海富通精选证券投资基金 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。本年度报告已经董事会全体董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人交通银行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、基金简称：海富通精选

交易代码：519011

运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2003年8月22日

报告期末基金份额总额：1,159,648,444.87份

二、基金投资目标：本基金采取积极主动精选证券和适度主动进行资产配置的投资策略，实施全程风险管理，在保证资产良好流动性的前提下，在一定风险限度内实现基金资产的长期最大化增值。

基金投资策略：本基金的投资策略分两个层次：第一层次为适度主动的资产配置，以控制或规避市场系统性风险；第二层次为积极主动的精选证券，以分散或规避个券风险。积极主动精选证券是本基金投资策略的重点。

业绩比较基准：上证综合指数×65％＋上证国债指数×35％

风险收益特征：本基金属于证券投资基金中风险程度适中的品种。本基金力争通过适度主动的资产配置和积极主动的精选证券，识别和控制风险，实现风险限度内的超额回报。

三、基金管理人：海富通基金管理有限公司

信息披露负责人：奚万荣

联系电话：021-50471758-591

传真：021-50479057

电子邮箱：wrxi@hftfund.com

四、基金托管人：交通银行股份有限公司

信息披露负责人：张咏东

联系电话：021-68888917

传真：021-58408836

电子邮箱：zhangyd@bankcomm.com

五、登载本报告正文的基金管理人互联网网址：http://www.hftfund.com

本报告置备地点：基金管理人及基金托管人的住所

第三节 主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

一、主要财务指标

		2006年度	2005年度	2004年度
1	基金本期净收益(人民币)	1,206,590,668.09	119,199,907.36	235,832,127.66
2	加权平均基金份额本期净收益(人民币)	0.7647	0.0456	0.0957
3	期末可供分配基金份额收益(人民币)	0.6563	0.0007	-0.0113
4	期末基金资产净值(人民币)	2,377,271,433.63	2,510,541,600.15	2,815,902,681.89
5	期末基金份额净值(人民币)	2.0500	1.0795	1.0299
6	本期基金份额净值增长率	118.08%	8.48%	4.50%

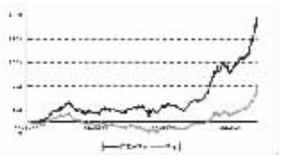
注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等)，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

二、基金净值表现

1、 本基金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	34.48%	1.17%	32.97%	0.92%	1.51%	0.25%
过去6个月	39.25%	1.14%	37.75%	0.88%	1.50%	0.26%
过去1年	118.08%	1.10%	75.60%	0.89%	42.48%	0.21%
过去3年	147.21%	1.01%	55.33%	0.89%	91.88%	0.12%
自基金合同生效起至今	176.93%	0.97%	58.12%	0.87%	118.81%	0.10%

2、本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图：



注：按照本基金合同规定，本基金自2003年8月22日合同生效日起至2004年2月22日为建仓期。建仓期满至今，本基金投资组合均达到本基金合同第十八条（三）、（六）规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3、本基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

注：图中列示的2003年度的基金净值增长率按该年度实际存续期8月22日（基金合同生效日）起至12月31日止计算。

4、自基金合同生效以来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
2003	0.150	(a)
2004	1.250	(b)
2005	0.350	(c)
2006	1.750	(d)
合计	3.500	

(a) 2003年度，本基金于12月12日发布第一次分红预告，向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.15元；

(b) 2004年度，本基金分别于2月9日、6月21日、12月7日发布第二、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0.30、0.45、0.50元，共计1.25元；

(c) 2005年度，本基金分别于6月15日、12月6日发布第五、六次分红预告，分别向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.20、0.15元，共计0.35元；

(d) 2006年度，本基金分别于1月25日、4月12日、5月12日发布第七、八、九次分红公告，分别向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.25、0.80、0.70元，共计1.75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。本海富通精选证券投资基金是基金管理人管理的第一只开放式基金；除本基金外，基金管理人目前还管理着海富通收益增长证券投资基金、海富通股票证券投资基金、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

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经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司投资总监兼海富通精选基金基金经理，2005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月任海富通收益增长基金基金经理，2006年5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。

二、合规性报告

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、《海富通精选证券投资基金基金合同》、《海富通精选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

二零零六年是中国证券市场具有历史转折性的一年，困扰市场已久的股权分置问题得到了根本解决，伴随着宏观经济的持续高速增长和极其充沛的流动性，A股市场迎来了久违的单边牛市行情，市场各类参与者的熊市心态得到彻底扭转，市场信心和活跃度大大提高。一批优质蓝筹公司如工商银行、中国人寿、大秦铁路等的成功发行上市，为A股市场注入了新鲜血液，市场出现期待已久的良性循环。A股市场贯穿全年的上涨行情催生了基金的财富效应，不仅大大促发了储蓄资金向证券基金的分流，同时也让基金奉行的价值发现理念得到了市场普遍认同。二零零六年上证综指上涨130.43％，且一举突破了二零零六年的历史高点2245点。在天相各行业指数中，食品（+231.05％）、金融（+204.68％）、有色（+186.75％）、房地产（+157.15％）、机械（+152.28％）、石油（+144.12％）、石化（+137.76％）涨幅超过了上证综指，表现最差的电力行业整体涨幅也达到了+45.33％。至于债券市场，二零零六年经历了人民银行2次加息和3次提高准备金，资金面的大起大落，CPI、贷款、投资、汇率一系列宏观经济指标的考验。债券市场一直在波动调整，收益率曲线扁平化加剧，海富通精选基金固定收益组合本年度一直保持低仓位短久期策略，配置哑铃式的组合。

二零零六年海富通精选基金继续坚持“控制资产配置风险、保持投资组合的均衡和流动性、通过个股选择创造超额收益”的基本投资策略，并根据二零零六年市场特征重点选择具有持续增长潜力且估值空间存在提高空间的公司持有，取得一定成效。

报告期内，海富通精选基金净值上涨118.08％，同期业绩基准上涨75.60％，超额收益为+42.48％。

四、简要展望

展望二零零七年，中国证券市场依然还存在一些不确定性因素，主要包括中国宏观经济如投资和出口的增速、政府宏观调控政策、全流通后非流通股减持压力、上市公司管理层股权激励实施进度等等。对A股市场而言，经过二零零六年持续上涨后，整体市场特别是部分优质蓝筹估值难言便宜。但考虑到中国宏观经济有望继续保持高速增长、全流通后非流通股东和流通股东利益趋于一致、管理层激励实施后的利润释放，A股市场整体利润增长依然会保持较高增速，甚至不排除超越市场预期的可能，从而为市场带来上涨动力。以此为背景，海富通的基本判断是A股市场在二零零七年震荡将有所加大，但向上趋势不会扭转。

预计二零零七年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业绩分化的主要诱因。海富通重点关注的投资主题包括消费；国家政策重点扶持的自主创新技术、节能、铁路建设等；全流通后的资产注入、并购等。以此为背景，海富通精选基金将继续保持资产配置的相对稳定，以主题投资和个股选择的线索，把握市场机会，争取创造更多的超额收益。

第五节 托管人报告

2006年，交通银行在海富通精选证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议，依法安全保管了基金的资产，勤勉尽责地履行了基金托管人的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

2006年，按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议，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精选证券投资基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值、基金份额净值和费用计算上进行了认真复核，未发现基金管理人有损害基金持有人的利益行为。

2006年，由海富通精选证券投资基金管理人——海富通基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关海富通精选证券投资基金的年度报告中财务指标、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、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精选证券投资基金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20188号）。

第七节 财务会计报告

一、经审计的会计报表

（一）资产负债表

海富通精选证券投资基金

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	2005年 12月31日
资产			
银行存款		167,402,073.81	12,024,340.27
结算备付金	5	10,614,367.29	107,457,572.86
交易保证金	5	1,359,609.61	1,312,500.00
应收证券清算款		89,892,078.03	10,446,412.26
应收利息	6	4,461,079.33	3,543,142.15
应收申购款		1,548,040.27	220,782.76
股票投资市值		1,604,452,728.71	1,859,474,473.34
其中：股票投资成本		947,658,729.36	1,709,997,420.36
债券投资市值		490,765,810.50	529,669,063.00
其中：债券投资成本		490,839,725.43	530,418,413.60
权证投资市值		19,824,139.00	0.00
其中：权证投资成本		17,174,901.66	0.00
资产总计		2,390,319,926.55	2,524,148,286.64
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		4,614,880.10	0.00
应付赎回款		1,931,833.88	7,600,761.32
应付赎回费		1,462.16	10,392.65
应付管理人报酬		2,900,334.80	3,182,429.51
应付托管费		483,389.14	530,404.92
应付佣金	7	1,942,605.24	1,108,710.49
其他应付款	8	733,987.60	733,987.60
预提费用	9	440,000.00	440,000.00
负债合计		13,048,492.92	13,606,686.49
持有人权益			
实收基金	10	1,159,648,444.87	2,325,708,828.22
未实现利得	11	456,562,557.99	183,316,171.71
未分配基金净收益		761,060,430.77	1,516,600.22
持有人权益合计		2,377,271,433.63	2,510,541,600.15
(2006年末基金份额资产净值：2.0500元)			
(2005年末基金份额资产净值：1.0795元)			
负债及持有人权益总计		2,390,319,926.55	2,524,148,286.64

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

海富通精选证券投资基金

2006年度经营业绩表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	2006年度	2005年度
收入			
股票差价收入	12	1,167,765,859.85	88,750,677.81
债券差价收入/(损失)	13	(4,066,084.66)	12,158,796.53
权证差价收入	14	46,170,516.16	2,719,278.00
债券利息收入		13,552,730.10	18,530,257.73
存款利息收入		2,149,935.07	1,674,328.96
股利收入		22,657,581.97	43,444,711.05
买入返售证券收入		63,753.42	42,645.00
其他收入	15	777,875.72	750,776.83
收入合计		1,249,072,167.63	168,071,471.91
费用			
基金管理人报酬		(32,731,749.18)	(41,463,965.81)
基金托管费		(5,455,291.63)	(6,910,660.97)
卖出回购证券支出		(3,790,881.77)	(22,169.86)
其他费用	16	(503,576.96)	(474,767.91)
其中：信息披露费		(340,000.00)	(340,000.00)
审计费用		(100,000.00)	(100,000.00)
费用合计		(42,481,499.54)	(48,871,564.55)
基金净收益		1,206,590,668.09	119,199,907.36
加：未实现估值增值/(减值)变动数	11	510,641,619.38	101,339,774.31
基金经营业绩		1,717,232,287.47	220,539,681.67
基金净收益		1,206,590,668.09	119,199,907.36
加：年初基金净收益/(年初累计基金净损失)		1,516,600.22	(31,026,514.52)
本年申购基金份额的损益平准金		95,383,490.13	(1,262,606.10)
本年赎回基金份额的损益平准金		(235,018,924.92)	3,444,138.51
可供分配基金净收益		1,068,471,833.52	90,354,925.25
减：本年已分配基金净收益	17	(307,411,402.75)	(88,838,325.03)
未分配基金净收益		761,060,430.77	1,516,600.22

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

海富通精选证券投资基金

2006年度基金净值变动表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006年度	2005年度
年初基金净值		2,510,541,600.15	2,815,902,681.89
本年经营活动			
基金净收益		1,206,590,668.09	119,199,907.36
未实现估值增值/(减值)变动数		510,641,619.38	101,339,774.31
经营活动产生的基金净值变动数		1,717,232,287.47	220,539,681.67
本年基金份额交易			
基金申购款		869,180,060.06	1,154,976,281.43
其中：分红再投资		22,492,867.40	6,530,275.77
基金赎回款		(2,412,271,111.30)	(1,592,038,719.81)
基金份额交易产生的基金净值变动数		(1,543,091,051.24)	(437,062,438.38)
本年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		(307,411,402.75)	(88,838,325.03)
年末基金净值		2,377,271,433.63	2,510,541,600.15

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、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：

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。

2、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。

3、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
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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	
	成交量	占本年成交量的比例
海通证券：		
买卖股票	472,726,512.50	5.78%
买卖债券	79,530,986.70	8.49%
买卖权证	4,938,224.94	7.79%
	佣金	占本年佣金总量的比例
海通证券	380,805.78	5.74%

	2005年度	
	成交量	占本年成交量的比例
海通证券：		
买卖股票	843,861,181.40	9.90%
买卖债券	55,520,810.90	5.03%
买卖权证	0.00	0.00%
	佣金	占本年佣金总量的比例
海通证券	678,120.51	9.85%

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。债券交易不计佣金。

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32,731,749.18元(2005年：41,463,965.81元)。

(d) 基金托管费

支付基金托管人交通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5,455,291.63元(2005年：6,910,660.97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交通银行保管，并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167,402,073.81元(2005年：12,024,340.27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1,161,947.44元(2005年：616,610.23元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于2006年12月31日的相关余额10,614,367.29元计入“结算备付金”科目(2005年：107,457,572.86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交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

	2006年度	2005年度
买入债券结算金额	0.00	176,413,466.85
卖出债券结算金额	100,935,479.45	104,657,473.97

(g) 关联方及其控制的机构在2006年和2005年内从未持有本基金份额。

4、流通受限制不能自由转让的基金资产

(a) 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
000002	万 科 A	06/12/25	07/12/27	10.50	10.62	5,830,000	61,215,000.00	61,914,600.00
600550	天威保变	06/06/08	发行结束日起12个月	17.60	18.25	2,000,000	35,200,000.00	36,500,000.00
601333	广深铁路	06/12/18	07/03/22	3.76	7.20	2,536,200	9,536,112.00	18,260,640.00
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
601006	大秦铁路	06/07/26	07/02/01	4.95	8.10	1,594,400	7,892,280.00	12,914,640.00
601628	中国人寿	06/12/28	预计07/04/09	18.88	18.88	485,100	9,158,688.00	9,158,688.00
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	99,000	1,869,120.00	1,869,120.00
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	32,568	223,347.88	611,113.66
002090	金智科技	06/11/28	07/03/08	14.20	22.25	27,174	385,870.80	604,621.50
002079	苏州固锝	06/11/01	07/02/16	6.39	10.28	53,560	342,248.40	550,596.80
601988	中国银行	06/06/28	07/01/05	3.08	5.43	75,451	232,389.08	409,698.93
合 计							132,007,210.16	158,614,725.64

(b)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3,006,637股，按2006年12月19日收盘价每股27.10元计算，估值为81,479,862.70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	项目市值（人民币元）	占基金资产总值比例
股 票	1,604,452,728.71	67.12%
债 券	490,765,810.50	20.53%
权 证	19,824,139.00	0.83%
银行存款及清算备付金合计	178,016,441.10	7.45%
其他资产	97,260,807.24	4.07%
合 计	2,390,319,926.55	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

行业	市值（人民币元）	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	142,300,000.00	5.99%
C 制造业	563,386,123.24	23.70%
C0 食品、饮料	181,090,416.15	7.62%
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	48,460,000.00	2.04%
C5 电子	26,407,316.56	1.11%
C6 金属、非金属	52,240,000.00	2.20%
C7 机械、设备、仪表	255,188,390.53	10.73%
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	50,400,000.00	2.12%
E 建筑业	0.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	106,054,920.00	4.46%
G 信息技术业	222,394,621.50	9.35%
H 批发和零售贸易	0.00	0.00%
I 金融、保险业	247,501,036.93	10.41%
J 房地产业	131,763,961.20	5.54%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	24,860,000.00	1.05%
M 综合类	115,792,065.84	4.87%
合计	1,604,452,728.71	67.49%

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）	市值占基金资产净值比例
1.	600718	东软股份	5,000,000	117,950,000.00	4.96%
2.	600797	浙大网新	16,000,000	103,840,000.00	4.37%
3.	600016	民生银行	9,000,737	91,807,517.40	3.86%
4.	600519	贵州茅台	1,000,000	87,830,000.00	3.69%
5.	600875	东方电机	3,006,637	81,479,862.70	3.43%
6.	000793	华闻传媒	9,000,582	81,185,249.64	3.42%
7.	600028	中国石化	8,000,000	72,960,000.00	3.07%
8.	600583	海油工程	2,000,000	69,340,000.00	2.92%
9.	600036	招商银行	4,000,000	65,440,000.00	2.75%
10.	000002	万 科 A	5,830,000	61,914,600.00	2.60%

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、卖出价值占期初基金资产净值比例大于2%的股票明细

累计买入			
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
000002	万 科 A	151,586,520.60	6.04%
600019	宝钢股份	91,186,456.53	3.63%
600550	天威保变	90,167,970.01	3.59%
000858	五 粮 液	89,657,074.53	3.57%
600717	天津港	89,194,558.40	3.55%
600316	洪都航空	86,525,273.89	3.45%
600797	浙大网新	77,499,679.90	3.09%
600050	中国联通	76,558,287.06	3.05%
000825	太钢不锈	69,617,865.03	2.77%
600016	民生银行	66,310,109.11	2.64%
600886	国投电力	65,548,379.87	2.61%
600030	中信证券	64,512,684.12	2.57%
000793	华闻传媒	60,820,654.71	2.42%
600879	火箭股份	59,912,361.86	2.39%
600036	招商银行	59,621,627.12	2.37%
600688	S上石化	57,312,305.05	2.28%
601398	工商银行	55,502,984.26	2.21%
600900	长江电力	54,322,873.89	2.16%
600875	东方电机	53,414,456.93	2.13%
600383	金地集团	52,978,195.04	2.11%
600195	中牧股份	52,761,066.00	2.10%
累计卖出			
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
000858	五 粮 液	193,288,836.52	7.70%
600583	海油工程	181,687,239.29	7.24%
600717	天津港	135,413,301.46	5.39%
000792	盐湖钾肥	132,346,443.66	5.27%
000002	万 科 A	131,272,966.19	5.23%
600519	贵州茅台	130,846,845.57	5.21%
600028	中国石化	125,314,495.05	4.99%
600036	招商银行	122,648,578.08	4.89%
600019	宝钢股份	118,594,098.65	4.72%
600037	歌华有线	118,027,914.63	4.70%
600309	烟台万华	109,448,834.19	4.36%
600009	上海机场	109,202,518.78	4.35%
600161	天坛生物	103,745,765.86	4.13%
600008	首创股份	101,290,508.66	4.03%
600316	洪都航空	95,818,295.40	3.82%
600050	中国联通	80,318,607.36	3.20%
600598	北大荒	79,847,365.45	3.18%
000825	太钢不锈	76,595,788.52	3.05%
600688	S上石化	73,099,109.27	2.91%
600886	国投电力	71,888,523.71	2.86%
600406	国电南瑞	71,721,793.46	2.86%
600879	火箭股份	69,877,992.10	2.78%
600662	强生控股	66,811,480.64	2.66%
000758	中色股份	61,671,668.91	2.46%
600963	岳阳纸业	59,366,015.01	2.36%
601398	工商银行	58,885,933.01	2.35%
000729	燕京啤酒	58,402,552.67	2.33%
600550	天威保变	56,548,397.84	2.25%
000027	深能源 A	55,584,943.03	2.21%
600205	S山东铝	54,160,355.51	2.16%
600900	长江电力	54,094,894.64	2.15%
600521	华海药业	50,725,256.46	2.02%
000402	金 融 街	50,274,055.31	2.00%

（二）报告期内买入股票成本总额及卖出股票收入总额

单位：人民币 元

买入股票成本总额	3,243,515,868.58
卖出股票收入总额	5,167,444,392.18

五、报告期末按券种分类的债券投资组合

债券类别	债券市值（人民币元）	市值占净值比例
国债	450,749,810.50	18.96%
金融债券	40,016,000.00	1.68%
债券投资合计	490,765,810.50	20.64%

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

债券名称	市值（人民币元）	市值占净值比例
21国债(3)	140,814,676.50	5.92%
20国债(0)	131,658,049.00	5.54%
02国债(4)	111,913,785.00	4.71%
21国债(5)	63,378,000.00	2.67%
00国开13	40,016,000.00	1.68%

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明细

权证名称	市值（人民币元）	市值占净值比例
五粮 YGC1	19,824,139.00	0.83%

八、投资组合报告附注

1、投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股票。

3、报告期内本基金未投资资产支持证券。

4、基金其他资产的构成

其他资产	金额（人民币元）
交易保证金	1,359,609.61
应收利息	4,461,079.33
应收申购款	1,548,040.27
证券清算款	89,892,078.03
应收股利	0.00
合计	97,260,807.24

5、基金持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

6、基金在报告期内的权证投资明细

权证代码	权证名称	投资类别	数量	成本(人民币元)
580997	招行 CMP1	被动持有	6,007,705	0.00
580996	沪场 JTP1	被动持有	5,250,000	0.00
580004	首创 JTB1	被动持有	330,000	0.00
580005	万华 HXB1	被动持有	800,000	0.00
580993	万华 HXP1	被动持有	1,200,000	0.00
580991	海尔 JTP1	被动持有	3,494,150	0.00
580990	茅台 JCP1	被动持有	4,160,000	0.00
038008	钾肥 JTP1	被动持有	1,600,000	0.00
030002	五粮 YGC1	主动持有	1,367,182	17,174,901.66

第九节 基金份额持有人情况

本基金份额持有人情况如下：

总份额/比例					持有人户数	户均持有份额（份）
个人（份）	比例	机构（份）	比例	合计（份）		
196,790,002.16	16.97%	962,858,442.71	83.03%	1,159,648,444.87	5,722	202,664.88

第十节 基金份额变动情况

本基金份额变动情况如下：

基金合同生效日基金份额总额	本期期初基金份额	本期期间总申购份额	本期期间总红利再投资份额	本期期间总赎回份额	本期期末基金份额
3,638,432,268.39	2,325,708,828.22	632,571,468.92	18,252,005.16	1,816,883,857.43	1,159,648,444.87

**第十一节 重大事件揭示