海富通股票证券投资基金 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 30 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：	海富通股票
2、基金交易代码：	519005
3、基金运作方式：	契约型开放式
4、基金合同生效日：	2005年 7 月 29 日
5、报告期末基金份额总额：	3,401,537,455.75 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：	精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合，分享中国经济高速成长的成果，谋求基金资产的长期最大化增值。
2、投资策略：	本基金采用双层次的投资策略：第一层次主要通过对股票市场的系统性风险进行分析，确定股票和现金资产的配置比例；第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究，精选适合本投资组合风险收益特征的股票。
3、业绩比较基准：	上证综合指数×80%＋上证国债指数×20%
4、风险收益特征：	本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的股票型基金产品。
（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：	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：	010－66594977
4、传真：	010－66594942
5、电子邮箱：	tgxxpl@bank-of-china.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	2005年	2006年
1	基金本期净收益(元)	1,200,650.76	639,713,766.47
2	基金份额本期净收益(元)	0.0015	0.8388
3	期末可供分配基金收益(元)	-5,283,845.83	30,525,397.06
4	期末可供分配基金份额收益(元)	-0.0050	0.0090
5	期末基金资产净值(元)	1,048,837,086.96	3,632,118,772.65
6	期末基金份额净值(元)	0.995	1.068
7	基金加权平均净值收益率	0.15%	63.89%
8	本期基金份额净值增长率	-0.50%	131.41%
9	基金份额累计净值增长率	-0.50%	130.25%

注：本基金合同生效日为 2005 年 7 月 29 日，2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 7 月 29 日至 2005 年 12 月 31 日。

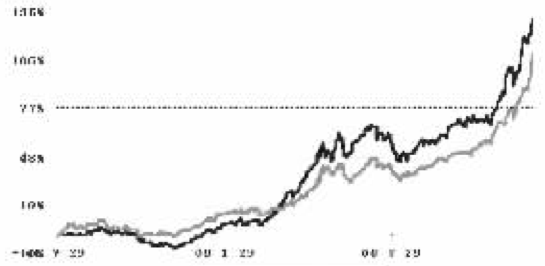
二、基金净值表现

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	39.12%	1.63%	41.23%	1.12%	-2.11%	0.51%
过去 6 个月	40.32%	1.48%	47.04%	1.07%	-6.72%	0.41%
过去 1 年	131.41%	1.44%	97.60%	1.09%	33.81%	0.35%
自基金合同生效起至今	130.25%	1.27%	109.17%	1.04%	21.08%	0.23%

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：

海富通股票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
（2005 年 7 月 29 日至 2006 年 12 月 31 日）



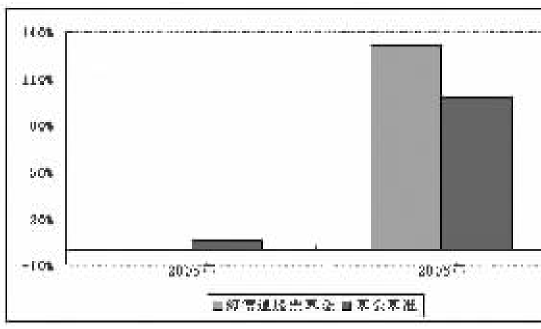
注：

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有关投资范围的规定，即股票资产 70%-95%，一年期以内的国家债券和现金的比例不低于 5%。同时满足第 14 章（七）有关投资组合限制的各项比例要求。

2、自 2006 年 9 月起，陈洪先生不再担任本基金基金经理；2007 年 2 月起，由蒋征先生兼任本基金基金经理。

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：

海富通股票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 2005 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 7 月 29 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（至少保留三位小数）	备注
2005年	0.00	
2006年	10.30	（a）
合计	10.30	

(a) 2006 年度，本基金于 2 月 13 日、4 月 7 日、5 月 12 日、12 月 14 日，发布第一、二、三、四次分红预告，分别向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.25、0.35、0.50、9.20 元，共计 10.30 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。本海富通股票证券投资基金是基金管理人管理的第四只开放式基金；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、海富通强化回报混合型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

郑拓先生，CFA，美国芝加哥大学 MBA。历任君安证券公司黑龙江公司投资经理，广达投资公司投资经理，加拿大 Donier International 企业融资经理，美国 Robert W. Baird 投资银行基金分析师。2003 年 7 月加入海富通基金管理公司，任投资部股票分析师、海富通精选基金经理助理。2005 年 4 月至 2006 年 9 月任海富通精选基金经理，2006 年 5 月至 2006 年 9 月任海富通强化回报基金基金经理，2005 年 7 月至今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，郑拓先生因个人工作变动的原因不再担任本基金基金经理。

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。

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、《海富通股票证券投资基金基金合同》、《海富通股票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。二零零六年是海富通股票基金完整运作的第一年，我们在世界分工和国际经济结构调整的大背景下，深入研究国际及国内经济发展趋势、政策导向和市场环境等因素，及时把握中国经济发展的主要脉络，发掘处于不同景气周期中的相关上市公司的投资价值，精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合，分享中国经济高速成长的成果，基金的投资取得了一定的效果，基本实现了产品所要求的风险收益特征，并在逐步形成自己的风格。

截止本报告期末，本基金份额净值为 1.068 元，累计净值为 2.098 元。报告期内，基金净值增长了 131.41%，而同期基金业绩比较基准上升 97.60%，基金净值跑赢业绩比较基准 33.81%。

本报告期内本基金未出现投资非公开发行股票的情况。

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。我们将继续坚持精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合的方法，对基金资产进行管理。

第五节 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”）在对海富通股票证券投资基金（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。

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股票证券投资基金 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 20191 号）。

第七节 财务会计报告

一、基金会计报表

（一）资产负债表

	附注	2006年 12 月 31 日	2005年 12 月 31 日
资产			
银行存款		781,023,210.58	113,490,224.92
结算备付金		1,148,310.65	866,190.19
交易保证金	14	638,549.12	420,035.35
应收证券清算款		0.00	4,775,833.79
应收利息	1	808,873.00	46,393.70
应收申购款		199,033,695.68	266,060.13
股票投资市值		2,673,111,720.72	887,519,017.45
其中：股票投资成本		2,427,952,672.07	888,578,382.82
债券投资市值		150,048,389.20	6,000,000.00
其中：债券投资成本		149,818,079.30	6,000,000.00
权证投资市值		41,832,601.50	0.00
其中：权证投资成本		36,000,117.65	0.00
买入返售证券		0.00	44,200,000.00
资产总计		3,847,645,350.45	1,057,583,755.53
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		201,424,553.02	3,189,531.00
应付赎回款		7,664,978.76	3,154,151.37
应付赎回费		18,321.33	8,296.26
应付管理人报酬		2,048,217.33	1,244,196.43
应付托管费		341,369.54	207,366.08
应付佣金	3	2,988,944.11	498,526.72
其他应付款	4	500,000.00	250,000.00
预提费用	5	540,193.71	194,600.71
负债合计		215,526,577.80	8,746,668.57
持有人权益			
实收基金	6	3,401,537,455.75	1,054,120,932.79
未实现利得 /(损失)	7	200,055,919.84	(6,248,477.15)
未分配基金净收益		30,525,397.06	964,631.32
持有人权益合计		3,632,118,772.65	1,048,837,086.96
(2006 年末基金份额资产净值：1.068 元)			
(2005 年末基金份额资产净值：0.995 元)			
负债及持有人权益总计		3,847,645,350.45	1,057,583,755.53
后附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

	附注	2006年度	2005 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2005 年 12月 31 日止期间
收入			
股票差价收入	8	619,968,045.94	1,445,481.13
债券差价收入	9	4,817,200.38	0.00
权证差价收入	10	21,335,694.78	4,203,073.40
债券利息收入		633,504.88	0.00
存款利息收入		1,449,743.18	684,913.96
股利收入		8,303,363.77	677,485.04
买入返售证券收入		205,336.23	9,370.84
其他收入	11	1,245,188.64	190,552.61
收入合计		657,958,077.80	7,210,876.98
费用			
基金管理人报酬		(15,031,730.78)	(4,983,550.45)
基金托管费		(2,505,288.37)	(830,591.80)
卖出回购证券支出		(272,836.44)	0.00
其他费用	12	(434,455.74)	(196,083.97)
其中：信息披露费		(324,093.00)	(136,100.71)
审计费用		(80,000.00)	(58,500.00)
费用合计		(18,244,311.33)	(6,010,226.22)
基金净收益		639,713,766.47	1,200,650.76
加：未实现估值增值 /(减值)变动数		252,281,207.77	(1,059,365.37)
基金经营业绩		891,994,974.24	141,285.39
基金净收益		639,713,766.47	1,200,650.76
加：年 / 期初基金净收益		964,631.32	0.00
本年 / 期申购基金份额的损益平准金		83,184,880.97	(458,106.52)
本年 / 期赎回基金份额的损益平准金		(89,707,319.10)	222,087.08
可供分配基金净收益		634,155,959.66	964,631.32
减：本年 / 期已分配基金净收益	13	(603,630,562.60)	0.00
未分配基金净收益		30,525,397.06	964,631.32
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

		2006年度	2005 年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2005 年 12月 31 日止期间
年 / 期初基金净值		1,048,837,086.96	419,612,160.22
本年 / 期经营活动			
基金净收益		639,713,766.47	1,200,650.76
未实现估值增值 /(减值)变动数		252,281,207.77	(1,059,365.37)
经营活动产生的基金净值变动数		891,994,974.24	141,285.39
本年 / 期基金份额交易			
基金申购款		4,007,792,932.71	846,985,266.68
其中：分红再投资		185,202,819.45	0.00
基金赎回款		(1,712,875,658.66)	(217,901,625.33)
基金份额交易产生的基金净值变动数		2,294,917,274.05	629,083,641.35
本年 / 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 13		(603,630,562.60)	0.00
年 / 期末基金净值		3,632,118,772.65	1,048,837,086.96
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

（一）本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计除下述变更外与上年度会计报表相一致：

2006 年 11 月 13 日之前取得的由于定向增发形成的暂时流通受限股票，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，自 2006 年 11 月 13 日起取得的由于定向增发行成的暂时流通受限股票，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于定向增发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定向增发股票的初始投资成本，按定向增发股票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。

（二）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。

（三）关联方关系及关联方交易

(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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2006年度			
	买卖股票成交量		交易佣金	
	成交量 人民币元	占全年成交量的比例	佣金 人民币元	占全年佣金总量的比例
海通证券	639,112,570.21	10.05%	523,568.65	10.09%
	2005年 7 月 29 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日止期间			
	买卖股票成交量		交易佣金	
	成交量 人民币元	占全年成交量的比例	佣金 人民币元	占全年佣金总量的比例
海通证券	440,832,070.80	33.49%	365,361.65	34.11%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担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。

(c)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。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 15,031,730.78 元(2005 年：4,983,550.45 元)。

(d)基金托管费

支付基金托管人中国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。

本基金在本年度需支付基金托管费 2,505,288.37 元(2005 年：830,591.80 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中国银行保管，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 781,023,210.58 元(2005 年：113,490,224.92 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,424,800.29 元(2005 年：671,368.37 元)。

(f) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券交易

本基金在本年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年 7 月 29 日（基金合同生效日）至 2005 年 12 月 31 日止期间
卖出债券结算金额	10,292,717.81	-
卖出回购证券协议金额	49,600,000.00	-
卖出回购证券利息支出	18,061.91	-

(g) 最近二个年度内本基金各关联方均无投资本基金的情况

（四）报告期末流通转让受到限制的基金资产

(a) 流通受限制不能自由转让的股票

(1) 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：								
000549	S 湘火炬	06/12/19	8.90	未知	未知	196,100	1,648,574.03	1,745,290.00
合 计							1,648,574.03	1,745,290.00

(2) 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	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.10	638,060	3,158,397.00	5,168,286.00
601333	广深铁路	06/12/18	07/03/22	3.76	7.20	591,780	2,225,092.80	4,260,816.00
601588	北辰实业	06/09/28	07/01/16	2.40	6.68	539,272	1,294,252.80	3,602,336.96
601628	中国人寿	06/12/28	预计 07/04/09	18.88	18.88	771,750	14,570,640.00	14,570,640.00
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	237,000	4,474,560.00	4,474,560.00
002073	青岛软控	06/09/28	07/01/18	26.00	47.35	29,813	775,138.00	1,411,645.55
002079	苏州固锝	06/11/01	07/02/16	6.39	10.28	53,560	342,248.40	550,596.80
600550	天威保变	06/06/08	发行结束日起 12 个月	17.60	18.25	1,200,000	21,120,000.00	21,900,000.00
合计							47,960,329.00	55,938,881.31

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	2,673,111,720.72	69.47%
债 券	150,048,389.20	3.90%
银行存款及清算备付金合计	782,171,521.23	20.33%
应收证券清算款	0.00	0.00%
权证	41,832,601.50	1.09%
资产支持证券	0.00	0%
其他资产	200,481,117.80	5.21%
资产合计	3,847,645,350.45	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	219,152,399.61	6.03%
C 制造业	955,513,479.31	26.31%
C0 食品、饮料	306,477,390.70	8.44%
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	8,075,893.00	0.22%
C5 电子	3,245,828.90	0.09%
C6 金属、非金属	115,907,324.66	3.19%
C7 机械、设备、仪表	471,929,865.68	12.99%
C8 医药、生物制品	49,877,176.37	1.38%
C99 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	49,542,200.00	1.36%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	198,927,449.91	5.48%
G 信息技术业	34,407,740.80	0.95%
H 批发和零售贸易	201,975,066.63	5.56%
I 金融、保险业	491,730,652.52	13.54%
J 房地产业	235,103,649.52	6.47%
K 社会服务业	16,794,852.02	0.46%
L 传播与文化产业	54,692,000.00	1.51%
M 综合类	215,272,230.40	5.93%
合计	2,673,111,720.72	73.60%

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	000858	五 粮 液	8,972,204	205,014,861.40	5.64%
2	000793	华闻传媒	18,130,000	163,532,600.00	4.50%
3	601398	工商银行	23,020,520	142,727,224.00	3.93%
4	000002	万 科 A	7,999,996	123,519,938.24	3.40%
5	600030	中信证券	4,424,842	121,152,173.96	3.34%
6	000157	中联重科	4,879,356	108,468,083.88	2.99%
7	600016	民生银行	10,030,000	102,306,000.00	2.82%
8	600616	第一食品	6,869,942	95,492,193.80	2.63%
9	600019	宝钢股份	10,582,601	91,645,324.66	2.52%
10	600428	中远航运	7,971,648	86,651,813.76	2.39%

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）	占期初基金资产净值的比例
1	000858	五 粮 液	189,889,634.55	18.10%
2	000002	万 科 A	184,732,534.88	17.61%
3	000793	华闻传媒	155,210,675.60	14.80%
4	600030	中信证券	125,511,463.66	11.97%
5	600016	民生银行	125,456,563.47	11.96%
6	600616	第一食品	119,065,674.48	11.35%
7	600019	宝钢股份	117,524,865.85	11.21%
8	601398	工商银行	107,844,049.64	10.28%
9	000157	中联重科	105,173,093.19	10.03%
10	600123	兰花科创	103,104,068.96	9.83%
11	600428	中远航运	94,153,724.64	8.98%
12	000024	招商地产	93,389,888.69	8.90%
13	000528	柳 工	92,731,055.17	8.84%
14	600036	招商银行	91,954,064.83	8.77%
15	600879	火箭股份	81,903,042.78	7.81%
16	601699	潞安环能	78,949,991.51	7.53%
17	600028	中国石化	74,087,608.33	7.06%
18	600195	中牧股份	70,528,280.88	6.72%
19	601006	大秦铁路	68,747,499.49	6.55%
20	600000	浦发银行	67,855,127.60	6.47%
21	600037	歌华有线	67,113,777.70	6.40%
22	600835	上海机电	50,536,847.44	4.82%
23	000538	云南白药	48,586,662.23	4.63%
24	600895	张江高科	48,528,281.10	4.63%
25	600690	青岛海尔	46,613,782.29	4.44%
26	600787	中储股份	44,916,699.76	4.28%
27	600550	天威保变	42,817,721.65	4.08%
28	600031	三一重工	41,633,170.86	3.97%
29	000060	中金岭南	38,278,984.26	3.65%
30	600639	浦东金桥	37,307,413.29	3.56%
31	600859	王府井	35,123,407.92	3.35%
32	000625	长安汽车	33,609,541.08	3.20%
33	600754	锦江股份	32,121,655.55	3.06%
34	600383	金地集团	32,071,194.62	3.06%
35	600729	重庆百货	31,609,854.26	3.01%
36	600009	上海机场	31,032,990.20	2.96%
37	000837	秦川发展	26,159,879.83	2.49%
38	600269	赣粤高速	25,184,956.64	2.40%
39	600900	长江电力	24,982,552.86	2.38%
40	600519	贵州茅台	24,891,748.86	2.37%
41	600435	北方天鸟	24,886,028.22	2.37%
42	600583	海油工程	23,835,727.64	2.27%
43	600797	浙大网新	23,580,799.31	2.25%
44	000501	鄂武商 A	22,421,351.03	2.14%
45	000099	中信海直	22,264,365.13	2.12%
46	600886	国投电力	22,141,076.85	2.11%
47	600312	平高电气	21,698,889.15	2.07%

（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）	占期初基金资产净值的比例
1	600583	海油工程	119,227,164.78	11.37%
2	000002	万 科 A	115,808,644.83	11.04%
3	600519	贵州茅台	111,269,586.92	10.61%
4	000858	五 粮 液	108,625,008.16	10.36%
5	600036	招商银行	76,812,558.22	7.32%
6	600123	兰花科创	67,049,598.43	6.39%
7	600406	国电南瑞	64,404,182.76	6.14%
8	600787	中储股份	63,495,141.07	6.05%
9	600754	锦江股份	61,635,982.94	5.88%
10	000538	云南白药	60,418,933.09	5.76%
11	600019	宝钢股份	57,466,050.42	5.48%
12	000024	招商地产	56,595,507.62	5.40%
13	600125	铁龙物流	54,087,908.09	5.16%
14	600000	浦发银行	51,082,495.80	4.87%
15	600009	上海机场	48,927,572.08	4.66%
16	600761	安徽合力	47,880,205.66	4.57%
17	000528	柳 工	44,668,507.51	4.26%
18	600628	新世界	44,156,773.60	4.21%
19	600028	中国石化	41,013,865.28	3.91%
20	000602	金马集团	38,551,602.10	3.68%
21	000837	秦川发展	38,547,736.85	3.68%
22	600550	天威保变	35,179,209.50	3.35%
23	600348	国阳新能	35,130,599.55	3.35%
24	600016	民生银行	33,899,813.77	3.23%
25	002007	华兰生物	32,984,514.55	3.14%
26	600435	北方天鸟	31,638,294.30	3.02%
27	600639	浦东金桥	30,629,792.02	2.92%
28	600875	东方电机	29,815,479.58	2.84%
29	600161	天坛生物	29,760,470.56	2.84%
30	600811	东方集团	28,149,312.17	2.68%
31	600327	大厦股份	27,541,517.88	2.63%
32	600256	广汇股份	27,503,550.46	2.62%
33	000402	金 融 街	27,211,180.54	2.59%
34	600729	重庆百货	27,176,526.22	2.59%
35	600033	福建高速	26,943,254.78	2.57%
36	000900	现代投资	26,818,007.82	2.56%
37	600008	首创股份	26,720,065.31	2.55%
38	600276	恒瑞医药	26,180,935.36	2.50%
39	600361	华联综超	25,241,659.88	2.41%
40	600616	第一食品	24,913,092.34	2.38%
41	600030	中信证券	24,881,451.23	2.37%
42	600037	歌华有线	23,755,230.51	2.26%
43	600900	长江电力	22,505,315.34	2.15%
44	600688	S上石化	22,091,296.55	2.11%
45	600717	天津港	21,986,872.53	2.10%
46	000997	新 大 陆	21,887,000.30	2.09%
47	000501	鄂武商 A	21,838,843.32	2.08%
48	000099	中信海直	21,256,817.20	2.03%

（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
3,678,281,664.12	2,752,376,885.16

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	150,048,389.20	4.13%
	合 计	150,048,389.20	4.13%

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⑽	99,798,389.20	2.75%
2	02国债⒁	50,250,000.00	1.38%

七、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细。

无。

八、报告期末本基金投资权证明细

序号	权证代码	权证名称	投资类别	成本	数量（份）	市值（元）	占基金资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	被动持有	0.00	40,000.00	580,000.00	0.02%
2	030002	五粮 YGC1	主动持有	36,000,117.65	2,845,007.00	41,252,601.50	1.13%

九、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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、基金其他资产的构成

其他资产	金额
交易保证金	638,549.12
应收股利	0.00
应收利息	808,873.00
应收申购款	199,033,695.68
其他应收款	0.00
买入返售证券	0.00
合计	200,481,117.80

4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6、基金在报告期内的权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	投资类别	成本	数量（份）	期末持有数量（份）
1	030002	五粮 YGC1	被动持有	0.00	1,540,500.00	40,000.00
2	030002	五粮 YGC1	主动持有	36,000,117.65	2,845,007.00	2,845,007.00
3	038004	五粮 YGP1	被动持有	0.00	1,619,500.00	0.00
4	580005	万华 HXB1	被动持有	0.00	45,171.00	0.00
5	580993	万华 HXP1	被动持有	0.00	67,756.00	0.00
6	580990	茅台 JCP1	被动持有	0.00	2,240,000.00	0.00
7	580996	沪场 JTP1	被动持有	0.00	1,500,000.00	0.00
8	580997	招行 CMP1	被动持有	0.00	1,541,814.00	0.00

第九节 基金份额持有人情况

一、报告期末基金份额持有人户数

报告期末基金份额持有人户数：	87,370
报告期末平均每户持有的基金份额：	38,932.56

二、报告期末基金份额持有人结构

项目	数量	占总份额的比例
基金份额总额：	3,401,537,455.75	100%
其中：机构投资者持有的基金份额	562,093,603.52	16.52%
个人投资者持有的基金份额	2,839,443,852.23	83.48%

第十一节 开放式基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

单位：份

基金合同生效日的基金份额总额	419,612,160.22
本报告期期初基金份额总额	1,054,120,932.79
本报告期期间总申购份额	3,735,718,413.86
本报告期期间总赎回份额	1,388,301,890.90
本报告期期末基金份额总额	3,401,537,455.75

第十二节 重大事件揭示

1、本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

2、基金管理人、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动。

2006年 5 月 27 日，基金管理人海富通基金管理有限公司（“本公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布关于副总经理的任命公告，决定聘请陈洪、阎小庆先生担任本公司副总经理。

2006 年 8 月 19 日，基金管理人海富通基金管理有限公司（“本公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布关于缪钧伟先生不再担任本公司副总经理的公告。

2007 年 1 月 12 日，基金管理人海富通基金管理有限公司（“本公司”）在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上公告称，经公司董事会审议通过，同意杨玉良先生因工作需要辞去本公司独立董事职务，聘请杨国平先生继任本公司独立董事。

3、本基金的管理人、基金财产、基金托管业务报告期内无诉讼事项。

4、报告期内本基金投资策略未发生改变。

5、基金收益分配事项

本基金分别于 2 月 16 日、4 月 12 日、5 月 17 日和 12 月 19 日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布第一、第二、第三和第四次分红预告，分别向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.25、0.35、0.50 和 9.20 元，共计 10.30 元。

6、报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度支付的审计费用是 11.8 万元。

7、本基金的管理人、托管人、托管部门及其高级管理人员报告期内未受监管部门的稽查或处罚。

8、报告期内本基金增加了中信证券股份有限公司和光大证券股份有限公司专用交易席位，情况如下：

代号	券商名称	席位数量	股票成交金额（元）	占股票成交总额	债券成交金额（元）	占债券成交总额的
1	海通证券	1	639,112,570.21	10.05%	0.00	0.00%
2	招商证券	1	846,231,899.71	13.30%	0.00	0.00%
3	国泰君安	1	139,341,707.10	2.19%	0.00	0.00%
4	国信证券	1	1,688,219,203.46	26.53%	100,391,052.20	62.61%
5	中信证券	1	1,800,939,002.02	28.31%	49,419,509.70	30.82%
6	光大证券	1	1,248,167,414.70	19.62%	10,529,007.60	6.57%
	合计		6,362,011,797.20	100.00%	160,339,569.50	100.00%

代号	券商名称	债券回购成交金额（元）	占债券回购成交总额	权证成交金额（元）	占权证成交总额的	实付佣金（元）	实付佣金比率
1	海通证券	50,000,000.00	20.83%	0.00	0.00%	523,568.65	10.09%
2	招商证券	0.00	0.00%	38,359,636.21	66.92%	696,704.73	13.43%
3	国泰君安	100,000,000.00	41.67%	0.00	0.00%	113,260.11	2.18%
4	国信证券	90,000,000.00	37.50%	9,567,451.14	16.69%	1,391,701.03	26.83%
5	中信证券	0.00	0.00%	924,886.02	1.61%	1,477,124.74	28.48%
6	光大证券	0.00	0.00%	8,469,231.99	14.78%	984,323.03	18.98%
	合计	240,000,000.00	100.00%	57,321,205.36	100.00%	5,186,682.29	100.00%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

（1）专用席位的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉评估、研究水平评估和综合服务支持评估三个部分进行打分，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及专用席位租用意见。

（2）专用席位的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行专用席位的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门会议讨论，形成重点评估的证券公司备选池，从中进行甄选。原则上，备选池中的证券公司个数不得少于最后选择个数的 200%。

<2> 甄选。由投资部全体业务人员遵照《海富通基金管理有限公司证券公司评估系统》的规定，进行主观性评议，独立的评分，形成证券公司排名及专用席位租用意见，经公司业务管理委员会同意后，报董事会核准。

<3> 核准。在完成对证券公司的初步评估、甄选和审核后，由基金管理人的董事会核准。

9、其他在报告期内发生的的重大事件，以及基金管理人判断为重大事件的事项。

(1.) 2006 年 1 月 17 日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通基金管理有限公司关于旗下基金代销机构华夏证券变更为中信建投证券的公告。

(2.) 2006 年 1 月 17 日、4 月 21 日、6 月 13 日本基金的管理人海富通基金管理有限公司就增加中银国际证券有限责任公司、深圳发展银行、招商银行股份有限公司为本基金的代销机构在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登公告。

(3.) 2006 年 1 月 18 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了《关于推出旗下海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金和海富通股票证券投资基金之间优惠转换费率的公告》。

(4.) 2006 年 1 月 24 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通基金管理有限公司关于旗下基金投资重庆市城市建设投资公司企业债券的公告。

(5.) 2006 年 2 月 22 日，本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了增加注册资本和变更股东出资比例的公告，海富通基金管理有限公司的注册资本由人民币 1 亿元增加至人民币 1.5 亿元，双方的出资比例从原来的 67%：33%变更为 51%：49%。

(6.) 2006 年 3 月 15 日、9 月 14 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登《海富通股票证券投资基金更新招募说明书》。

(7.) 2006 年 6 月 16 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于推出旗下基金优惠申购和转换费率的公告。

(8.) 2006 年 7 月 25 日、7 月 26 日，10 月 9 日和 10 月 25 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上分别刊登了关于旗下基金申购横店东磁、保利地产、北辰实业和工商银行的公告。

(9.) 2006 年 9 月 6 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于旗下基金增加定期定额申购业务代销机构的公告。

(10.) 2006 年 9 月 26 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于调整基金经理的公告。

(11.) 2006 年 12 月 14 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了海富通股票证券投资基金第四次分红预告与暂停申购及转入业务公告。

(12.) 2007 年 1 月 11 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于调整旗下部分基金股票部分业绩比较基准的公告，本基金原比较基准中的上证指数将自 2007 年 1 月 1 日起调整为 MSCI China A 指数，相应的基准权重不变。

(13.) 2007 年 3 月 10 日，本基金的基金管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了变更基金经理的公告，郑拓先生因个人工作变动的原因不再担任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的基金经理。

第十二节 备查文件

一、备查文件目录：

（一）中国证券监督管理委员会批准设立海富通股票证券投资基金的文件

（二）海富通股票证券投资基金基金合同

（三）海富通股票证券投资基金招募说明书

（四）海富通股票证券投资基金托管协议

（五）中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件

（六）报告期内海富通股票证券投资基金在指定报刊上披露的各项公告

二、存放地点：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 37 楼基金管理人办公地址。

三、查阅方式：投资者可于营业时间查阅，或登录基金管理人网站查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人海富通基金管理有限公司。

客户服务中心电话：021-38784858；40088-40099

网址：www.hftfund.com

海富通基金管理有限公司
二〇〇七年三月三十一日