效。本基金为契约型封闭式，存续期15年，发行规模为30亿份基金份额。本基金的基金管理人为鹏华基金管理有限公司，

基金托管人为中国工商银行。《普丰证券投资基金招募说明书》、《普丰证券投资基金基金合同》等文件已按规定报送中国证监会备案。本基金经深圳证券交易所（以下简称深交所）深证上[1999]63号文审核同意，于1999年7月30日在深交所挂牌交易。

2、编制会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制，本会计报表披露方式则是根据中国证券监督管理委员会于2004年7月1日起施行的《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露编报规则第4号<基金投资组合报告的编制及披露>》进行编制及披露。

3、主要会计政策

(1) 会计年度

本基金的会计年度为公历1月1日至12月31日。本报告期为2005年1月1日至2005年6月30日。

(2) 记账本位币

以人民币为记账本位币，记账单位为元。

(3) 记账基础和计价原则

本基金的会计核算以权责发生制为记账原则，除股票投资和债券投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本为计价基础。

(4) 基金资产的估值原则

A. 股票投资

上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的平均价估值；估值日无交易的，以最近一个交易日的平均价估值；送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的平均价估值；首次公开发行的股票，按成本价估值。

B. 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日平均价估值，估值日没有交易的，按最近交易日

的平均价估值。证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日平均价减去债券平均价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值，估值日没有交易的，按最近交易日债券平均价计算得到的净价估值。银行间债券市场债券以不含息成本价估值。未上市交易债券的估值按购入成本估值。

C. 配股权证

从配股除权日起到配股确认日止，按平均价高于配股价的差额估值；如果平均价等于或低于配股价，则估值额为零。

(5) 证券投资的成本计价方法

A. 股票投资

股票投资按取得时的实际成本计价，出售成本按移动加权平均法计算。

B. 债券投资

债券投资按取得时的实际成本计价，出售的债券成本按移动加权平均法计算。

(6) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

核算本期已发生的、影响基金份额净值小数点后五位，应分摊计入本期的费用，摊销期限为本年度。

(7) 收入的确认和计量

A. 股票差价收入：应于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

B. 债券差价收入：按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账。证券交易所债券于卖出债券成交日确认买卖差价收入；银行间同业市场交易债券于实际收到价款时确认债券差价收入。

C. 债券利息收入：按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除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。

D. 存款利息收入：包括银行存款与清算备付金利息，按本金与适用的利率逐日计提的金额入账。

E. 股利收入：按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

F. 买入返售证券收入：按融出金额与成交利率，在融券期限内逐日计提入帐。

G. 其他收入：在实际收到时确认收入。

(8) 费用的确认和计量

A. 基金管理费

基金管理人的管理费根据《普丰证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值 1.25% 的年费率提取。

B. 基金托管费

基金托管人的托管费根据《普丰证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。

C. 卖出回购证券支出

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。

(9) 基金的收益分配政策

基金收益分配比例不得低于基金净收益的 90%；基金收益分配采取现金方式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内完成；基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；基金投资当年亏损，则不进行收益分配；每一基金份额享有同等分配权。基金收益分配后，每基金份额净值不能低于面值。

(10) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计

本期没有采取其他会计政策和会计估计。

(11) 会计政策、会计估计变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由

本期没有对会计政策、会计估计进行变更，与上年度会计报表相一致。

(12) 重大会计差错的内容和更正金额

本期没有重大会计差错。

4、税项

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《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》、财税[2005]102号《财政部、国家税务总局关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《财政部 国家税务总局关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项规定如下：

- (1) 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。
- (2) 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。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征企业所得税。
- (4) 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，自2005年6月13日起，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，即由原来20%的个人所得税调整为10%个人所得税。
- (5) 根据财税[2005]11号规定，从2005年1月24日起，将证券交易印花税税率由2‰调整为1‰。

5、资产负债表日后事项：无

6、关联方关系及交易

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
鹏华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国工商银行	基金托管人
国信证券有限责任公司	基金发起人、基金管理人的股东
方正证券有限责任公司	基金发起人、基金管理人的股东
安信信托投资股份有限公司	基金发起人、基金管理人的股东
安徽国元信托投资有限责任公司	基金发起人、基金管理人的股东

本报告期内关联方关系未发生变化。

(2) 关联方交易，下列关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

A. 通过关联方席位进行的交易，本交易是通过与关联方签订的证券交易席位租用协议进行，该协议按照与一般证券公司签订的协议条款订立。

关联方名称	年度	股票成交量(元)	占股票比例(%)	债券成交量(元)	占债券比例(%)	债券回购成交量(元)	占回购比例(%)
国信证券	2005 年上半年	236,378,523.00	6.87	9,442,895.00	3.65	0.00	0.00
	2004 年上半年	435,158,058.94	8.92	846,784.40	0.23	220,000,000.00	21.95

B. 通过关联方席位交易支付的佣金

关联方名称	年度	累计佣金(元)	占累计佣金比例(%)
国信证券	2005 年上半年	187,665.27	6.81
	2004 年上半年	343,522.92	8.84

注:佣金的计算公式

上海证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-买(卖)证管费-证券结算风险基金

深圳证券交易所的交易佣金=买(卖)成交金额×1‰-买(卖)经手费-证券结算风险基金

佣金比率按照与一般证券公司签订的协议条款订立。

C. 从关联方获得的服务说明

本基金与关联方已按同业统一的基金佣金计算方式和佣金比例签订了《证券交易席位租用协议》，若相关计算公式及比例发生变化的，以相关席位租用协议约定为准。根据协议规定，上述单位定期或不定期地为本基金管理人提供研究服务以及其他研究支持。

D. 关联方报酬

a. 基金管理人报酬

支付基金管理人鹏华基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值的 1.25%的年费率计提，逐日计提，按月支付，日管理费=前一日基金资产净值×1.25%÷当年天数。截止至 2005 年 6 月 30 日，本基金 2005 年上半年共需支付基金管理人报酬人民币 16,488,221.30 元。2004 年上半年本基金共支付基金管理人报酬人民币 19,136,527.06 元。

b. 基金托管人报酬

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，逐日

计提，按月支付，日托管费=前一日基金资产净值×0.25%÷当年天数。截止至 2005 年 6 月 30 日，本基金 2005 年上半年需支付基金托管人报酬人民币 3,297,644.20 元。2004 年上半年本基金共支付基金托管人报酬人民币 3,827,305.37 元。

E. 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

2005 年上半年本基金没有与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7、会计报表重要项目说明

(1)按银行存款利息、债券利息、买入返售证券利息等分项列示应收利息的金额：

人民币元

	2005 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	25,791.76
清算备付金利息	2,134.80
应收债券利息	11,089,625.56
合计	11,117,552.12

(2)按所估资产的种类分别列示投资估值增值的金额：

人民币元

	2005 年 6 月 30 日
股票	-41,538,960.89
债券	3,320,417.67
合计	-38,218,543.22

(3)按证券经营机构分别列示应付佣金的金额：

人民币元

	2005 年 6 月 30 日
华夏证券	126,020.15
平安证券	48,095.62
申银万国	291,154.01
招商证券	244,449.29

中银国际	57,835.40
中信证券	87,860.08
宏源证券	303,143.04
东海证券	68,982.91
银河证券	326,427.56
合计	1,553,968.06

(4) 预提费用明细:

人民币元

	2005年6月30日
上市年费	29,752.78
信息披露费	148,767.52
合计	228,108.87

(5) 股票差价收入:

人民币元

	2005年上半年
卖出股票成交总额	1,740,634,244.39
减: 卖出股票成本总额	1,932,659,627.70
减: 应付佣金	1,448,939.53
股票差价收入	- 193,474,322.84

(6) 债券差价收入:

人民币元

	2005年上半年
卖出债券成交总额	296,766,811.16
减: 卖出债券成本总额	293,404,779.53
减: 应收利息总额	3,664,179.83
债券差价收入	- 302,148.20

(7)其他收入明细:

人民币元

	2005 年上半年
新股手续费返还	14,072.52
债券认购手续费返还	40,000.00
其他	0.00
合计	54,072.52

(8)其他费用明细:

人民币元

	2005 年上半年
上市年费	29,752.78
信息披露费	148,767.52
审计费用	49,588.57
帐户维护费	9,360.00
转托管费	10,000.00
回购交易费	2,108.85
划款手续费	0.00
合计	249,577.72

(9)本期没有分配基金收益

(10)其他重要报表项目的说明:无

8、本报告期末流通转让受限制的基金资产

截至 2005 年 6 月 30 日,基金获配暂不能流通的股票成本为 5,854,822.64 元,股票市值为 8,124,157.68 元,对比成本估值增值为 2,269,335.04 元,普丰证券投资基金持有未上市或上市未流通的股票明细如下:

序号	股票名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限制原因	受限制期限
1	登海种业	29,165	487,055.50	646,879.70	市均价	新股未流通	2005-7-20 流通
2	兔宝宝	60,775	302,659.50	421,170.75	市均价	新股未流通	2005-8-10 流通
3	江苏三友	110,159	391,064.45	576,131.57	市均价	新股未流通	2005-8-18 流通
4	广州国光	63,467	685,443.60	738,121.21	市均价	新股未流通	2005-8-23 流通
5	轴研科技	31,879	203,706.81	384,141.95	市均价	新股未流通	2005-8-26 流通
6	成霖股份	104,300	896,980.00	961,646.00	市均价	新股未流通	2005-8-31 流通
7	宁波华翔	114,686	659,444.50	964,509.26	市均价	新股未流通	2005-9-3 流通
8	晶源电子	92,558	442,427.24	978,338.06	市均价	新股未流通	2005-9-6 流通
9	包头铝业	369,125	1,291,937.50	1,402,675.00	市均价	新股未流通	2005-8-9 流通
10	中材国际	65,618	494,103.54	1,050,544.18	市均价	新股未流通	2005-7-12 流通

9、需要说明的其他事项：无

六、基金投资组合报告

(一)本报告期末基金资产组合情况

序号	资产品种	金额(元)	金额占基金总资产比例(%)
1	股票	1,803,838,086.01	68.97
2	债券	661,146,918.57	25.28
3	银行存款	120,086,876.16	4.59
4	其他资产	30,472,226.86	1.16
	合计	2,615,544,107.60	100.00

(二)本报告期末按行业分类的股票投资组合

1、积极股票投资组合

序号	行业	期末市值 (元)	市值占净值比例 (%)
1	A 农、林、牧、渔业	646,879.70	0.02
2	B 采掘业	192,376,923.33	7.38
3	C 制造业	209,142,805.52	8.02
其中:	C0 食品、饮料	14,707,480.32	0.56
	C1 纺织、服装、皮毛	576,131.57	0.02
	C2 木材、家具	421,170.75	0.02
	C3 造纸、印刷	34,896,488.60	1.34
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
	C5 电子	1,717,516.27	0.06
	C6 金属、非金属	98,734,325.17	3.79
	C7 机械、设备、仪表	58,089,692.84	2.23
	C8 医药、生物制品	0.00	0.00
	C99 其他制造业	0.00	0.00
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	169,686,426.11	6.51
5	E 建筑业	1,050,544.18	0.04
6	F 交通运输、仓储业	104,939,356.86	4.02
7	G 信息技术业	26,708,280.72	1.02
8	H 批发和零售贸易	44,518,521.78	1.71
9	I 金融、保险业	255,298,817.40	9.79
10	J 房地产业	0.00	0.00
11	K 社会服务业	12,012,204.26	0.46
12	L 传播与文化产业	0.00	0.00
13	M 综合类	0.00	0.00
	合计	1,016,380,759.86	38.97

2、指数股票投资组合

序号	行业	期末市值 (元)	市值占净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	493,639.05	0.02
2	B 采掘业	29,256,665.86	1.12
3	C 制造业	362,847,341.46	13.91
其中	C0 食品、饮料	102,954,765.90	3.95
	C1 纺织、服装、皮毛	11,939,821.65	0.46
	C2 木材、家具	0.00	0.00
	C3 造纸、印刷	2,091,878.46	0.08
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	17,622,604.36	0.68
	C5 电子	4,184,985.80	0.16
	C6 金属、非金属	138,568,609.32	5.31
	C7 机械、设备、仪表	52,729,586.14	2.02
	C8 医药、生物制品	32,742,847.71	1.25
	C99 其他制造业	12,242.12	0.00
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	4,312,690.89	0.17
5	E 建筑业	1,682,691.12	0.06
6	F 交通运输、仓储业	170,157,325.61	6.53
7	G 信息技术业	88,198,292.95	3.38
8	H 批发和零售贸易	51,899,910.46	1.99
9	I 金融、保险业	10,918,570.72	0.42
10	J 房地产业	3,957,885.95	0.15
11	K 社会服务业	61,153,788.02	2.35
12	L 传播与文化产业	2,081,586.13	0.08
13	M 综合类	496,937.93	0.02
	合计	787,457,326.15	30.20

(三)本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

1、积极股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	600036	招商银行	33,300,000	200,133,000.00	7.67
2	600900	长江电力	18,883,381	154,654,890.39	5.93
3	600583	海油工程	5,538,733	129,107,866.23	4.95
4	600717	天津港	9,785,004	69,473,528.40	2.66
5	600028	中国石化	17,872,615	63,269,057.10	2.43
6	600585	海螺水泥	6,488,313	43,471,697.10	1.67
7	600019	宝钢股份	7,505,179	37,600,946.79	1.44
8	600150	沪东重机	3,332,259	31,223,266.83	1.20
9	600030	中信证券	5,282,394	31,166,124.60	1.20
10	600050	中国联通	10,116,773	26,708,280.72	1.02
11	600016	民生银行	4,999,936	23,999,692.80	0.92
12	600966	博汇纸业	3,006,802	23,453,055.60	0.90
13	600694	大商股份	1,826,632	22,741,568.40	0.87
14	600500	中化国际	3,988,453	21,776,953.38	0.84
15	600550	天威保变	2,788,998	21,670,514.46	0.83
16	600029	南方航空	5,702,085	16,992,213.30	0.65
17	600026	中海发展	2,479,817	16,937,150.11	0.65
18	600323	南海发展	1,932,074	15,031,535.72	0.58
19	000858	五粮液	1,918,396	14,503,073.76	0.56
20	000069	华侨城A	1,336,174	12,012,204.26	0.46
21	600356	恒丰纸业	1,845,715	11,443,433.00	0.44
22	600586	金晶科技	2,020,869	10,468,101.42	0.40
23	000970	中科三环	868,202	4,714,336.86	0.18
24	600162	香江控股	1,467,707	3,845,392.34	0.15
25	600472	包头铝业	399,125	1,516,675.00	0.06
26	600018	上港集箱	65,800	1,065,960.00	0.04

27	600970	中材国际	65,618	1,050,544.18	0.04
28	002049	晶源电子	92,658	979,395.06	0.04
29	002048	宁波华翔	114,786	965,350.26	0.04
30	002047	成霖股份	104,400	962,568.00	0.04
31	002045	广州国光	63,467	738,121.21	0.03
32	002041	登海种业	29,165	646,879.70	0.02
33	002044	江苏三友	110,159	576,131.57	0.02
34	002040	南京港	48,757	470,505.05	0.02
35	002043	兔宝宝	60,775	421,170.75	0.02
36	002046	轴研科技	31,879	384,141.95	0.01
37	000729	燕京啤酒	28,272	204,406.56	0.01
38	002050	山花股份	100	1,027.00	0.00

2、指数股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	000858	五粮液	11,178,619	84,510,359.64	3.24
2	000063	中兴通讯	2,625,596	60,021,124.56	2.30
3	000069	华侨城A	6,608,661	59,411,862.39	2.28
4	000089	深圳机场	6,942,563	55,609,929.63	2.13
5	000022	深赤湾A	1,810,157	50,195,653.61	1.92
6	002024	苏宁电器	1,423,089	45,481,924.44	1.74
7	000970	中科三环	7,881,403	42,796,018.29	1.64
8	000900	现代投资	3,533,839	38,094,784.42	1.46
9	000898	鞍钢新轧	9,224,290	34,775,573.30	1.33
10	000039	中集集团	3,626,071	34,774,020.89	1.33
11	000541	佛山照明	3,063,319	32,991,945.63	1.27
12	000983	西山煤电	4,079,400	28,311,036.00	1.09
13	000997	新大陆	3,430,552	28,096,220.88	1.08
14	000088	盐田港A	2,431,895	23,881,208.90	0.92
15	000630	铜都铜业	3,728,902	16,593,613.90	0.64

16	000423	东阿阿胶	2,285,807	14,949,177.78	0.57
17	000729	燕京啤酒	1,872,054	13,534,950.42	0.52
18	000726	鲁 泰 A	1,516,761	11,861,071.02	0.45
19	000001	深发展 A	1,809,280	10,909,958.40	0.42
20	000625	长安汽车	2,001,629	10,848,829.18	0.42
21	000926	福星科技	1,334,723	9,449,838.84	0.36
22	000513	丽珠集团	1,822,372	9,385,215.80	0.36
23	000759	武汉中百	1,283,631	6,302,628.21	0.24
24	000866	扬子石化	603,081	5,837,824.08	0.22
25	000538	云南白药	247,978	4,384,251.04	0.17
26	000037	深南电 A	561,322	4,170,622.46	0.16
27	000100	TCL 集团	1,900,000	4,104,000.00	0.16
28	002001	新 和 成	317,583	3,795,116.85	0.15
29	00157	中联重科	600,078	3,708,482.04	0.14
30	000422	湖北宜化	563,200	3,086,336.00	0.12
31	002038	双鹭药业	302,774	2,685,605.38	0.10
32	000659	珠海中富	762,159	2,477,016.75	0.09
33	000806	银河科技	660,247	2,396,696.61	0.09
34	000099	中信海直	645,486	2,317,294.74	0.09
35	000002	万 科 A	717,604	2,274,804.68	0.09
36	000917	电广传媒	289,802	2,074,982.32	0.08
37	002028	思源电气	200,200	1,907,906.00	0.07
38	000895	双汇发展	123,298	1,887,692.38	0.07
39	000888	峨眉山 A	354,591	1,680,761.34	0.06
40	000876	新 希 望	250,879	1,675,871.72	0.06
41	000758	中色股份	363,281	1,671,092.60	0.06
42	002012	凯恩股份	180,500	1,379,020.00	0.05
43	000049	深 万 山	200,000	1,346,000.00	0.05
44	000822	山东海化	304,284	1,326,678.24	0.05

45	000911	南宁糖业	231,052	940,381.64	0.04
46	000762	西藏矿业	201,182	899,283.54	0.03
47	000525	红太阳	210,000	804,300.00	0.03
48	000488	晨鸣纸业	125,806	704,513.60	0.03
49	001696	宗申动力	130,130	658,457.80	0.03
50	002007	华兰生物	58,995	523,875.60	0.02
51	000998	隆平高科	55,613	477,159.54	0.02
52	000623	吉林敖东	60,018	381,714.48	0.01
53	000869	张裕A	21,559	364,778.28	0.01
54	000626	如意集团	26,157	295,835.67	0.01
55	002004	华邦制药	38,401	264,198.88	0.01
56	000024	招商地产	34,620	242,686.20	0.01
57	000034	深信泰丰	88,024	131,155.76	0.01
58	000999	三九医药	30,529	107,767.37	0.00
59	000027	深能源A	13,450	92,267.00	0.00
60	000763	锦州石化	21,103	62,042.82	0.00
61	000796	宝商集团	14,267	46,795.76	0.00
62	000031	深宝恒A	9,241	42,878.24	0.00
63	000825	太钢不锈	9,500	36,195.00	0.00
64	000916	华北高速	9,360	33,040.80	0.00
65	000707	双环科技	8,534	26,284.72	0.00
66	000677	山东海龙	7,514	26,148.72	0.00
67	000639	金德发展	1,571	25,905.79	0.00
68	000155	川化股份	6,496	25,789.12	0.00
69	000617	石油济柴	1,320	19,826.40	0.00
70	000158	常山股份	6,371	17,775.09	0.00
71	000783	石炼化	7,472	15,915.36	0.00
72	000733	振华科技	3,673	14,875.65	0.00
73	000985	大庆华科	2,089	14,560.33	0.00

74	000933	神火股份	1,151	13,996.16	0.00
75	000956	中原油气	2,000	13,060.00	0.00
76	000817	辽河油田	2,101	12,984.18	0.00
77	000068	赛格三星	2,300	12,604.00	0.00
78	000043	深南光A	2,171	12,374.70	0.00
79	000402	金融街	1,500	12,210.00	0.00
80	002032	苏泊尔	1,040	11,939.20	0.00
81	000559	万向钱潮	3,818	11,683.08	0.00
82	000550	江铃汽车	2,407	11,120.34	0.00
83	000839	中信国安	1,195	10,946.20	0.00
84	000050	深天马A	1,680	10,819.20	0.00
85	000662	索芙特	1,274	10,778.04	0.00
86	000807	云铝股份	3,331	10,625.89	0.00
87	000938	清华紫光	1,023	10,281.15	0.00
88	000978	桂林旅游	1,730	10,068.60	0.00
89	002031	巨轮股份	1,170	9,675.90	0.00
90	000520	中国凤凰	2,944	9,509.12	0.00
91	000731	四川美丰	1,216	9,424.00	0.00
92	000960	锡业股份	1,646	9,201.14	0.00
93	000596	古井贡A	2,573	9,159.88	0.00
94	000066	长城电脑	1,150	9,027.50	0.00
95	000790	华神集团	1,497	8,547.87	0.00
96	000751	锌业股份	2,730	8,517.60	0.00
97	000581	威孚高科	986	8,430.30	0.00
98	000629	新钢钒	1,642	8,407.04	0.00
99	000963	华东医药	1,825	8,395.00	0.00
100	000006	深振业A	2,117	8,362.15	0.00
101	000909	数源科技	1,742	8,204.82	0.00
102	000539	粤电力A	1,697	7,908.02	0.00
103	000990	诚志股份	1,507	7,776.12	0.00

104	000951	中国重汽	1,000	7,690.00	0.00
105	000651	格力电器	733	7,527.91	0.00
106	000828	东莞控股	1,605	7,270.65	0.00
107	000902	中国服装	2,633	7,267.08	0.00
108	000045	深纺织 A	1,529	7,247.46	0.00
109	000819	岳阳兴长	1,363	7,155.75	0.00
110	000976	春晖股份	3,415	7,137.35	0.00
111	000410	沈阳机床	1,136	7,111.36	0.00
112	000668	武汉石油	1,255	7,028.00	0.00
113	000046	光彩建设	1,913	6,829.41	0.00
114	000831	关铝股份	2,410	6,796.20	0.00
115	002027	七喜股份	1,000	6,790.00	0.00
116	000958	东方热电	2,167	6,739.37	0.00
117	000516	陕解放 A	1,315	6,588.15	0.00
118	000608	阳光股份	1,278	6,568.92	0.00
119	000502	恒大地产	1,721	6,419.33	0.00
120	002021	中捷股份	800	6,408.00	0.00
121	000016	深康佳 A	1,522	6,224.98	0.00
122	000778	新兴铸管	942	6,170.10	0.00
123	000955	欣龙无纺	2,257	6,139.04	0.00
124	000078	海王生物	1,567	6,111.30	0.00
125	000890	法尔胜	1,999	6,056.97	0.00
126	000761	本钢板材	1,405	5,929.10	0.00
127	000972	新中基	918	5,921.10	0.00
128	000028	一致药业	1,361	5,865.91	0.00
129	000848	承德露露	1,770	5,823.30	0.00
130	000400	许继电气	1,169	5,774.86	0.00
131	000901	航天科技	1,538	5,736.74	0.00
132	002029	七匹狼	780	5,717.40	0.00

133	000531	穗恒运 A	991	5,628.88	0.00
134	000036	华联控股	1,555	5,598.00	0.00
135	000962	东方钽业	1,301	5,568.28	0.00
136	000748	湘计算机	1,579	5,384.39	0.00
137	000637	茂化实华	671	5,361.29	0.00
138	000558	莱茵置业	1,587	5,332.32	0.00
139	000599	青岛双星	2,193	5,307.06	0.00
140	000070	特发信息	1,251	5,291.73	0.00
141	000543	皖能电力	1,478	5,173.00	0.00
142	000591	桐君阁	1,023	5,135.46	0.00
143	000996	捷利股份	1,026	5,068.44	0.00
144	000060	中金岭南	841	5,054.41	0.00
145	000582	北海新力	1,048	4,936.08	0.00
146	000578	数码网络	1,471	4,854.30	0.00
147	000032	深桑达 A	874	4,841.96	0.00
148	000690	宝丽华	1,133	4,792.59	0.00
149	000527	美的电器	618	4,690.62	0.00
150	000793	燃气股份	1,480	4,632.40	0.00
151	000061	农产品	1,356	4,583.28	0.00
152	000797	中国武夷	1,637	4,567.23	0.00
153	000096	广聚能源	1,251	4,566.15	0.00
154	000878	云南铜业	1,221	4,517.70	0.00
155	000987	广州友谊	805	4,508.00	0.00
156	000680	山推股份	1,969	4,489.32	0.00
157	000936	华西村	1,268	4,438.00	0.00
158	000563	陕国投 A	1,026	4,432.32	0.00
159	000852	江钻股份	894	4,407.42	0.00
160	000404	华意压缩	1,862	4,394.32	0.00
161	000919	金陵药业	773	4,390.64	0.00

162	002026	山东威达	600	4,380.00	0.00
163	002025	航天电器	240	4,329.60	0.00
164	000055	方大A	783	4,322.16	0.00
165	000058	深赛格	1,223	4,317.19	0.00
166	002037	久联发展	700	4,291.00	0.00
167	000693	聚友网络	845	4,284.15	0.00
168	002008	大族激光	450	4,270.50	0.00
169	000715	中兴商业	812	4,189.92	0.00
170	000562	宏源证券	950	4,180.00	0.00
171	002030	达安基因	400	4,180.00	0.00
172	000408	河北华玉	1,297	4,176.34	0.00
173	000669	领先科技	840	4,124.40	0.00
174	000973	佛塑股份	1,231	4,123.85	0.00
175	000889	渤海物流	1,548	4,055.76	0.00
176	000727	华东科技	1,378	4,037.54	0.00
177	000786	北新建材	1,260	4,019.40	0.00
178	000965	天水股份	1,620	4,001.40	0.00
179	000615	湖北金环	1,226	3,996.76	0.00
180	002014	永新股份	500	3,995.00	0.00
181	000971	湖北迈亚	1,452	3,993.00	0.00
182	000792	盐湖钾肥	387	3,924.18	0.00
183	000012	南玻A	1,050	3,906.00	0.00
184	000021	深科技A	521	3,897.08	0.00
185	000838	蓝星石化	600	3,870.00	0.00
186	000723	天宇电气	873	3,867.39	0.00
187	000903	云内动力	883	3,849.88	0.00
188	002010	传化股份	300	3,843.00	0.00
189	000618	吉林化工	1,132	3,826.16	0.00
190	000728	北京化二	1,340	3,819.00	0.00

191	002033	丽江旅游	400	3,808.00	0.00
192	000927	一汽夏利	1,360	3,794.40	0.00
193	000062	深圳华强	848	3,782.08	0.00
194	000757	方向光电	1,767	3,746.04	0.00
195	000930	丰原生化	805	3,743.25	0.00
196	000605	四环药业	722	3,732.74	0.00
197	000009	深宝安 A	1,469	3,731.26	0.00
198	000151	中成股份	1,179	3,666.69	0.00
199	000526	好时光	830	3,660.30	0.00
200	002035	华帝股份	700	3,591.00	0.00
201	000948	南天信息	787	3,572.98	0.00
202	002020	京新药业	400	3,516.00	0.00
203	000549	湘火炬 A	1,000	3,460.00	0.00
204	002011	盾安环境	500	3,460.00	0.00
205	000419	通程控股	902	3,436.62	0.00
206	002017	东信和平	300	3,426.00	0.00
207	000975	科学城	1,272	3,421.68	0.00
208	000756	新华制药	1,128	3,417.84	0.00
209	000716	广西斯壮	1,429	3,415.31	0.00
210	000406	石油大明	674	3,363.26	0.00
211	000785	武汉中商	1,071	3,298.68	0.00
212	000818	锦化氯碱	1,091	3,283.91	0.00
213	002023	海特高新	300	3,270.00	0.00
214	000503	海虹控股	334	3,266.52	0.00
215	000897	津滨发展	1,307	3,254.43	0.00
216	000966	长源电力	1,093	3,246.21	0.00
217	000589	黔轮胎 A	886	3,242.76	0.00
218	000993	闽东电力	1,049	3,241.41	0.00
219	000837	秦川发展	991	3,200.93	0.00

220	000863	和光商务	1,815	3,176.25	0.00
221	000701	厦门信达	534	3,171.96	0.00
222	000925	浙大海纳	508	3,169.92	0.00
223	000912	泸天化	520	3,161.60	0.00
224	000719	焦作鑫安	1,202	3,161.26	0.00
225	000988	华工科技	509	3,155.80	0.00
226	000426	大地基础	792	3,152.16	0.00
227	000153	丰原药业	1,104	3,113.28	0.00
228	000010	深华新	994	3,111.22	0.00
229	000830	鲁西化工	787	3,085.04	0.00
230	002006	精工科技	400	3,084.00	0.00
231	000969	安泰科技	547	3,063.20	0.00
232	000835	隆源双登	507	3,031.86	0.00
233	000768	西飞国际	1,000	2,980.00	0.00
234	000892	长丰通信	1,006	2,967.70	0.00
235	000018	深中冠A	600	2,964.00	0.00
236	002036	宜科科技	500	2,955.00	0.00
237	000671	阳光发展	518	2,937.06	0.00
238	002034	美欣达	360	2,926.80	0.00
239	000780	草原兴发	800	2,896.00	0.00
240	000415	汇通水利	812	2,874.48	0.00
241	000920	南方汇通	771	2,844.99	0.00
242	000428	华天酒店	698	2,840.86	0.00
243	000700	模塑科技	946	2,838.00	0.00
244	000787	创智科技	556	2,835.60	0.00
245	000782	美达股份	1,071	2,827.44	0.00
246	000636	风华高科	800	2,800.00	0.00
247	000679	大连友谊	810	2,794.50	0.00
248	000524	东方宾馆	1,032	2,786.40	0.00

249	000702	正虹科技	964	2,785.96	0.00
250	000932	华菱管线	708	2,782.44	0.00
251	000612	焦作万方	1,155	2,772.00	0.00
252	002015	霞客环保	300	2,700.00	0.00
253	002022	科华生物	240	2,697.60	0.00
254	000533	万家乐 A	1,000	2,610.00	0.00
255	000823	超声电子	696	2,610.00	0.00
256	000913	钱江摩托	898	2,595.22	0.00
257	000597	东北药	865	2,586.35	0.00
258	002003	伟星股份	300	2,583.00	0.00
259	000893	广州冷机	956	2,581.20	0.00
260	000737	南风化工	999	2,567.43	0.00
261	000959	首钢股份	753	2,552.67	0.00
262	000752	西藏发展	618	2,465.82	0.00
263	000033	新都酒店	833	2,440.69	0.00
264	002018	华星化工	300	2,406.00	0.00
265	000600	建投能源	635	2,381.25	0.00
266	000413	宝 石 A	684	2,380.32	0.00
267	001896	豫能控股	1,009	2,371.15	0.00
268	000007	深达声 A	639	2,338.74	0.00
269	000989	九 芝 堂	464	2,333.92	0.00
270	002009	天奇股份	300	2,331.00	0.00
271	000504	赛迪传媒	526	2,319.66	0.00
272	000667	名流置业	538	2,308.02	0.00
273	000800	一汽轿车	846	2,301.12	0.00
274	000815	美利纸业	515	2,291.75	0.00
275	000551	创元科技	590	2,271.50	0.00
276	002005	德豪润达	300	2,238.00	0.00
277	000789	江西水泥	771	2,181.93	0.00

278	000767	漳泽电力	487	2,181.76	0.00
279	000820	金城股份	934	2,157.54	0.00
280	000601	韶能股份	504	2,152.08	0.00
281	000777	中核科技	454	2,133.80	0.00
282	000968	煤气化	400	2,104.00	0.00
283	000501	鄂武商 A	719	2,099.48	0.00
284	002016	威尔科技	300	2,073.00	0.00
285	000739	普洛药业	570	2,046.30	0.00
286	000688	朝华集团	813	2,040.63	0.00
287	000019	深深宝 A	464	2,036.96	0.00
288	000798	中水渔业	613	2,029.03	0.00
289	000065	北方国际	445	2,024.75	0.00
290	000528	桂柳工 A	532	2,016.28	0.00
291	000725	京东方 A	510	2,004.30	0.00
292	002019	鑫富股份	130	1,996.80	0.00
293	000929	兰州黄河	680	1,985.60	0.00
294	000967	上风高科	541	1,974.65	0.00
295	000811	烟台冰轮	457	1,965.10	0.00
296	000910	大亚科技	427	1,951.39	0.00
297	000029	深深房 A	491	1,929.63	0.00
298	002013	中航精机	300	1,917.00	0.00
299	000038	深大通 A	312	1,906.32	0.00
300	000981	兰光科技	447	1,881.87	0.00
301	000886	海南高速	844	1,873.68	0.00
302	000593	宝光药业	670	1,849.20	0.00
303	000571	新大洲 A	1,000	1,830.00	0.00
304	000515	攀渝钛业	529	1,819.76	0.00
305	000429	粤高速 A	361	1,805.00	0.00
306	000875	吉电股份	573	1,804.95	0.00

307	000522	白云山 A	418	1,776.50	0.00
308	000860	顺鑫农业	470	1,748.40	0.00
309	000090	深天健	418	1,743.06	0.00
310	000042	深长城 A	330	1,742.40	0.00
311	000717	韶钢松山	300	1,740.00	0.00
312	000821	京山轻机	604	1,715.36	0.00
313	000663	永安林业	583	1,655.72	0.00
314	000548	湖南投资	602	1,649.48	0.00
315	000573	粤宏远 A	700	1,638.00	0.00
316	000750	桂林集琦	696	1,600.80	0.00
317	000856	唐山陶瓷	921	1,593.33	0.00
318	000982	圣雪绒	577	1,592.52	0.00
319	000887	飞彩股份	1,326	1,591.20	0.00
320	000712	锦龙股份	427	1,584.17	0.00
321	000607	华立控股	500	1,570.00	0.00
322	000657	中钨高新	421	1,566.12	0.00
323	000877	天山股份	565	1,559.40	0.00
324	000882	华联股份	459	1,496.34	0.00
325	000939	凯迪电力	243	1,475.01	0.00
326	000829	赣南果业	357	1,474.41	0.00
327	000735	罗牛山	675	1,471.50	0.00
328	000507	粤富华	408	1,452.48	0.00
329	000661	长春高新	388	1,427.84	0.00
330	000918	亚华种业	639	1,393.02	0.00
331	000417	合肥百货	383	1,390.29	0.00
332	000753	漳州发展	528	1,388.64	0.00
333	000833	贵糖股份	463	1,379.74	0.00
334	000883	三环股份	520	1,357.20	0.00
335	000407	胜利股份	587	1,355.97	0.00

336	000059	辽通化工	300	1,329.00	0.00
337	000521	美菱电器	589	1,325.25	0.00
338	000532	力合股份	359	1,324.71	0.00
339	000928	吉林炭素	483	1,299.27	0.00
340	000961	大连金牛	447	1,291.83	0.00
341	000673	大同水泥	416	1,281.28	0.00
342	000655	华光陶瓷	656	1,272.64	0.00
343	000159	国际实业	285	1,248.30	0.00
344	000868	安凯客车	462	1,215.06	0.00
345	000026	飞亚达A	306	1,211.76	0.00
346	000609	燕化高新	211	1,202.70	0.00
347	000949	新乡化纤	471	1,158.66	0.00
348	000711	天伦置业	358	1,156.34	0.00
349	000568	泸州老窖	307	1,108.27	0.00
350	000598	蓝星清洗	288	1,071.36	0.00
351	000697	咸阳偏转	303	1,057.47	0.00
352	000602	金马集团	168	1,002.96	0.00
353	000952	广济药业	298	998.3	0.00
354	000703	世纪光华	344	973.52	0.00
355	000908	天一科技	550	968	0.00
356	000510	金路集团	384	952.32	0.00
357	000672	铜城集团	483	951.51	0.00
358	000420	吉林化纤	339	949.2	0.00
359	000619	海螺型材	159	893.58	0.00
360	000708	大冶特钢	289	867	0.00
361	000859	国风塑业	387	832.05	0.00
362	000881	大连国际	254	782.32	0.00
363	000979	科苑集团	242	752.62	0.00
364	000921	科龙电器	333	752.58	0.00
365	000156	*ST 嘉瑞	493	744.43	0.00

366	000755	山西三维	130	742.3	0.00
367	002002	江苏琼花	100	728	0.00
368	000628	倍特高新	224	712.32	0.00
369	000403	三九生化	221	711.62	0.00
370	000635	英力特	120	703.2	0.00
371	000416	健特生物	100	693	0.00
372	000683	天然碱	256	675.84	0.00
373	000519	银河动力	100	655	0.00
374	000506	东泰控股	390	639.6	0.00
375	000721	西安饮食	184	596.16	0.00
376	000650	*ST 九化	456	592.8	0.00
377	000713	丰乐种业	179	585.33	0.00
378	000779	三毛派神	267	582.06	0.00
379	000616	亿城股份	175	575.75	0.00
380	000810	华润锦华	182	573.3	0.00
381	000953	河池化工	211	571.81	0.00
382	000937	金牛能源	97	558.72	0.00
383	000732	福建三农	271	550.13	0.00
384	000534	汕电力 A	185	508.75	0.00
385	000547	闽福发 A	100	508	0.00
386	000915	山大华特	172	502.24	0.00
387	000813	天山纺织	294	499.8	0.00
388	000905	厦门港务	67	495.13	0.00
389	000977	浪潮信息	74	463.98	0.00
390	000514	渝开发	120	459.6	0.00
391	000622	岳阳恒立	395	454.25	0.00
392	000004	北大高科	100	453	0.00
393	000631	兰宝信息	371	441.49	0.00
394	000686	锦州六陆	119	431.97	0.00

395	000923	河北宣工	174	429.78	0.00
396	000517	甬 成 功	92	421.36	0.00
397	000570	苏常柴 A	100	421	0.00
398	000709	唐钢股份	111	415.14	0.00
399	000812	陕西金叶	100	411	0.00
400	000586	汇源通信	100	401	0.00
401	000935	四川双马	164	398.52	0.00
402	000023	深天地 A	100	389	0.00
403	000584	舒卡股份	100	381	0.00
404	000511	银基发展	100	375	0.00
405	000861	海印股份	102	367.2	0.00
406	000595	西北轴承	143	366.08	0.00
407	000576	广东甘化	159	356.16	0.00
408	000530	大冷股份	100	356	0.00
409	000014	沙河股份	64	344.96	0.00
410	000611	时代科技	100	335	0.00
411	000826	国投资源	100	331	0.00
412	000606	青海明胶	100	329	0.0
413	000418	小天鹅 A	100	328	0.00
414	000698	沈阳化工	101	324.21	0.00
415	000666	经纬纺机	100	317	0.00
416	000803	金宇车城	27	316.44	0.00
417	000862	吴忠仪表	194	308.46	0.00
418	000906	南方建材	111	305.25	0.00
419	000665	武汉塑料	100	305	0.00
420	000564	西安民生	100	301	0.00
421	000722	金果实业	100	301	0.00
422	000545	吉林制药	100	296	0.00
423	000899	赣能股份	100	289	0.00

424	000554	泰山石油	100	287	0.00
425	000035	中科健 A	100	286	0.00
426	000685	公用科技	100	280	0.00
427	000594	内蒙宏峰	100	280	0.00
428	000791	西北化工	209	275.88	0.00
429	000523	广州浪奇	100	269	0.00
430	000880	山东巨力	138	266.34	0.00
431	000553	沙隆达 A	100	261	0.00
432	000795	太原刚玉	82	257.48	0.00
433	000421	南京中北	82	256.66	0.00
434	000425	徐工科技	100	255	0.00
435	000705	浙江震元	72	251.28	0.00
436	000632	三木集团	100	248	0.00
437	000544	白鸽股份	100	245	0.00
438	000498	丹东化纤	100	244	0.00
439	000670	天发石油	100	243	0.00
440	000652	泰达股份	97	241.53	0.00
441	000681	远东股份	94	236.88	0.00
442	000687	保定天鹅	100	235	0.00
443	000301	丝绸股份	100	234	0.00
444	000836	天大天财	58	230.26	0.00
445	000957	中通客车	100	226	0.00
446	000627	百科药业	100	223	0.00
447	000682	东方电子	100	220	0.00
448	000850	华茂股份	100	209	0.00
449	000540	世纪中天	100	204	0.00
450	000509	同人华塑	100	201	0.00
451	000590	紫光古汉	61	198.25	0.00
452	000569	长城股份	100	192	0.00

453	000922	阿继电器	82	191.88	0.00
454	000565	渝三峡A	70	180.6	0.00
455	000633	合金投资	100	175	0.00
456	000518	四环生物	100	163	0.00
457	000738	南方摩托	100	162	0.00
458	000766	ST通金马	99	155.43	0.00
459	000401	冀东水泥	64	145.28	0.00
460	000610	西安旅游	33	119.46	0.00
461	000720	鲁能泰山	57	113.43	0.00
462	000692	惠天热电	41	110.29	0.00
463	000430	张家界	27	69.39	0.00
464	000056	深国商	10	34.5	0.00
465	000760	博盈投资	8	19.44	0.00

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

- 1、累计买入价值超出期初基金资产净值 2% 或者前 20 名的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	累计买入金额(元)	占期初净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	127,745,026.30	4.80
2	000039	中集集团	96,142,245.08	3.61
3	600028	中国石化	83,058,232.10	3.12
4	000063	中兴通讯	82,449,681.83	3.10
5	600900	长江电力	61,358,678.71	2.31
6	600026	中海发展	59,316,328.72	2.23
7	600005	武钢股份	56,850,412.93	2.14
8	600717	天津港	56,727,699.39	2.13
9	000022	深赤湾A	53,121,143.44	2.00
10	000898	鞍钢新轧	47,340,823.90	1.78
11	600694	大商股份	45,884,554.79	1.73
12	600009	上海机场	44,506,213.25	1.67
13	600585	海螺水泥	43,222,248.40	1.63
14	000983	西山煤电	42,341,411.06	1.59
15	600030	中信证券	42,242,705.20	1.59
16	000858	五粮液	37,811,691.91	1.42
17	000541	佛山照明	37,142,717.27	1.40
18	000900	现代投资	32,508,054.25	1.22
19	000089	深圳机场	31,966,688.76	1.20
20	600150	沪东重机	29,072,315.23	1.09

2、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或者前 20 名的股票明细如下：

序号	股票代码	股票名称	累计卖出金额(元)	占期初净值比例(%)
1	600005	武钢股份	113,901,696.00	4.28
2	600019	宝钢股份	85,086,645.20	3.20
3	600660	福耀玻璃	73,532,900.91	2.76
4	000039	中集集团	66,933,665.35	2.52
5	000488	晨鸣纸业	66,195,779.39	2.49
6	600031	三一重工	55,541,417.37	2.09
7	600050	中国联通	53,403,988.47	2.01
8	000983	西山煤电	51,482,582.97	1.94
9	600029	南方航空	51,034,490.66	1.92
10	600009	上海机场	45,462,782.58	1.71
11	600018	上港集箱	39,026,294.42	1.47
12	600694	大商股份	37,685,276.11	1.42
13	000625	长安汽车	37,470,189.77	1.41
14	000630	铜都铜业	36,863,618.85	1.39
15	600550	天威保变	33,222,416.09	1.25
16	000001	深发展 A	31,756,779.00	1.19
17	000758	中色股份	31,118,552.56	1.17
18	000069	华侨城 A	30,041,402.55	1.13
19	600026	中海发展	28,713,870.65	1.08
20	000002	万 科 A	28,331,945.63	1.07

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额：

人民币元

	2005 年上半年
买入股票的成本总额	1,727,307,336.97
卖出股票的收入总额	1,740,634,244.39

(五)本报告期末按券种分类的债券投资组合

序 号	债券品种	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	国债	492,444,482.97	18.88
2	金融债	62,412,000.00	2.39
3	企业债	0.00	0.00
4	可转换债券	106,290,435.60	4.08
	合计	661,146,918.57	25.35

(六)本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	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	00 国债 12	134,212,000.00	5.15
2	04 国债	110,133,673.67	4.22
3	招行转债	106,290,435.60	4.08
4	05 国债 02	78,346,480.00	3.00
5	04 国债	55,940,500.00	2.15

(七)投资组合报告附注

- 1、报告期内本基金投资的前十名证券中没有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公开谴责、处罚的股票。
- 2、报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
- 3、其他资产构成

其他资产明细	金额(元)
应收交易保证金	1,250,000.00
应收证券清算款	17,772,471.61
应收股利合计	332,203.13
应收利息合计	11,117,552.12
合计	30,472,226.86

4、本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	期末市值(元)	市值占净值比例(%)
1	100036	招行转债	106,290,435.60	4.08
	合计		106,290,435.60	4.08

七、基金份额持有人结构

(一)本报告期末基金份额持有人信息

基金份额持有人户数(户)	平均每户持有基金份额(份)	机构投资者持有基金份额(份)	占总份额比例(%)	个人投资者持有基金份额(份)	占总份额比例(%)
106,045	28,289.88	1,340,721,986	44.69	1,659,278,014	55.31

(二)本报告期末基金前十名份额持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占总份额的比例(%)
1	中国人寿保险股份有限公司	247,740,920	8.26
2	中国人民财产保险股份有限公司	228,344,106	7.61
3	中国人寿保险(集团)公司	184,486,886	6.15
4	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	171,723,230	5.72
5	中国平安保险(集团)股份有限公司	132,604,377	4.42
6	银河-汇丰-GOLDMAN,SACHS & CO	45,868,597	1.53
7	中国再保险(集团)公司	34,042,814	1.13
8	中油财务有限责任公司	30,823,573	1.03
9	塔里木石油勘探开发指挥部	27,696,388	0.92
10	内蒙古自治区信托投资公司	20,665,496	0.69

八、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) 本基金管理人(以下简称“本公司”)、托管人的重大人事变动:

1、因股东单位委派的董事发生变化,根据方正证券有限责任公司推荐,经本公司2004年第三次临时股东会会议审议通过,陈锐女士担任本公司第二届董事会董事,李华强先生因工作变动不再担任本公司董事。上述事项已经中国证监会核准,并于2005年2月26日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

2、经本公司第二届董事会第十六次会议审议通过,同意曹志广先生辞去公司督察长职务;经本公司第二届董事会第十七次会议审议通过,同意吴伟先生担任公司督察长职务。吴伟先生的任职资格已经中国证监会证监基金字[2005]99号文核准并于2005年6月16日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告。

(三) 本报告期内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) 本报告期内本基金投资策略未改变。

(五) 本基金本报告期内未进行收益分配。

(六) 本报告期内未改聘为本基金审计的会计师事务所。

(七) 本基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员在报告期内未受到任何处罚。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况：

1、本基金管理人在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，分别向国信证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、招商证券有限责任公司、国元证券有限责任公司、安信信托投资股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中银国际证券股份有限公司、汉唐证券有限公司、财通证券有限公司、长城证券有限公司、中信证券有限公司租用席位作为基金专用交易席位。2005年新增加了东海证券有限责任公司和中国银河证券有限责任公司席位作为基金专用席位。

2、普丰证券投资基金2005年1-6月通过各证券经营机构的席位买卖证券的交易量及支付的佣金如下：

(1) 2005年1-6月股票、债券及债券回购交易量情况如下：

券商名称	席位数量	股票成交量 (元)	比例 (%)	债券成交量 (元)	比例 (%)	债券回购交易 量(元)	比例 (%)
国信证券	3	236,378,523.00	6.87	9,442,895.00	3.65	0.00	
华夏证券	3	406,119,438.35	11.81	5,958,628.00	2.30	60,000,000.00	14.84
平安证券	3	61,463,225.42	1.79	0.00		0.00	
申银万国	3	591,849,310.37	17.20	985,671.00	0.38	0.00	
招商证券	1	536,706,080.83	15.60	0.00		0.00	
中银国际	1	112,363,414.62	3.27	0.00		73,000,000.00	18.06
中信证券	1	141,882,783.73	4.12	0.00		0.00	
宏源证券	1	869,005,200.95	25.26	0.00		271,300,000.00	67.10
东海证券	1	84,912,892.31	2.47	67,974,816.40	26.26	0.00	
银河证券	1	399,291,141.53	11.61	174,500,848.80	67.41	0.00	
合计		3,439,972,011.11	100	258,862,859.20	100.00	404,300,000.00	100

(2) 2005年1-6月佣金情况：

券商名称	累计佣金 (元)	各券商累计佣金比 例(%)
国信证券	187,665.27	6.81
华夏证券	322,043.17	11.70
平安证券	48,095.62	1.75
申银万国	467,132.57	16.97
招商证券	419,977.89	15.26
中银国际	91,407.95	3.32
中信证券	111,024.38	4.03

宏源证券	709,863.36	25.79
东海证券	68,982.91	2.50
银河证券	326,427.56	11.86
合计	2,752,620.66	100.00

(九) 本报告期内其他重大事项：

本基金参加了宝山钢铁股份有限公司增发A股和深圳成霖洁具股份有限公司首次公开发行A股的配售。此次发行的分销商之一方正证券有限责任公司是本公司的非控股股东。本基金管理人分别于2005年4月27日和5月20日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》公告了本基金参与配售的情况。

九、备查文件目录

- (一) 中国证监会批准普丰证券投资基金设立的文件
- (二) 《普丰证券投资基金基金合同》
- (三) 《普丰证券投资基金托管协议》
- (四) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (五) 财务报表及附注
- (六) 报告期内普丰证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿
- (七) 存放地点：深圳市深南东路发展银行大厦 18 层、27 层鹏华基金管理有限公司
- (八) 查阅方式：投资者可在基金管理人营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站（<http://www.phfund.com.cn>）查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人鹏华基金管理有限公司，本公司已开通客户服务系统，咨询电话：(0755) 82353668。

本基金管理人：鹏华基金管理有限公司

2005 年 8 月 27 日