

## 鸿飞证券投资基金 2005 年第一季度报告

### 一、重要提示

本公司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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2005 年 4 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。

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。

本报告财务资料未经审计。

### 二、基金产品概况

基金简称:基金鸿飞

基金运作方式:契约型封闭式、积极成长型基金。

基金合同生效日:2001 年 5 月 18 日

报告期末基金份额总额:5 亿份

投资目标:在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的稳定增长,为基金持有人谋求长期最佳收益。

投资策略:稳健规范,价值投资,发现并选择高成长的上市公司进行投资,通过公司业绩的高速增长实现投资收益,在对所投资公司合理定价的基础上,以积极策略决定买入和卖出时机。本基金选择的成长型企业主要有以下几类:属于朝阳行业的企业、国际竞争中具备比较优势的企业、国家产业政策重点扶持的企业、实现产业转型的企业、具备行业垄断或优势的龙头企业等;公司处于市场导入后期或高速增长期,主营业务前景较好,在可以预见的将来可以保持较高的增长速度,股本扩张能力较强;公司的经营发展将发生积极变化,而市场价格并未完全反映这种变化等。

风险收益特征:风险水平和期望收益相对较高。

基金管理人:宝盈基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

### 三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要会计数据和财务指标(截止 2005 年 3 月 31 日) 单位:人民币元

	主要会计数据和财务指标	2005年3月31日
1	基金本期净收益	-26,989,404.60
2	基金份额本期净收益	-0.0540
3	期末基金资产净值	466,773,455.80
4	期末基金份额净值	0.9335

(二) 同期业绩比较(截止 2005 年 3 月 31 日)

阶段	净值增长率	净值增长标准差	业绩比较基 准收益率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
过去 3 个月	-5.67%	2.18%	-	-	-	-

(三) 基金净值表现(截止 2005 年 3 月 31 日)



#### 四、管理人报告

##### 1、基金经理简介

陈茂仁先生，男，37岁，医学博士，金融学博士生，5年基金从业经历，先后任职于平安证券综合研究所、宝盈基金管理公司，现任基金鸿飞基金经理。

##### 2、报告期内基金运作的遵规守信情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

### 3、报告期内基金投资业绩的说明

借披露季报的机会,在此我们向基金持有人及广大关心和爱护鸿飞基金的朋友们表示感谢,并就基金鸿飞 2005 年一季度的投资情况汇报如下:

虽然因为两会的预期,市场出现了反弹,但是由于受到重要原材料涨价、货币政策适度紧缩、新一轮宏观调控开始、以及扩容加息的因素的影响,致使 2005 年一季度市场持续走弱,并创下近 6 年来的新低。从市场格局看,股价结构进一步双向修正,防御性持股越来越明显。

投资组合相对均衡,虽重点持有盐田港、上海机场、中兴通讯等具有国际竞争力类上市公司,但总体上比例适中;加之组合中缺少中集集团、深赤湾、贵州茅台等龙头企业,致使基金鸿飞在上一阶段表现不很理想,基金鸿飞在一季度段的净值增长率仅为 - 5.67%,而同期上证指数增长率为 - 6.73%。

## 五、基金投资组合报告

### (一) 基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
银行存款和清算备付金	6,428,408.59	1.18
股票	346,306,827.31	63.64
债券	108,681,374.80	19.97
其他资产	82,757,860.66	15.21
合计	544,174,471.36	100.00

### (二) 按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	A 农、林、牧、渔业	---	--
2	B 采掘业	22,928,109.36	4.91
3	C 制造业	155,415,363.89	33.30
	其中:C0 食品、饮料	3,454,882.53	0.74
	C1 纺织、服装、皮毛	---	---
	C2 木材、家具	---	---
	C3 造纸、印刷	8,724,295.51	1.87
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	---	---
	C5 电子	20,854,692.70	4.47
	C6 金属、非金属	19,041,864.84	4.08

	C7 机械、设备、仪表	49,517,100.05	10.61
	C8 医药、生物制品	53,822,528.26	11.53
	C99 其他制造业	---	---
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	11,528,636.70	2.47
5	E 建筑业	494,103.54	0.11
6	F 交通运输、仓储业	81,355,478.96	17.43
7	G 信息技术业	44,023,251.38	9.43
8	H 批发和零售贸易	---	---
9	I 金融、保险业	21,949,989.48	4.70
10	J 房地产业	4,845,000.00	1.04
11	K 社会服务业	3,766,894.00	0.81
12	L 传播和文化产业	---	---
13	M 综合类	---	---
	合计	346,306,827.31	74.20

(三) 基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	库存数量(股)	期末市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000088	盐田港 A	2,177,398	28,915,845.44	6.19
2	000423	东阿阿胶	3,149,440	25,258,508.80	5.41
3	000951	中国重汽	2,649,472	22,944,427.52	4.92
4	000063	中兴通讯	729,876	21,560,537.04	4.62
5	600036	招商银行	1,980,000	16,909,200.00	3.62
6	600717	天津港	2,199,916	15,069,424.60	3.23
7	600205	山东铝业	1,638,089	14,972,133.46	3.21
8	600406	国电南瑞	1,131,741	14,712,633.00	3.15
9	600009	上海机场	886,793	14,561,141.06	3.12
10	600563	法拉电子	1,149,731	13,658,804.28	2.93

(四) 按券种分类的债券投资组合

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	96,143,060.00	20.60
2	金融债	11,008,000.00	2.35
3	可转债	1,530,314.80	0.33
	合计	108,681,374.80	23.28

(五) 基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	20 国债(4)	40,458,640.00	8.67
2	04 国债(5)	39,908,400.00	8.55
3	20 国债(10)	11,856,420.00	2.54
4	99 国开 02	5,997,000.00	1.28
5	04 国开 10	5,011,000.00	1.07

(六) 投资组合报告附注

1、本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查；在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中未有超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产明细

项目名称	金额(元)
应收利息	2,392,312.37
应收证券交易清算款	6,885,548.29
其他应收款	73,480,000.00
合计	82,757,860.66

4、本报告期内处于转股期的可转换债券。

代码	债券名称	期末市值(元)	占基金资产净值比例(%)
125488	晨鸣转债	1,530,314.80	0.33

六、备查文件目录

- 1、中国证监会批准鸿飞证券投资基金设立的文件。
- 2、《鸿飞证券投资基金基金合同》。
- 3、《鸿飞证券投资基金基金托管协议》。
- 4、宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

上述备查文件文本存放在基金管理人和基金托管人的办公场所,在办公时间内基金持有人可免费查阅。

基金管理人办公地址：广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 15 层

基金托管人办公地址：北京市西城区金融大街 25 号

宝盈基金管理有限公司

二零零五年四月十九日