海富通强化回报混合型证券投资基金 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年3月28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。

第二节 基金简介

（一）基金基本资料	
1、基金简称：	海富通回报
2、基金交易代码：	519007
3、基金运作方式：	契约型开放式
4、基金合同生效日：	2006年5月25日
5、报告期末基金份额总额：	1,514,312,948.77份
6、基金合同存续期：	无
7、基金份额上市的证券交易所：	无
8、上市日期：	无
（二）基金产品说明	
1、投资目标：	每年超越三年期定期存款（税前）加权平均收益率。
2、投资策略：	本基金认为，灵活而有纪律的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而收益管理和风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金将运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的投资目标。
3、业绩比较基准：	三年期银行定期存款(税前)加权平均收益率
4、风险收益特征：	追求每年高于一定正回报的投资品种。属于适度风险、适中收益的混合型基金，其长期的预期收益和风险高于债券基金，低于股票基金。
（三）基金管理人	
1、名称：	海富通基金管理有限公司
2、信息披露负责人：	奚万荣
3、联系电话：	021-68604999-591
4、传真：	021-50479057
5、电子邮箱：	wrxi@hftfund.com
（四）基金托管人	
1、名称：	招商银行股份有限公司
2、信息披露负责人：	姜然
3、联系电话：	0755-83195226
4、传真：	0755-83195201
5、电子邮箱：	jiangran@cmbchina.com
（五）信息披露	
登载年度报告正文的管理人互联网网址：	http://www.hftfund.com
基金年度报告置备地点：	基金管理人及基金托管人的住所

第三节 主要财务指标和基金净值表现

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。

一、主要财务指标

序号	项目	2006年
1	基金本期净收益(元)	340,836,608.21
2	加权平均基金份额本期净收益(元)	0.1562
3	期末可供分配基金份额收益(元)	0.0141
4	期末基金资产净值(元)	1,704,194,551.63
5	期末基金份额净值(元)	1.125
6	本期基金份额净值增长率	34.36%

注：本基金合同生效日为2006年5月25日，2006年度主要财务指标的计算期间为2006年5月25日至2006年12月31日。

二、基金净值表现

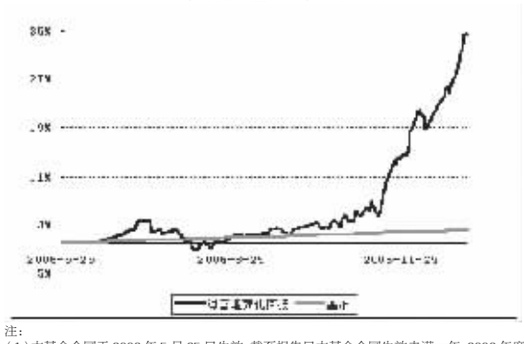
1、本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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）	业绩比较基准标准差（4）	(1)-(3)	(2)-(4)
过去3个月	31.21%	0.89%	0.92%	0.01%	30.29%	0.88%
过去6个月	31.86%	0.74%	1.78%	0.01%	30.08%	0.73%
自基金合同生效起至今	34.36%	0.68%	2.10%	0.01%	32.26%	0.67%

2、本基金合同生效以来基金份额净值变动情况，及与同期业绩比较基准的变动比较：

海富通强化回报混合型证券投资基金累计份额净值增长率及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006年5月25日至2006年12月31日）



注：

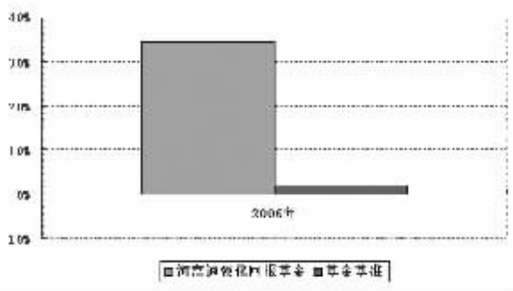
（1）本基金合同于2006年5月25日生效，截至报告日本基金合同生效未满一年，2006年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

（2）按照本基金合同规定，本基金建仓期为基金合同生效之日起六个月。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十二条（二）、（七）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

（3）自2006年9月起，由蒋征先生担任本基金基金经理，郑拓先生不再担任本基金基金经理。

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：

海富通强化回报混合型证券投资基金净值增长率与业绩比较基准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该年度本基金实际存续期5月25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

单位：元

年度	每10份基金份额分红数（元）	备注
2006年	1.930	(a)
合计	1.930	

(a) 2006年度，本基金分别于10月26日、11月27日、12月13日发布第一、二、三次分红公告，分别向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.10、0.20、1.63元，共计1.93元。

第四节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理情况

（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富通基金管理公司于2003年4月1日共同发起设立。本海富通强化回报混合型证券投资基金是基金管理人管理的第五只开放式基金；除本基金外，基金管理人目前还管理着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、海富通股票证券投资基金和海富通风格优势股票型证券投资基金五只开放式基金。

（二）基金经理简介

蒋征先生，工商管理硕士，持有基金从业人员资格证书，证券从业年限9年。历任中国保险信托投资公司业务经理，嘉实基金管理有限公司丰和证券投资基金基金经理助理，2003年1月至2004年4月任泰和证券投资基金基金经理，2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选基金基金经理，2005年12月至2006年5月任基金兴安基金经理。2006年6月加入海富通基金管理有限公司，2006年9月起任海富通强化回报混合型证券投资基金基金经理，2007年2月起，兼任海富通股票基金基金经理。

邵佳民先生，上海财经大学硕士毕业，持有基金从业人员资格证书。历任海通证券公司固定收益部债券业务助理、债券销售主管、债券分析师、债券投资部经理。2003年4月任海富通基金管理有限公司固定收益分析师，2005年1月至今任海富通货币市场基金基金经理，2006年9月起担任本基金基金经理。

二、对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、《海富通强化回报混合型证券投资基金基金合同》、《海富通强化回报混合型证券投资基金基金招募说明书》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

二零零六年，随着股权分置改革的不断深化，在人民币升值和国民经济快速增长的影响下，中国的A股市场展开了一波迅猛的上涨行情，不断创出历史新高。A股市场在国民经济和金融体系中的地位空前提高，市场的投资价值获得了国内和国际投资者的普遍认可，越来越多的投资者将参与到这个市场中。二零零六年五月底成立的海富通强化回报基金，在A股市场配置了较多的资产，分享了A股市场大幅上涨带来的收益，在银行、券商等金融资产上的超额配置也取得了比较好的效果。

截止本报告期末，本基金份额净值为1.125元，累计净值为1.318元。报告期内，基金净值增长了34.36%，而同期基金业绩比较基准上升2.10%，基金净值跑赢业绩比较基准32.26%。

四、对宏观经济、证券市场及行业走势等的简要展望

虽然经过了2006年的大幅上涨，中国A股市场还是维持在基本合理的整体估值水平。在上市公司盈利继续增长、人民币持续升值和市场制度的不断创新的背景下，我们依然看好A股市场的长期前景。我们认为2007年的市场将比2006年更多的体现波动性和复杂性，市场的收益率将有所下降。同时，新的投资产品的不断推出，将带来更多样化的盈利机会。我们将继续根据不同资产类的风险收益的比较，采用相对灵活的资产配置策略，对基金资产进行管理。

第五节 托管人报告

托管人声明：在本报告期内，基金托管人不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本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是真实、准确和完整的。

招商银行股份有限公司

2007年3月28日

第六节 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司对海富通强化回报混合型证券投资基金2006年12月31日的资产负债表以及2006年度的经营业绩表和基金净值变动表，出具了无保留意见的审计报告（普华永道中天审字(2007)第20192号）。

第七节 财务会计报告

一、经审计的基金会计报表

（一）资产负债表

海富通强化回报混合型证券投资基金

2006年12月31日资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注		2006年12月31日
资产			
银行存款			348,918,751.19
结算备付金			3,885,738.67
交易保证金	5		820,000.00
应收证券清算款			637,173.27
应收利息	6		1,067,752.69
应收申购款			3,320,405.15
股票投资市值			1,237,477,073.24
其中：股票投资成本			1,035,538,588.51
债券投资市值			143,703,761.13
其中：债券投资成本			143,560,423.02
权证投资市值			6,774,579.00
其中：权证投资成本			3,442,352.13
资产总计			1,746,605,234.34
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款			23,964,419.51
应付赎回款			12,097,542.83
应付赎回费			41,713.49
应付管理人报酬			2,205,000.25
应付托管费			367,500.01
应付佣金	7		3,174,435.52
其他应付款	8		260,071.10
预提费用	9		300,000.00
负债合计			42,410,682.71
持有人权益			
实收基金	10		1,514,312,948.77
未实现利得	11		168,541,566.41
未分配基金净收益			21,340,036.45
持有人权益合计			1,704,194,551.63
(2006年末基金份额资产净值:1.125元)			
负债及持有人权益总计			1,746,605,234.34
后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。			

（二）经营业绩及收益分配表

海富通强化回报混合型证券投资基金

经营业绩表

2006年5月25日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注		2006年5月25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	12		347,209,084.57
债券差价损失	13		(12,662,496.09)
权证差价收入	14		15,611,417.17
债券利息收入			10,043,705.40
存款利息收入			3,843,593.83
股利收入			1,866,630.20
买入返售证券收入			144,086.47
其他收入	15		1,778,093.31
收入合计			367,834,114.86
费用			
基金管理人报酬			(20,294,847.84)
基金托管费			(3,382,474.58)
卖出回购证券支出			(2,915,668.69)
其他费用	16		(404,515.54)
其中：信息披露费			(200,000.00)
审计费用			(100,000.00)
费用合计			(26,997,506.65)
基金净收益			340,836,608.21
加：未实现估值增值/(减值)变动数	11		205,414,049.71
基金经营业绩			546,250,657.92
基金净收益			340,836,608.21
本期申购基金份额的损益平准金			2,471,206.09
本期赎回基金份额的损益平准金			(18,852,051.74)
可供分配基金净收益			324,455,762.56
减：本期已分配基金净收益	17		(303,115,726.11)
未分配基金净收益			21,340,036.45
后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。			

（三）基金净值变动表

海富通强化回报混合型证券投资基金

基金净值变动表

2006年5月25日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	2006年5月25日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间
期初基金净值	2,564,312,627.02
本期经营活动	
基金净收益	340,836,608.21
未实现估值增值/(减值)变动数	205,414,049.71
经营活动产生的基金净值变动数	546,250,657.92
本期基金份额交易	
基金申购款	303,215,400.47
其中：分红再投资	62,077,617.03
基金赎回款	(1,406,468,407.67)
基金份额交易产生的基金净值变动数	(1,103,253,007.20)
本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	(303,115,726.11)
期末基金净值	1,704,194,551.63
后附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

1. 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2006年5月25日(基金合同生效日)至2006年12月31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。2006年11月13日之前取得的非公开发行股票，在锁定期内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。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

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；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。

(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。

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。

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。每实现收益达到一年定期存款利率(税前)，即可分红。在满足分红的条件下每年分红不超过十二次，每次分配比例不低于基金已实现收益的60%。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。

2. 主要税项

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]78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(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(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营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，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，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金买卖股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税。

(e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

3. 重大会计差错的内容和更正金额

本报告期无重大会计差错。

4. 重大关联方关系及关联交易

(a) 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
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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

下述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证券交易及交易佣金

无。

(b) 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X 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20,294,847.84元。

(d) 基金托管费

支付基金托管人招商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X 0.25%／当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费3,382,474.58元。

(e) 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招商银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为348,918,751.19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3,803,719.53元。

(f) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

无。

(g) 本基金各关联方在本会计期间无投资本基金的情况

5. 流通受限制不能自由转让的基金资产

(a) 本基金截至2006年12月31日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案实施阶段停牌：								
000504	S赛迪	06/12/14	5.74	07/01/15	5.36	2,079,116	12,294,203.45	11,934,125.84

(b) 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认购。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。

此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

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	成功申购日期	可流通日期	申购价格	年末估值单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
601988	中国银行	06/06/28	07/01/05	3.08	5.43	16,504,965	50,835,292.20	89,621,959.95
600550	天威保变	06/06/08	发行结束日起12个月	17.60	18.25	2,800,000	49,280,000.00	51,100,000.00
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.10	4,959,300	24,548,535.00	40,170,330.00
601333	广深铁路	06/12/18	07/03/22	3.76	7.20	5,354,200	20,131,792.00	38,550,240.00
000002	万 科A	06/12/25	07/12/27	10.50	10.62	3,000,000	31,500,000.00	31,860,000.00
601588	北辰实业	06/09/28	07/01/16	2.40	6.68	2,157,090	5,177,016.00	14,409,361.20
601628	中国人寿	06/12/28	预计07/04/09	18.88	18.88	584,325	11,032,056.00	11,032,056.00
002073	青岛软控	06/09/28	07/01/18	26.00	47.35	29,813	775,138.00	1,411,645.55
002076	雪莱特	06/10/12	07/01/25	6.86	18.77	32,558	223,347.88	611,113.66
002079	苏州固锝	06/11/01	07/02/16	6.39	10.28	53,560	342,248.40	550,596.80
合计							193,845,425.48	279,317,303.16

(c) 截至2006年12月31日止，本基金持有东方电机股份有限公司(以下简称“东方电机”)停市股票1,090,261股，按2006年12月19日收盘价每股27.10元计算，估值为29,546,073.10元。东方电机因将有重大信息进行披露于2006年12月20日起连续停牌。东方电机在拟向公司控股股东中国东方电气集团公司购买资产并非公开发行股票的议案获得东方电机董事会审议通过后于2007年2月5日复牌，复牌后首日上市开盘价为29.81元。

第八节 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	占基金资产总值比例
股 票	1,237,477,073.24	70.85%
债 券	143,703,761.13	8.23%
银行存款及清算备付金合计	352,804,489.86	20.20%
应收证券清算款	637,173.27	0.03%
权 证	6,774,579.00	0.39%
其他资产	5,208,157.84	0.30%
资产合计	1,746,605,234.34	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	0.00	0.00%
B 采掘业	114,789,285.18	6.74%
C 制造业	273,515,513.01	16.05%
C0 食品、饮料	23,143,389.84	1.36%
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	0.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5 电子	30,405,352.76	1.78%
C6 金属、非金属	100,657,925.22	5.91%
C7 机械、设备、仪表	119,308,845.19	7.00%
C8 医药、生物制品	0.00	0.00%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	22,573,800.00	1.32%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	125,897,964.58	7.39%
G 信息技术业	85,737,542.39	5.03%
H 批发和零售贸易	38,544,833.34	2.26%
I 金融、保险业	376,941,518.22	22.12%
J 房地产业	46,269,361.20	2.71%
K 社会服务业	23,393,233.28	1.37%
L 传播与文化产业	11,934,125.84	0.70%
M 综合类	117,879,896.20	6.92%
合计	1,237,477,073.24	72.61%

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)	期末市值（元）	市值占基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	17,799,905	110,359,411.00	6.48%
2	600016	民生银行	9,189,976	93,737,755.20	5.50%
3	000793	华闻传媒	10,000,000	90,200,000.00	5.29%
4	601988	中国银行	16,504,965	89,621,959.95	5.26%
5	600028	中国石化	9,610,979	87,652,128.48	5.14%
6	600797	浙大网新	10,000,000	64,900,000.00	3.81%
7	600550	天威保变	2,800,000	51,100,000.00	3.00%
8	600000	浦发银行	1,999,997	42,619,936.07	2.50%
9	601006	大秦铁路	4,959,300	40,170,330.00	2.36%
10	601333	广深铁路	5,354,200	38,550,240.00	2.26%

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站（www.hftfund.com）的年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

（一）报告期内累计买入价值超出期末基金资产净值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）	占期末基金资产净值的比例
1	600028	中国石化	173,114,373.68	10.16%
2	601398	工商银行	170,989,774.36	10.03%
3	600016	民生银行	168,303,403.98	9.88%
4	601988	中国银行	143,463,104.40	8.42%
5	600797	浙大网新	140,658,388.99	8.25%
6	000793	华闻传媒	118,336,497.77	6.94%
7	600000	浦发银行	96,468,222.85	5.66%
8	000858	五 粮 液	89,195,913.33	5.23%
9	000825	太钢不锈	85,448,548.20	5.01%
10	600050	中国联通	85,072,850.23	4.99%
11	601006	大秦铁路	71,431,470.00	4.19%
12	600019	宝钢股份	62,906,026.69	3.69%
13	600005	武钢股份	59,966,671.63	3.52%
14	600030	中信证券	56,943,182.17	3.34%
15	000002	万 科A	52,596,896.23	3.09%
16	600717	天津港	50,895,588.34	2.99%
17	600550	天威保变	49,280,000.00	2.89%
18	600583	海油工程	43,525,153.83	2.55%
19	600875	东方电机	41,127,051.84	2.41%
20	600037	歌华有线	38,893,517.67	2.28%
21	600269	赣粤高速	37,268,736.56	2.19%
22	600697	欧亚集团	34,043,184.60	2.00%

（二）报告期内累计卖出价值超出期末基金资产净值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）	占期末基金资产净值的比例
1	600028	中国石化	124,907,608.31	7.33%
2	600016	民生银行	121,838,390.34	7.15%
3	601398	工商银行	105,241,339.57	6.18%
4	601988	中国银行	105,231,571.97	6.17%
5	600050	中国联通	104,373,678.49	6.12%
6	000858	五 粮 液	96,586,977.86	5.67%
7	600797	浙大网新	95,053,051.19	5.58%
8	000825	太钢不锈	80,675,749.01	4.73%
9	600019	宝钢股份	78,207,381.41	4.59%
10	600000	浦发银行	65,562,244.02	3.85%
11	601006	大秦铁路	65,042,946.76	3.82%
12	600583	海油工程	54,191,766.69	3.18%
13	000793	华闻传媒	50,890,181.82	2.99%
14	600037	歌华有线	46,420,836.85	2.72%
15	600717	天津港	44,576,203.20	2.62%
16	600030	中信证券	38,560,595.21	2.26%
17	600519	贵州茅台	37,192,618.55	2.18%
18	000402	金 融 街	36,880,019.05	2.16%
19	600195	中牧股份	35,511,800.97	2.08%
20	000709	唐钢股份	35,314,949.50	2.07%
21	000002	万 科A	34,482,561.12	2.02%

（三）报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本总额	卖出股票收入总额
3,081,229,748.08	2,394,915,046.62

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	94,726,669.90	5.56%
2	金融债券	0.00	0.00%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	企业债	48,977,091.23	2.87%
	合 计	143,703,761.13	8.43%

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）	市值占基金资产净值比例
1	20国债(0)	64,576,669.90	3.79%
2	02国债(4)	30,150,000.00	1.77%
3	06美兰CP02	28,929,875.34	1.70%
4	06澜沧江CP02	20,047,215.89	1.17%

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