# 友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金 2006年年度报告摘要

**基金管理人:友邦华泰基金管理有限公司　　基金托管人:中国银行股份有限公司**

**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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

报告期间:2006年1月1日至2006年12月31日

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

**一、基金简介**

(一)基金基本资料

| | |
|---|---|
| 1、基金名称: | 友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金 |
| 2、基金简称: | 友邦盛世 |
| 3、交易代码: | 460001 |
| 4、基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 5、基金合同生效日: | 2005年4月27日 |
| 6、报告期末基金份额总额: | 442,070,287.33份 |
| 7、基金合同存续期: | 无 |
| 8、基金份额上市的交易所: | 无 |
| 9、上市日期: | 无 |

(二)基金产品说明

| | |
|---|---|
| 1、投资目标: | 主要通过股票选择,辅以适度的大类资产配置调整,追求管理资产的长期稳定增值。 |
| 2、投资策略: | 本基金以股票类资产为主要投资工具,通过精选个股获取资产的长期增值;以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具,通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。 |
| 3、业绩比较基准: | 中信标普300指数×70%+中信国债指数×30% |
| 4、风险收益特征: | 较高风险、较高收益 |

(三)基金管理人

| | |
|---|---|
| 1、名称: | 友邦华泰基金管理有限公司 |
| 2、信息披露负责人: | 陈晖 |
| 3、联系电话: | 021-5047 2222 |
| 4、传真: | 021-5047 8668 |
| 5、电子邮箱: | customer@aig-huatai.com |

(四)基金托管人

| | |
|---|---|
| 1、名称: | 中国银行股份有限公司 |
| 2、信息披露负责人: | 宁敏 |
| 3、联系电话: | 010-6659 4977 |
| 4、传真: | 010-6659 4942 |
| 5、电子邮箱: | tgxxpl@bank-of-china.com |

(五)信息披露

| | |
|---|---|
| 1、信息披露报纸名称: | 《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》 |
| 2、登载年度报告正文的管理人互联网网址: | http://www.aig-huatai.com |
| 3、年度报告置备地点: | 上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼 |

**二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况**

所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,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 | | |
|---|---|---|---|
| | 项目 | 2006年 | 2005年4月27日(基金合同生效日)至2005年12月31日 |
| 1 | 基金本期净收益 | 335,510,870.60元 | 9,284,922.51元 |
| 2 | 基金份额本期净收益 | 0.6637元 | 0.0130元 |
| 3 | 期末可供分配基金份额收益 | 0.2830元 | -0.0133元 |
| 4 | 期末基金资产净值 | 689,793,982.30元 | 683,033,735.13元 |
| 5 | 期末基金份额净值 | 1.5604元 | 1.0070元 |
| 6 | 本期基金份额净值增长率 | 109.81% | 3.66% |

注:本基金合同生效日为2005年4月27日,2005年度主要财务指标的计算期间为2005年4月27日至2005年12月31日。

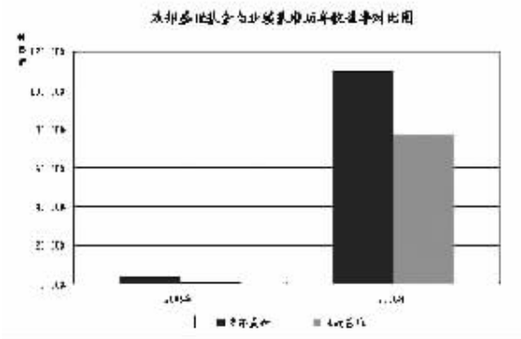
(二)基金净值表现

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列表

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 33.30% | 1.28% | 29.07% | 0.99% | 4.23% | 0.29% |
| 过去六个月 | 38.70% | 1.18% | 30.56% | 0.99% | 8.14% | 0.19% |
| 过去一年 | 109.81% | 1.22% | 77.22% | 0.98% | 32.59% | 0.24% |
| 自基金合同生效日起至今 | 117.49% | 1.05% | 77.99% | 0.96% | 39.50% | 0.09% |

2、基金合同生效以来基金份额净值变动情况,并与同期业绩比较基准的变动的比较

3、自基金合同生效以来的净值增长率,及与同期业绩比较基准的收益率比较




注:1、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,截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十三条(二)投资范围、(八)投资组合中规定的各项比例,投资于股票的比例为基金净资产的60%-90%,债券投资为基金净资产的0%-40%。

三、过往三年每年的基金收益分配情况

| 年度 | 每10份基金份额分红数(元) | 备注 |
|---|---|---|
| 2005年 | 0.300 | 8月23日实施 |
| 2006年 | 3.750 | 3月10日、6月9日和11月20日实施 |
| 合计 | 4.050 | |

**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

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准,于2004年11月18日成立的合资基金管理公司,注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为AIG Global Investment Corp.、华泰证券有限责任公司和苏州新区高新技术产业股份有限公司,出资额分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金、友邦华泰中短期债券投资基金和上证红利交易型开放式指数证券投资基金。

2、基金经理或基金经理小组成员情况

李文杰先生,工商管理学士,自1999年8月起历任美国国际集团(亚洲)投资有限公司基金管理部集中交易员、投资分析员、资深分析员,负责中国地区股票研究。2004年4月加入友邦华泰基金管理有限公司。

(二)报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书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,为基金份额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

截至本报告期末,本基金份额净值为1.5604元,累计净值为1.9654元,本报告期内基金份额净值上涨109.81%,本基金的业绩比较基准上涨77.22%。本基金在2006年实施了三次分红,基金份额持有人每份合计共获得0.375元的现金红利。

06年A股市场沪深300指数上涨118%,我们认为06年驱动股市上涨的因素主要有以下几个方面:首先是外贸顺差不断扩大导致的流动性过剩,造成M2高速增长,进而转化为M1的增长,随着其他资产包括债券、房地产等的投资回报率不断降低,更多的资金流入股市从而推动市场上涨。其次是宏观经济和公司基本面在3季度后等到明显好转使得股市的上涨有了更好的保障基础。从整体上市公司业绩变化来看,3季度上市公司净利润同比增长达到20%,远高于中报的水平,我们认为这主要是因为很多周期性行业从3季度开始好转,特别是大宗原材料行业中的钢铁、水泥等,从而在基本面上使股市上涨得到支撑。最后我们认为股改等因素的全面完成使得上市公司大股东更有动力将优质资产不断注入上市公司,从而使得资本市场的根本问题得到解决,股市整体的估值水平得到提升。

(四)对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

若人民币升值幅度加大、速度加快,我们认为对股市的影响在于:可能会提供A股估值上升的短期动力;而长期升值效应可能导致资源向非贸易部门的集中,而使利润向非贸易部门转移,最终使非贸易部门跑赢贸易部门。德、日不同的升值策略都不同程度的带来了其股票市场整体市盈率的上升。我们认为类似的情景也可能会在中国重演。以人民币计价的股票资产,在本币升值的大背景下,会得到国际投资者更多的追捧,估值会得到相应的提升。从东亚地区升值期间的行业表现来看,我们发现一个普遍的发展脉络:制造业强盛-贸易品行业竞争力凸现-收益从非贸易部门流向贸易部门-货币升值-资产价格上涨,贸易品行业竞争力下降-收益回流非贸易部门。非贸易品行业在升值期间指数收益率跑赢贸易品行业,但这种优势主要来自于其业绩的增长而非完全来自市盈率的提高。升值促使非贸易品要素价格上涨,促使非贸易部门利润上升,资产升值带来的财富效应带来人民可支配收入提高,刺激消费快速成长。

展望1季度宏观经济,我们认为经济景气继续上升。受高回报率、信贷投放、行政调控弱化影响,投资将出现反弹;受收入增加、居民财富上升影响,预计1、2月节日消费将超出预期。紧缩性政策或许在季度末出台,3、4月份是加息的敏感时间窗口。

展望1季度A股市场,受资金推动影响,春节前市场估计保持强势上涨。随后上市公司公告超出预期的06年报业绩,而在去年1季度低基数基础上将体现07年1季度业绩高增长,加上不断涌入市场的良好品种(新股IPO),这些因素都会继续刺激投资者乐观情绪。

指数有望创出新高,但市场也在不断积累信值风险,A股估值已经超越全球其他市场而显得竞争力越来越小。预计下阶段股市上涨动力主要来自于06年业绩的超预期增长、所得税率下降和20%的07年EPS预期增幅。

调整压力将主要来自于新增股票融资、"小非"减持、可能的"加息"、可能低于预期的成长股年报。看好以下几类行业投资。一、投资品。投资反弹、产能过剩逐步缓解、业绩同比高增长、税收优惠。主要包括钢铁、电解铝和机械;二、高价奢侈品。其原因在于节日消费超预期,以及合理的PEG。包括高价酒、汽车、旅游、航空机场;三、会计准则和税率优惠。相关商业地产和金融股权重估等。

(五)基金内部监察报告

2006年度,本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发,依照公司内部控制的整体要求,继续致力于内控机制的完善,加强内部风险的控制与防范,确保各项法规和管理制度的落实,保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序,通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法,独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核,发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改,同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内,基金管理人内部监察稽核主要工作如下:

(1)全面开展基金运作合规监察工作,确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有:严格执行集中交易制度,各基金相互独立,交易指令由中央交易室统一执行完成;对基金投资交易系统进行事先合规性设置并进行实时监控,杜绝出现违规行为;严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序;通过以上措施,保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程,保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求,确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作,确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对新基金募集和建仓期运作、公司营销费用处理等项目的专项监察稽核活动,并对发现问题及时发出合规提示函,要求整改,有效提高了公司各部门的合规意识。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照证监会等监管机关的相关制度、规定和业务的发展的要求,公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度,促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训等提高员工的合规意识。

通过以上工作的开展,在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形,基金运作整体合法合规。在今后的工作中,本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范各种风险,为基金持有人谋求最大利益。

**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")在对友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金(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、基金合同和托管合同的有关规定,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、基金合同和托管合同的规定,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、审计报告**

本基金2006年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师出具了无保留意见的审计报告(普华永道中天审字(2007)第20308号)。

**六、财务会计报告**

(一)基金会计报表

1、资产负债表(单位:元)

| 项目 | 附注 | 2006年12月31日 | 2005年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | 7(1) | 114,602,966.02 | 38,099,108.63 |
| 清算备付金 | | 723,552.18 | 216,158.55 |
| 交易保证金 | 7(2) | 888,549.12 | 754,288.37 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收利息 | 7(3) | 27,402.50 | 386,392.75 |
| 应收申购款 | | 135,155.35 | 319,632.50 |
| 其他应收款 | | - | - |
| 股票投资市值 | 7(4) | 593,861,881.73 | 537,536,115.68 |
| 其中:股票投资成本 | 7(5) | 432,377,150.91 | 517,504,119.90 |
| 债券投资市值 | 7(4) | - | 109,539,740.00 |
| 其中:债券投资成本 | | - | 109,539,740.00 |
| 权证投资 | 7(4) | - | - |
| 其中:权证投资成本 | | - | - |
| 买入返售证券 | | - | - |
| 待摊费用 | 7(6) | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产合计 | | 710,239,506.90 | 686,851,436.48 |
| 负债: | | | |
| 应付证券清算款 | | 16,991,692.87 | - |
| 应付赎回款 | | 861,337.25 | 1,945,609.39 |
| 应付赎回费 | | 2,469.17 | 7,332.66 |
| 应付管理人报酬 | | 849,148.44 | 859,033.41 |
| 应付托管费 | | 141,524.73 | 143,172.26 |
| 应付佣金 | 7(7) | 588,352.14 | 282,553.63 |
| 应付利息 | | | - |
| 应付收益 | | | - |
| 未交税金 | | | - |
| 其他应付款 | 7(8) | 750,000.00 | 500,000.00 |
| 卖出回购证券款 | | | - |
| 预提费用 | 7(9) | 261,000.00 | 80,000.00 |
| 其他负债 | | | - |
| 负债合计 | | 20,445,524.60 | 3,817,701.35 |
| 持有人权益: | | | |
| 实收基金 | 7(10) | 442,070,287.33 | 678,263,941.86 |
| 未实现利得 | 7(11) | 122,614,051.11 | 13,801,588.53 |
| 未分配收益 | | 125,109,643.86 | -9,031,795.26 |
| 持有人权益合计 | | 689,793,982.30 | 683,033,735.13 |
| 负债及持有人权益合计 | | 710,239,506.90 | 686,851,436.48 |

2、经营业绩表及收益分配表

经营业绩表(单位:元)

| 项目 | 附注 | 2006年 | 2005年 |
|---|---|---|---|
| 收入: | | | |
| 股票差价收入 | 7(12) | 323,239,110.01 | 4,549,514.40 |
| 债券差价收入 | 7(13) | -438,893.74 | 1,469,090.57 |
| 权证差价收入 | 7(14) | 12,723,751.95 | 892,699.46 |
| 债券利息收入 | | 490,274.23 | 1,640,493.33 |
| 存款利息收入 | | 975,577.23 | 1,117,124.85 |
| 股利收入 | | 8,625,419.73 | 6,938,511.91 |
| 买入返售证券收入 | | 3,390.68 | 891,618.00 |
| 其他收入 | 7(15) | 1,112,702.67 | 800,971.56 |
| 收入合计 | | 346,731,332.76 | 18,300,024.08 |
| 费用: | | | |
| 基金管理人报酬 | | 9,289,413.19 | 7,287,899.07 |
| 基金托管费 | | 1,548,235.47 | 1,214,649.86 |
| 卖出回购证券支出 | | - | 202,564.38 |
| 利息支出 | | - | - |
| 其他费用 | 7(16) | 382,813.50 | 309,988.26 |
| 其中:信息披露费 | | 300,000.00 | 200,000.00 |
| 审计费用 | | 61,000.00 | 80,000.00 |
| 费用合计 | | 11,220,462.16 | 9,015,101.57 |
| 基金净收益 | | 335,510,870.60 | 9,284,922.51 |
| 加:未实现估值增值变动数 | | 141,452,735.04 | 20,031,995.78 |
| 基金经营业绩 | | 476,963,605.64 | 29,316,918.29 |

收益分配表(单位:元)

| 项目 | 附注 | 2006年 | 2005年 |
|---|---|---|---|
| 本期基金净收益 | | 335,510,870.60 | 9,284,922.51 |
| 加:期初基金净收益 | | -9,031,795.26 | - |
| 加:本期申购基金单位的损益平准金 | | 65,375,241.04 | 4,556,720.29 |
| 减:本期赎回基金单位的损益平准金 | | 68,693,000.47 | 3,500,023.45 |
| 可供分配基金净收益 | | 323,161,315.91 | 10,341,619.35 |
| 减:本期已分配基金净收益 | 7(17) | 198,051,672.05 | 19,373,414.61 |
| 期末基金净收益 | | 125,109,643.86 | -9,031,795.26 |

3、基金净值变动表(单位:元)

| 项目 | 附注 | 2006年 | 2005年 |
|---|---|---|---|
| 一、期初基金净值 | | 683,033,735.13 | 900,519,775.77 |
| 二、本期经营活动: | | | |
| 基金净收益 | | 335,510,870.60 | 9,284,922.51 |
| 未实现估值增值变动数 | | 141,452,735.04 | 20,031,995.78 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | | 476,963,605.64 | 29,316,918.29 |
| 三、本期基金单位交易: | | | |
| 基金申购款 | | 660,148,185.72 | 306,052,240.77 |
| 其中:分红再投资 | | 35,140,681.87 | 4,678,320.73 |
| 基金赎回款 | | -932,299,872.14 | -533,481,785.09 |
| 基金单位交易产生的基金净值变动数 | | -272,151,686.42 | -227,429,544.32 |
| 四、本期向持有人分配收益 | | -198,051,672.05 | -19,373,414.61 |
| 五、期末基金净值 | | 689,793,982.30 | 683,033,735.13 |

(二)基金财务会计报表附注

3、本年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。本年度内无重大会计差错。

6、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

本报告期内,关联方关系未发生变化。

| 关联方名称 | 关联方关系 |
|---|---|
| 友邦华泰基金管理有限公司 | 基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构 |
| 中国银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| AIG Global Investment Corp.(AIGGIC) | 基金管理人的发起股东 |
| 华泰证券有限责任公司 | 基金管理人的发起股东、基金代销机构 |
| 苏州新区高新技术产业股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

关联方与基金进行的关联交易均在正常业务中按照一般商业条款而订立的。

(2)关联方交易

1)通过关联方席位进行的交易

| 关联方及关联方交易 | 2006年 | | 2005年 | |
|---|---|---|---|---|
| | 金额(元) | 比例(%) | 金额(元) | 比例(%) |
| 1、股票交易 | | | | |
| 华泰证券有限责任公司 | 441,535,750.98 | 17.00 | 406,485,562.84 | 29.87 |
| 2、债券交易 | | | | |
| 华泰证券有限责任公司 | - | - | 2,175,932.70 | 4.41 |
| 3、债券回购交易 | | | | |
| 华泰证券有限责任公司 | - | - | 573,200,000.00 | 8.24 |
| 4、权证交易 | | | | |
| 华泰证券有限责任公司 | 1,535,166.49 | 12.06 | - | - |
| 5、佣金 | | | | |
| 华泰证券有限责任公司 | 356,191.32 | 16.92 | 313,851.22 | 30.44 |

上述佣金按股票交易量的千分之一计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的股票、债券和回购交易的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

2)关联方报酬

① 管理人报酬

本基金应支付基金管理人报酬,按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

| | 2006年 | 2005年 |
|---|---|---|
| 管理人报酬(元) | 9,289,413.19 | 7,287,899.07 |

② 托管人报酬

本基金应支付基金托管人托管费,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为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

| | 2006年 | 2005年 |
|---|---|---|
| 托管人报酬(元) | 1,548,235.47 | 1,214,649.86 |

3)与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

| 关联方及关联方交易 | 2006年 | 2005年 |
|---|---|---|
| | 金额(元) | 金额(元) |
| 1、银行间债券交易 | | |
| 中国银行股份有限公司 | 29,824,298.63 | 140,373,213.59 |
| 2、银行间回购交易 | | |
| 中国银行股份有限公司 | - | 190,905,000.00 |
| 3、银行间回购利息收入 | | |
| 中国银行股份有限公司 | - | - |
| 4、银行间回购利息支出 | | |
| 中国银行股份有限公司 | - | 176,402.41 |

4)关联方投资本基金的情况

①基金管理公司投资本基金的情况

本报告期及2005年度,基金管理公司均未投资本基金。

②基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况

| 关联方名称 | 期末持有基金份额(份) | | 占总份额比例(%) | |
|---|---|---|---|---|
| | 2006年 | 2005年 | 2006年 | 2005年 |
| 华泰证券有限责任公司 | 51,531,847.23 | 51,472,592.69 | 11.66 | 7.59 |

5)由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

| 关联方名称 | 期末保管的银行存款(元) | | 利息收入(元) | |
|---|---|---|---|---|
| | 2006年 | 2005年 | 2006年 | 2005年 |
| 中国银行股份有限公司 | 114,602,966.02 | 38,099,108.63 | 957,424.32 | 999,754.08 |

本报告期,基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

8、报告期末流通转让受到限制的基金资产的说明

(1)因股权分置改革而停牌的股票

本基金截至2006年12月31日持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。停牌期间,这些股票的估值方法采用停牌前收盘价估值。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 数量 | 总成本 | 估值单价 | 总市值 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 方案实施阶段停牌: | | | | | | | | |
| 000549 | S湘火炬 | 06-12-19 | 2,342,342 | 12,837,479.97 | 8.90 | 20,846,843.80 | 未知 | 未知 |

(2)基金参与新股申购流通受限的股票

基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订的申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至2006年12月31日止投资的流通受限制的股票情况如下:

| 股票代码 | 股票名称 | 数量 | 总成本 | 总市值 | 占基金资产净值比例(%) | 估值方法 | 流通受限原因 | 受限期限 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 601006 | 大秦铁路 | 42,504 | 210,394.80 | 344,282.40 | 0.05 | 收盘价 | 网下公开发行未流通 | 2007-02-01起流通 |
| 601628 | 中国人寿 | 57,000 | 1,076,160.00 | 1,076,160.00 | 0.16 | 成本价 | 网上申购未上市 | 2007-01-09起流通 |

9、有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

自基金合同生效日起至本报告期期末,本基金未投资非公开定向增发的流通受限制的股票;未投资可分离交易的可转债;未投资资产支持证券。

**六、投资组合报告**

(一)报告期末基金资产组合情况

| 项目名称 | 金额(元) | 占基金资产总值比例(%) |
|---|---|---|
| 股票 | 593,861,881.73 | 83.61 |
| 债券 | - | - |
| 权证 | - | - |
| 银行存款和清算备付金合计 | 115,326,518.20 | 16.24 |
| 资产支持证券 | - | - |
| 其他资产 | 1,051,106.97 | 0.15 |
| 合计 | 710,239,506.90 | 100.00 |

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

| 行业 | 市值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|
| A 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B 采掘业 | 25,674,556.62 | 3.72 |
| C 制造业 | 360,550,834.12 | 52.27 |
| C0 食品、饮料 | 47,153,260.00 | 6.84 |
| C1 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 木材、家具 | 9,105,740.00 | 1.32 |
| C3 造纸、印刷 | 18,561,947.35 | 2.69 |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | - | - |
| C5 电子 | 8,734,231.24 | 1.27 |
| C6 金属、非金属 | 61,060,400.18 | 8.85 |
| C7 机械、设备、仪表 | 162,447,032.41 | 23.55 |
| C8 医药、生物制品 | 53,488,222.94 | 7.75 |
| C99 其他制造业 | - | - |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 1,598,881.40 | 0.23 |
| E 建筑业 | 19,928,140.50 | 2.89 |
| F 交通运输、仓储业 | 68,865,758.03 | 9.98 |
| G 信息技术业 | 3,062,867.60 | 0.44 |
| H 批发和零售贸易 | 12,747,746.99 | 1.85 |
| I 金融、保险业 | 64,585,624.83 | 9.36 |
| J 房地产业 | 36,847,471.64 | 5.34 |
| K 社会服务业 | - | - |
| L 传播与文化产业 | - | - |
| M 综合类 | - | - |
| 合计 | 593,861,881.73 | 86.09 |

(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 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 市值(元) | 占资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000858 | 五粮液 | 2,063,600 | 47,153,260.00 | 6.84 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 2,273,769 | 37,198,860.84 | 5.39 |
| 3 | 000157 | 中联重科 | 1,471,408 | 32,709,399.84 | 4.74 |
| 4 | 600325 | 华发股份 | 2,198,218 | 30,291,444.04 | 4.39 |
| 5 | 600019 | 宝钢股份 | 3,432,615 | 29,726,445.90 | 4.31 |
| 6 | 000549 | S湘火炬 | 2,342,342 | 20,846,843.80 | 3.02 |
| 7 | 600496 | 长江精工 | 2,850,950 | 19,928,140.50 | 2.89 |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 1,576,894 | 18,717,731.78 | 2.71 |
| 9 | 600308 | 华泰股份 | 1,361,845 | 18,561,947.35 | 2.69 |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 979,916 | 18,530,211.56 | 2.69 |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.aig-huatai.com网站的年度报告正文

(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) | 占期初资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 000858 | 五粮液 | 44,764,973.87 | 6.55 |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 33,246,363.30 | 4.87 |
| 3 | 600031 | 三一重工 | 29,072,483.26 | 4.26 |
| 4 | 600325 | 华发股份 | 28,720,691.32 | 4.20 |
| 5 | 600870 | 厦华电子 | 28,154,992.62 | 4.12 |
| 6 | 600009 | 上海机场 | 26,842,994.49 | 3.93 |
| 7 | 600019 | 宝钢股份 | 26,667,029.97 | 3.90 |
| 8 | 000024 | 招商地产 | 26,546,743.57 | 3.89 |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 25,533,029.25 | 3.74 |
| 10 | 600085 | 同仁堂 | 25,125,533.98 | 3.68 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 24,777,637.33 | 3.63 |
| 12 | 000002 | 万科A | 24,191,110.47 | 3.54 |
| 13 | 000549 | S湘火炬 | 23,760,190.62 | 3.48 |
| 14 | 600557 | 康缘药业 | 21,130,324.35 | 3.09 |
| 15 | 000837 | 秦川发展 | 20,514,651.82 | 3.00 |
| 16 | 000157 | 中联重科 | 19,213,895.52 | 2.81 |
| 17 | 600418 | 江淮汽车 | 18,907,538.59 | 2.77 |
| 18 | 600900 | 长江电力 | 18,707,281.77 | 2.74 |
| 19 | 600361 | 华联综超 | 18,596,346.92 | 2.72 |
| 20 | 600496 | 长江精工 | 17,520,439.86 | 2.57 |
| 21 | 000651 | 格力电器 | 17,493,068.52 | 2.56 |
| 22 | 600018 | 上港集团 | 17,446,439.27 | 2.55 |
| 23 | 600639 | 浦东金桥 | 16,540,178.59 | 2.42 |
| 24 | 600050 | 中国联通 | 16,426,898.22 | 2.40 |
| 25 | 600521 | 华海药业 | 15,436,087.52 | 2.26 |
| 26 | 600337 | 美克股份 | 15,235,335.10 | 2.23 |
| 27 | 600423 | 柳化股份 | 15,217,426.08 | 2.23 |
| 28 | 601398 | 工商银行 | 15,156,848.92 | 2.22 |
| 29 | 600585 | 海螺水泥 | 14,979,249.74 | 2.19 |
| 30 | 600535 | 天士力 | 14,958,611.68 | 2.19 |
| 31 | 600005 | 武钢股份 | 14,704,952.00 | 2.15 |
| 32 | 600125 | 铁龙物流 | 14,206,423.11 | 2.08 |
| 33 | 600308 | 华泰股份 | 14,103,683.09 | 2.06 |
| 34 | 600686 | 金龙汽车 | 13,997,928.67 | 2.05 |
| 35 | 600104 | 上海汽车 | 13,764,953.50 | 2.02 |
| 36 | 000063 | 中兴通讯 | 13,693,838.07 | 2.00 |

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) | 占期初资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 59,448,659.51 | 8.70 |
| 2 | 600309 | 烟台万华 | 51,833,432.26 | 7.59 |
| 3 | 600028 | 中国石化 | 45,147,906.96 | 6.61 |
| 4 | 600018 | 上港集团 | 44,772,469.23 | 6.55 |
| 5 | 600031 | 三一重工 | 44,313,528.68 | 6.49 |
| 6 | 000002 | 万科A | 41,774,711.78 | 6.12 |
| 7 | 600900 | 长江电力 | 41,305,018.88 | 6.05 |
| 8 | 600870 | 厦华电子 | 40,025,217.23 | 5.86 |
| 9 | 000063 | 中兴通讯 | 38,825,062.13 | 5.68 |
| 10 | 600639 | 浦东金桥 | 38,342,950.47 | 5.61 |
| 11 | 600361 | 华联综超 | 35,939,975.11 | 5.26 |
| 12 | 600547 | 山东黄金 | 35,261,534.09 | 5.16 |
| 13 | 600761 | 安徽合力 | 34,583,344.80 | 5.06 |
| 14 | 000792 | 盐湖钾肥 | 32,863,127.40 | 4.81 |
| 15 | 600418 | 江淮汽车 | 32,810,751.55 | 4.80 |
| 16 | 600085 | 同仁堂 | 32,777,229.12 | 4.80 |
| 17 | 600009 | 上海机场 | 32,374,710.70 | 4.74 |
| 18 | 000024 | 招商地产 | 32,348,627.66 | 4.74 |
| 19 | 600030 | 中信证券 | 30,545,022.23 | 4.47 |
| 20 | 600270 | 外运发展 | 28,478,235.37 | 4.17 |
| 21 | 600550 | 天威保变 | 26,082,492.75 | 3.82 |
| 22 | 600519 | 贵州茅台 | 23,642,620.70 | 3.46 |
| 23 | 600019 | 宝钢股份 | 23,640,133.74 | 3.46 |
| 24 | 600050 | 中国联通 | 22,976,783.70 | 3.36 |
| 25 | 600337 | 美克股份 | 22,429,267.01 | 3.28 |
| 26 | 600535 | 天士力 | 22,317,524.69 | 3.27 |
| 27 | 600557 | 康缘药业 | 22,167,983.72 | 3.25 |
| 28 | 600886 | 国投电力 | 21,025,059.33 | 3.08 |
| 29 | 600029 | S南航 | 19,853,360.80 | 2.91 |
| 30 | 600423 | 柳化股份 | 18,673,560.69 | 2.73 |
| 31 | 600276 | 恒瑞医药 | 18,660,657.65 | 2.73 |
| 32 | 600835 | 上海机电 | 18,057,010.63 | 2.64 |
| 33 | 000866 | 扬子退市 | 17,118,111.81 | 2.51 |
| 34 | 600585 | 海螺水泥 | 16,968,802.72 | 2.48 |
| 35 | 000837 | 秦川发展 | 16,232,343.04 | 2.38 |
| 36 | 600205 | S山东铝 | 15,804,796.08 | 2.31 |
| 37 | 000651 | 格力电器 | 15,785,535.51 | 2.31 |
| 38 | 000858 | 五粮液 | 15,690,595.31 | 2.30 |
| 39 | 600458 | 时代新材 | 15,548,307.35 | 2.28 |
| 40 | 600012 | 皖通高速 | 15,288,799.33 | 2.24 |
| 41 | 600348 | 国阳新能 | 14,051,932.90 | 2.06 |
| 42 | 600236 | 桂冠电力 | 13,756,044.42 | 2.01 |
| 43 | 600000 | 浦发银行 | 13,692,429.42 | 2.00 |

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

| 买入股票成本总额(元) | 卖出股票收入总额(元) |
|---|---|
| 1,100,663,308.46 | 1,507,842,551.75 |

(五)报告期末按券种分类的债券投资组合

截至本报告期末,本基金未持有债券。

(六)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的,也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资前十名股票中,没有投资于超出基金合同规定备