

## 海富通风格优势股票型证券投资基金 2006年年度报告摘要

## 第一节 重要提示

本年度报告摘要摘自年度报告正文,报告正文同时登载于基金管理人网站(<http://www.hftfund.com>)。投资者欲了解详细内容,应仔细阅读年度报告正文。

基金管理人的董事会有责任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。本年度报告已经会计师事务所审阅,并由董事长签字。

基金托管人中国建设银行银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3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,保证复核数据不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的资产不受损失。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。

本报告期内为2006年10月19日基金合同生效日起至2006年12月31日止。本报告财务资料已经审计,普华永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。

## 第二节 基金简介

<b>(一) 基金基本情况</b>	
1. 基金名称:	海富通优势
2. 基金交易代码:	519013
3. 基金运作方式:	契约型开放式
4. 基金合同生效日:	2006年10月19日
5. 报告期末基金份额总额:	2,023,268,021.61 份
<b>(二) 基金产品说明</b>	
1. 投资目标:	在适度控制风险并保持资产良好流动性的前提下,通过积极投资不同风格优势的股票,力争为投资者提供长期稳定的超额回报。
2. 投资策略:	本基金将在适度大类资产配置的基础上,运用“风格优选、积极轮换、精选个股”策略,根据不同风格投资策略在不同阶段的变动趋势和投资机会,并在境内向下而向上精选个股,实现基金资产的超额收益。本基金的投资策略主要投资于“风格优选、积极轮换和精选个股”策略。
3. 业绩比较基准:	上证综合指数75%+上证国债指数25%。
4. 风险收益特征:	本基金是股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。
<b>(三) 基金管理人</b>	
1. 名称:	海富通基金管理有限公司
2. 信息披露负责人:	吴万英
3. 联系电话:	021-68604999-691
4. 传真:	021-50479076
5. 电子邮箱:	wrx@hftfund.com
<b>(四) 基金托管人</b>	
1. 名称:	中国建设银行股份有限公司
2. 信息披露负责人:	尹东
3. 联系电话:	010-67595104
4. 传真:	010-66275853
5. 电子邮箱:	yindong@ccb.com
登载年度报告正文的官方网站网址: <a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>	
基金年度报告置备地点: 基金管理人及基金托管人的办公场所	

下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。

<b>一、主要财务指标</b>		
序号	项目	2006年
1	基金本期净收益(元)	173,231,242.55
2	加权平均基金份额本期净收益(元)	0.0759
3	期末可供分配基金份额净收益(元)	0.0768
4	期末基金份额净值(元)	2.726,832,179.40
5	期末基金份额净值增值	1.348
6	本期基金份额净值增长率	34.50%

注:本基金合同生效日为2006年10月19日,2006年度主要财务指标的计算期间为2006年10月19日至2006年12月31日。

**二、基金业绩比较**

1. 本基金本期净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较:					
本基金本期净值增长率(1)	34.50%	同期业绩比较基准收益率(2)	12.7%	业绩比较基准差(3)	21.80%
(1)-(2)		(3)-(4)		(4)-(5)	0.18%

2. 本基金合同生效以来基金净值变动情况,及与同期业绩比较基准的变动比较:

海富通风格优势股票型证券投资基金自基金合同生效以来,基金净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2006年10月19日至2006年12月31日)

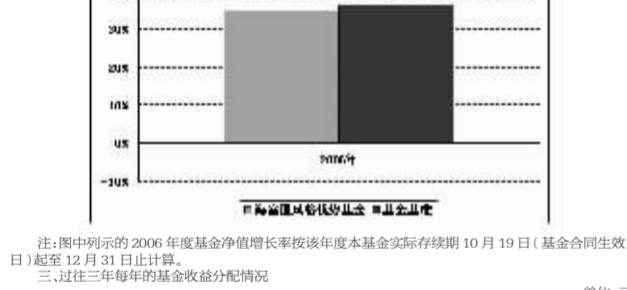


注: (1) 本基金合同于2006年10月19日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年,2006年度的相关数据按照当年的实际存续期间计算。

(2) 根据基金合同规定,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。建仓期满后,本基金的各项投资比例达到基金合同第二条(二)、(六)、(七)的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3. 本基金自基金合同生效以来每年的净值增长率,及与同期业绩比较基准的收益率比较:

海富通风格优势股票型证券投资基金净值增长率业绩比较基准收益率历史收益率的对比图



注:图中列示的2006年度基金净值增长率按照年度基金实际存续期间10月19日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

三、过往三年每年的基金收益分配情况

年度	每10份基金份额分红元(至少保留三位小数)	备注
2006年	0.00	
合计	0.00	

## 第三节 基金管理人

一、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有限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招商证券股份有限公司于2003年4月1日共同发起设立。海富通风格优势股票型证券投资基金基金基金管理人海富通基金管理有限公司,基金管理人目前还管理着海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通优势增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票证券投资基金和海富通债券(回报)基金等证券投资基金五只开放式证券投资基金。

(二) 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理财,广东发展银行深圳分行业务助理,嘉实基金管理有限公司基金经理。2000年4月至今年海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通风格优势股票基金经理,2006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月任海富通优势增长基金基金经理,2006年10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。

胡先生,CFP,美国迈阿密大学MBA,历任君安证券股份有限公司投资经理,广发证券股份有限公司,加拿大 Domier International 公司金融助理,美国 Robert W. Baird 投资理财基金经理,2003年4月至今年海富通基金管理有限公司,任投资部经理职务,海富通精选基金基金经理。2006年4月至2006年9月任海富通精选基金基金经理,2006年5月至2006年9月任海富通优势增长基金基金经理,2006年7月至今年任海富通股票基金基金经理,2006年10月至2007年3月任海富通风格优势基金基金经理。

2007年3月10日,郑煜先生因个人工作变动的原因不再担任本基金基金经理。

二、对报告期内基金运作的遵规情况说明

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,《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》、《海富通风格优势股票型证券投资基金基金托管协议》和其他相关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责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

一季度本基金在谨慎投资的前提下,积极把握了已发行的新股发行机会,通过积极参与新股申购,使得本基金在二级市场获得了较好的收益。二季度本基金在保持流动性、控制仓位的前提下,积极把握了已发行的新股发行机会,通过积极参与新股申购,使得本基金在二级市场获得了较好的收益。三季度本基金在保持流动性、控制仓位的前提下,积极把握了已发行的新股发行机会,通过积极参与新股申购,使得本基金在二级市场获得了较好的收益。四季度本基金在保持流动性、控制仓位的前提下,积极把握了已发行的新股发行机会,通过积极参与新股申购,使得本基金在二级市场获得了较好的收益。

四、宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

展望二季度,中国宏观经济依然存在一些不确定性因素,主要包括中国宏观经济数据和出口增速,政府宏观调控政策,全球通非流通股减持压力。上市公司治理股权激励实施力度等。对A股市场而言,经过二季末六个月的持续上涨后,整体市场特别是部分优质蓝筹估值已显偏高。但考虑到中国宏观经济有望继续保持高速增长,全球通非流通股减持压力和流通股减持压力趋于一致,管理层维稳实施后带来的利好,以及A股市场估值仍处于合理水平,甚至不排除在二季度中期可能出现,从而为市场带来上行动力。以此为背景,海富通的风格优势基金在二季度中将继续持有较大仓位,但向上移动不会过快。

预计二季度末A股市场热点将趋于多元化,因此对于投资主题和个股的选择将成为基金构建投资组合的主要方向。海富通重点关注的投资主题包括:国家鼓励扶持的自主创新技术、节能环保建设等;全面流通的资产注入、并购等。以此为背景,海富通风格优势基金将继续加大对大类资产配置把握,运用“风格优选、积极轮换、精选个股”策略,把握不同风格投资策略在不同阶段的变动趋势和投资机会,并在境内向下而向上精选个股,实现基金资产的超额收益。

海富通银行股份有限公司根据《海富通风格优势股票型证券投资基金合同》和《海富通风格优势股票型证券投资基金托管协议》,托管海富通风格优势股票型证券投资基金(以下简称海富通优势基金)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在海富通优势基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定进行了基金托管业务的会计核算,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基金托

管人应尽的义务。

本报告期,按照国家有关规定,基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人—海富通基金管理有限公司在海富通优势基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了复核,未发现基金管理人有关基金份额持有人的利益的行为。

由海富通基金管理有限公司—海富通基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的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真实、准确和完整。

## 第六节 审计报告

普华永中天会计师事务所有限公司对海富通风格优势股票型证券投资基金2006年12月31日的资产负债表以及2006年度的经营业绩和基金净值变动表,出具了无保留意见的审计报告(普华永中天审字[2007]第20193号)。

## 第七节 财务会计报告

<b>一、基金会计报表</b>	
(一) 资产负债表	
(除特别注明外,金额单位为人民币元)	
	2006年12月31日
资产	
银行存款	226,558,581.38
清算备付金	12,173,115.21
交易保证金	5
应收利息	6
应收股利	672,567.40
应收申购款	7,291,707.22
投资类资产	2,381,507,885.56
其中:股票投资成本	1,773,555,743.21
其中:债券投资成本	135,684,000.00
其中:权证投资成本	135,494,737.94
其中:应收股利	40,299,792.00
其中:应收利息	34,854,187.63
资产总计	2,804,437,648.77

<b>负债及持有人权益</b>	
负债	
关联方	
应付证券清算款	6,903,819.96
应付赎回款	63,347,464.81
应付管理费	238,485.70
应付托管费	3,478,291.27
应付利息	579,715.00
应付佣金	7
其他应付项	8
预提费用	9
负债合计	77,605,469.37
持有人权益	
实收基金	10
未实现利得	11
未分配基金净收益	12
持有人权益合计	13

2006年末基金份额净值(1.348元)

负债及持有人权益总计

附后会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 经营业绩表及收益分配表

<b>一、基金会计报表</b>	
(除特别注明外,金额单位为人民币元)	
	2006年10月19日
	(基金合同生效日)
	至2006年
	12月31日止期间

收入

股票差价收入

债券差价收入

权证差价收入

债券利息收入

存款利息收入

买入返售证券收入

其他收入

收入合计

费用

基金管理人报酬

基金托管费

卖出回购证券支出

其他费用

其中:信息披露费

审计费用

费用合计

基金净收益

加:未实现估值增值/(减值)变动数

基金经营业绩

基金净收益

本期可供基金份额持有人分配的基金净收益

本期基金份额持有人的分配收益

向基金份额持有人分配的基金净收益变动数

期末基金份额净值

附后会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、年度会计报表附注(除特别注明外,金额单位为人民币元)

(一) 主要会计政策及会计估计

1. 会计年度

2. 记账本位币

3. 基金会计核算

4. 公允价值

5. 金融资产估值

6. 应收利息

7. 应收股利

8. 债券投资

9. 股票投资

10. 权证投资

11. 基金估值

12. 基金费用

13. 基金收益

14. 基金资产

15. 基金负债

16. 基金持有人权益

17. 基金收入

18. 基金费用

19. 基金收益

20. 基金资产

21. 基金负债

22. 基金持有人权益

23. 基金收入

24. 基金费用

25. 基金收益

26. 基金资产

27. 基金负债

28. 基金持有人权益

29. 基金收入

30. 基金费用

31. 基金收益

32. 基金资产

33. 基金负债

34. 基金持有人权益

35. 基金收入

36. 基金费用

37. 基金收益

本基金的基金管理人按照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照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照资金余额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

a) 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份额赎回日计入。上述申购和赎回分别包括基金转换转入(赎回)产生的实收基金增加和转出基金的资金减少。

b) 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份额赎回确认日计入。

c) 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/(累计未分配基金净损失)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份额赎回确认日计入,并于期末全额转入未分配基金收益/(累计基金净损失)。

d) 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红利再投资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,且最多不超过四次,收取基金收益的比例不低于可分配收益的60%;但当年基金成立未满两个月,则不进行收益分配。基金收益分配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,基金份额净值不得低于面值。

经营期间的分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]7号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券投资基金印花税率的通知》、财税[2006]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2006]103号《关于股权分置试点上市公司有关税收问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税列明如下:

a) 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。

b) 基金买卖股票、债券的差价收入,暂免征收营业税和企业所得税。

c) 对基金取得的国债利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,并暂免征收印花税。

d) 基金买卖股票应缴纳的印花税,由基金管理人承担。

e) 基金管理人运用基金财产进行融资融券业务,其融资融券利息暂免征收印花税。

f) 基金管理人运用基金财产买卖国债、金融债券、企业债券、短期融资券等,其利息收入暂免征收企业所得税。

g) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其差价收入暂免征收企业所得税。

h) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

i) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

j) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

k) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

l) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

m) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

n) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

o) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

p) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

q) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

r) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

s) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

t) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

u) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

v) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

w) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

x) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

y) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

z) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

aa) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

ab) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ac) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

ad) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ae) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

af) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ag) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

ah) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ai) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

aj) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ak) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

al) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

am) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

an) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ao) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

ap) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

aq) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

ar) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

as) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

at) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

au) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

av) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

aw) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

ax) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ay) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

az) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

ba) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

bb) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

bc) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。

bd) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其利息收入暂免征收企业所得税。

be) 基金管理人运用基金财产买卖证券投资基金,其股息红利收入暂免征收企业所得税。