汇添富均衡增长股票型证券投资基金 2006年年度报告摘要

报告期间:2006 年 8 月 7 日至 12 月 31 日　基金管理人:汇添富基金管理有限公司　基金托管人:中国工商银行股份有限公司

第一节 重要提示及目录

一、重要提示

基金管理人——汇添富基金管理有限公司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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007 年 3 月 20 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。

按照中国证监会《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——年度报告的内容与格式》第六条的规定,本报告中的财务会计报告经具有从事证券相关业务资格的安永大华会计师事务所审计。

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。

第二节 基金简介

一、基金基本情况

基金简称:添富均衡

交易代码:519018

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2006 年 8 月 7 日

报告期末基金份额总额:5,098,980,440.33 份

二、基金投资基本情况

投资目标:本基金应用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资策略,通过行业的相对均衡配置和投资布局于具有持续增长潜质的企业,在有效控制风险的前提下,分享中国经济的持续增长,以持续稳定地获取较高的投资回报。

投资策略:本基金采用“由上而下”和“自下而上”相结合的投资方法,适度动态调整资产配置,行业保持相对均衡配置,同时通过三级过滤模型(Tri-Filtering Model)来构建核心股票池,深入剖析核心股票池企业的增长逻辑和增长战略,以达到审慎精选,并对投资组合进行积极而有效的风险管理(详见本基金的基金合同和招募说明书)。

业绩比较基准:沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

风险收益特征:本基金是主动型的股票基金,属于证券投资基金中风险偏上的品种。

三、基金管理人

名称:汇添富基金管理有限公司

信息披露负责人:李文

联系电话:021-28932888

传真:021-28932998

电子邮箱:service@99fund.com

四、基金托管人

名称:中国工商银行股份有限公司

信息披露负责人:蒋松云

联系电话:010-66106912

传真:010-66106904

电子邮箱: custody@icbc.com.cn

五、信息披露方式

信息披露报纸名称:《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》

登载本报告正文的基金管理人互联网网址:http://www.99fund.com

本报告置备地点:上海市富城路 99 号震旦国际大楼 21 层

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

单位:元

1	基金本期净收益	157,626,291.43
2	基金份额本期净收益	0.0304
3	期末可供分配基金收益	156,615,734.95
4	期末可供分配基金份额收益	0.0307
5	期末基金资产净值	7,790,443,472.60
6	期末基金份额净值	1.5278
7	基金加权平均净值收益率	2.70%
8	本期基金份额净值增长率	52.78%
9	基金份额累计净值增长率	52.78%

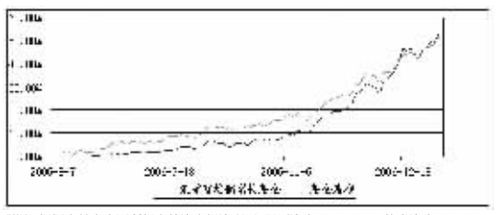
注:上述财务指标所属会计期间(以下称“本期”)为 2006 年 8 月 7 日(即基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日。上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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:

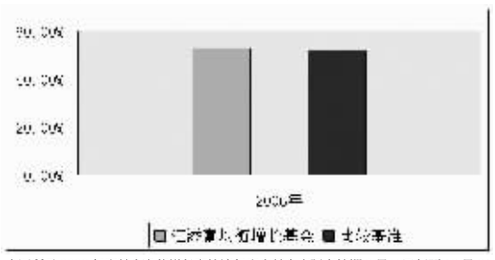
阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去 3 个月	45.62%	1.32%	36.43%	1.15%	9.19%	0.17%
自基金合同生效起至今	52.78%	1.07%	51.80%	1.04%	0.98%	0.03%

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:附注:根据本基金合同所规定的资产投资配置,股票资产 60%-95%,债券资产 0%-35%,权证类资产 0-3%,现金类资产最低为 5%。2006 年 12 月 31 日实际履行情况为,股票资产占基金资产净值为 94.66%,债券资产占基金资产净值为 1.91%,权证类资产占基金资产净值为 0.23%,现金类资产占基金资产净值为 5.25%。

3、本基金净值增长率与业绩比较基准 2006 年收益率对比例图:



注:上图所示 2006 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 8 月 7 日起至 12 月 31 日止计算。

三、基金收益分配情况

截至报告期末,本基金未进行收益分配。

第四节 管理人报告

一、基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其基金管理的经验

基金管理人汇添富基金管理有限公司由东方证券股份有限公司、文汇新民联合报业集团、东航金戎控股有限责任公司共同发起设立,经中国证监会证监基金字(2005)5 号文批准,于 2005 年 2 月 3 日正式成立,注册资本金为 1 亿元人民币。截至 2006 年 12 月 31 日,基金管理人共管理 3 只基金,包括:汇添富优势精选混合型证券投资基金、汇添富货币市场基金、汇添富均衡增长股票型证券投资基金。

2、基金经理简介

张晖先生,副总经理兼投资总监,上海财经大学数量经济学硕士,十一年证券从业经验,曾先后任申银万国研究所高级行业研究员,富国基金管理公司研究主管、汉盛基金基金经理和天益价值基金基金经理,2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司。

庞飒先生,浙江大学生命科学院理学硕士,六年证券从业经验。曾任申银万国证券研究所行业分析师,此后加入富国基金管理有限公司,任行业分析师及投资策略小组成员。2005 年 4 月加入汇添富基金管理有限公司。

二、报告期内基金运作遵规守信情况声明

基金管理人声明:在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定。

三、报告期内基金投资策略和业绩表现说明与解释

2006 年中国经济呈现出高增长低通胀的良好态势。同时在政府宏观调控政策的作用下,城乡固定资产投资增速较 05 年回落 2.7 个百分点,社会零售品消费总额较 05 年多增长 0.8 个百分点,经济增长结构正向着合理的方向转变。在经济高速增长的同时,企业效益也明显提高。规模以上工业企业利润同比增长 31%,较上年大幅提高 7.4 个百分点。

在经济高增长、人民币加速升值以及股权分置改革等多重利好因素共同作用下,06 年中国 A 股市场表现出典型的牛市特征,沪深两市均创出历史新高。06 年市场行情大致分为三个阶段:06 年 1 月—5 月,随着股权分置改革的推进,A 股上市公司治理结构进一步改善,公司透明度也有较大提高,因此估值水平得到相应提升,市场呈现了普涨格局;06 年 6 月—8 月,受宏观调控、市场扩容以及外围市场走势的影响,A 股市场出现两个月的震荡整理;9 月份开始,随着以证券投资基金为代表的机构投资者实力的壮大,大盘股逐步得到市场追捧,股指在金融、钢铁、石化、地产等优质大盘蓝筹股的带领下走出单边上扬行情。上证综指年涨幅 130.43%,深成指年涨幅 132.12%。

自从 2006 年 8 月 7 日基金合同生效以来,我们就按既定的投资策略积极建仓。在资产配置层面,严格遵循“行业相对均衡,个股适度集中”的配置思想。在行业选择层面,适度偏重消费和服务。我们认为消费和财富增长正是推动市场向上的力量,从长期来说配置这些行业必定能够获得超额回报。在个股选择层面,严格选取治理结构优良,财务透明度高的公司。客观来说,在市场快速上涨阶段,保持冷静的心态,建仓的难度比较大,特别是对于一些成长型的中小型公司来说,更是困难。本着长期投资的理念,克服短期市场的诱惑,我们完成了基金的建仓,同时取得了较好的、稳定的业绩。报告期内本基金的收益率为 52.78%,同期业绩基准收益率为 51.80%。

四、宏观市场、证券市场及行业走势简要展望

展望 2007 年,我们对市场依然看好。经济强劲增长、人民币升值、居民财富增长以及证券市场环境改善等因素,是推动市场上涨的主要力量。我们困惑的不是市场本身,而是我们应当采取怎样的配置策略,分享市场上涨所带来的收益。毕竟在目前的中国 A 股市场中,相对于日益增加的资金规模来说,治理结构优良、有长期增长潜力的公司数量非常有限。在资金推动型的市场中,买错了股票,短期风险会被掩盖,但长期来说,风险必定会暴露。

2007 年我们将秉承“以基本面分析为立足点,挑选高质量的证券做中长期投资布局”的投资理念,重点关注人民币升值、消费与服务、成长与活力以及制度变革带来的投资机会。同时在配置上坚持“行业相对均衡、个股适度集中、适时动态调整”的思路,加大对基本面研究的深度,注重长期战略性投资,坚决摒弃“短期基本面趋势”投资法。相信 2007 年我们会给基金持有人优异的回报。

第五节 托管人报告

2006 年度,本托管人在对汇添富均衡增长股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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。

2006 年汇添富均衡增长股票型证券投资基金的管理人——汇添富基金管理有限公司在汇添富均衡增长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对汇添富基金管理有限公司在 2006 年度所编制和披露的汇添富均衡增长股票型证券投资基金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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007年3月20日

第六节 审计报告

本报告期基金财务报告经安永大华会计师事务所有限责任公司审计,注册会计师徐艳、杨小梅签字出具了安永大华业字(2007)第 233 号标准无保留意见的审计报告。

第七节 财务会计报告

一、经审计的基金年度会计报表

(一)资产负债表

单位:元

项目	2006年12月31日
资产	
银行存款	260,241,133.16
清算备付金	10,282,907.34
交易保证金	1,000,000.00
应收证券清算款	27,045,521.17
应收利息	1,961,895.16
应收申购款	38,372,747.22
股票投资市值	7,374,604,432.26
其中:股票投资成本	4,813,379,975.61
债券投资市值	148,412,375.65
其中:债券投资成本	148,412,375.65
权证投资市值	17,673,000.00
其中:权证投资成本	—
买入返售证券	—
待摊费用	—
资产总计	7,879,594,011.96
负债	
应付证券清算款	6,635,291.13
应付赎回款	48,193,268.91
应付赎回费	181,632.77
应付管理人报酬	9,112,308.18
应付托管费	1,518,718.01
应付佣金	2,666,640.28
应付利息	4,940.28
应付收益	—
其他应付款	1,007,739.80
卖出回购证券款	19,600,000.00
预提费用	230,000.00
负债合计	89,150,539.36
持有人权益	
实收基金	5,098,980,440.33
未实现利得	2,534,847,297.32
未分配收益	156,615,734.95
持有人权益合计	7,790,443,472.60
负债及持有人权益总计	7,879,594,011.96
基金份额净值	1.5278

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

单位:元

项目	2006年8月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
一、收入:	198,828,959.23
股票差价收入	160,562,412.36
债券差价收入	-8,614,473.61
权证差价收入	21,422,329.61
债券利息收入	6,162,684.17
存款利息收入	5,310,052.32
股利收入	10,225,153.83
买入返售证券收入	1,474,312.78
其他收入	2,286,487.77
二、费用:	41,202,667.80
基金管理人报酬	35,063,771.88
基金托管费	5,843,961.98
卖出回购证券支出	23,922.75
其他费用	271,011.19
其中:信息披露费	150,000.00
审计费用	80,000.00
其他费用	41,011.19
三、基金净收益:	157,626,291.43
四、加:未实现利得	2,578,897,456.65
五、基金经营业绩	2,736,523,748.08

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(三)收益分配表

单位:元

项目	2006年8月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
本期基金净收益	157,626,291.43
加:期初基金净收益	—
加:本期损益平准金	-1,010,556.48
可供分配基金净收益	156,615,734.95
减:本期已分配基金净收益	—
期末基金净收益	156,615,734.95

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(四)基金净值变动表

单位:元

项目	2006年8月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
一、期初基金净值	4,935,775,576.48
二、本期经营活动:	
基金净收益	157,626,291.43
未实现利得	2,578,897,456.65
经营活动产生的基金净值变动数	2,736,523,748.08
三、本期基金份额交易:	
基金申购款	1,860,789,770.15
基金赎回款	-1,742,645,622.11
基金份额交易产生的基金净值变动数	118,144,148.04
四、本期向持有人分配收益:	
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	—
五、期末基金净值	7,790,443,472.60

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

二、会计报表附注

(一)主要会计政策和会计估计

1、会计报表编制基础

本基金的财务报表乃按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、基金合同、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

2、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 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日。

3、记账本位币

以人民币为记账本位币。记账单位为元。

4、记账基础和计价原则

以权责发生制为记账基础,除股票、债券和权证投资按本附注所述的估值方法计价外,其余均以历史成本为计价原则。

5、基金资产的估值方法

(1)上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值;该日无交易的证券,以最近一个交易日的收盘价计算;

(2)未上市的股票的估值

送股、转增股、增发新股或配股的股票,以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的收盘价估值,该日无交易的,以最近一个交易日的收盘价计算;

首次公开发行的股票,按其成本价估值;

(3)非公开发行的股票的估值

根据基金部通知[2006]37 号文《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》,2006 年 11 月 13 日前投资的非公开发行的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值;该日无交易的证券,以最近一个交易日的收盘价计算;2006 年 11 月 13 日后投资的非公开发行的股票按以下方法估值:

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时,应采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值;

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时,应按以下公式确定估值日该非公开发行股票的价值:

$FV=C+(P-C)\times(Dl-Dr)/Dl$

(其中:FV 为估值日该非公开发行股票的价值;C 为该非公开发行股票的初始取得成本;P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价;Dl 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数;Dr 为估值日剩余锁定期,即估值日至锁定期结束所含的交易天数,不含估值日当天)。

(4)上市债券以不含息价格计价,按估值日证券交易所挂牌的收盘价计算后的净价估值;该日无交易的,以最近交易日净价估值,并按债券票面价值与票面利率或内含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,在债券实际持有期间内逐日计提利息。

(5)未上市债券和在银行间同业市场交易的债券以不含息价格计价,按成本估值,并按债券票面价值与票面利率或内含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,在债券实际持有期间内计提利息。

(6)上市流通的权证以其估值日在证券交易所挂牌交易的收盘价估值,该估值日无交易的,以最近一个交易日的收盘价计算。

(7)未上市流通的权证,由基金管理人和托管人综合考虑标的股票价格、行权价格、剩余天数、市场无风险利率、标的股票价格波动以及市场情况等因素,按照最能反映权证公允价值的价格估值。

(8)配股权证,从配股除权日到配股确认日止,按收盘价高于配股价的差额估值;如果收盘价低于配股价,则估值额为零。

(9)认购新发行的分离交易可转债,上市日前,按以下方法分别计算债券和权证的估值:获得分离交易可转债的债券部分时,按成本估值;获得权证部分后,按照中国证券业协会公布的债券报价和权证报价分别确定当日债券和权证的估值。

自上市日起,上市流通的债券和权证分别按上述(4)、(6)中相关原则进行估值。

(10)如有确凿证据表明按上述规定不能客观反映基金资产公允价值的,基金管理人可根据具体情况,在与基金托管人商议后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

(11)如有新增事项,按国家最新规定估值。

6、证券投资的成本计价方法

(1)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;因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价,于股权分置改革方案实施后的股票复牌日,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。

(2)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。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。

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。债券投资按实际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。

买入央行票据和零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。

(3)权证

买入权证于成交日确认为权证投资,权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账。

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证,在确认日记录所获分配的权证数量,该等权证初始成本为零。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失),出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(4)分离交易可转债

认购新发行的分离交易可转债于权益登记日获得债券,按分离交易可转债的面值确认债券成本;于权证获得日,按中国证券业协会公布的当日权证报价确认权证成本,按面值减去权证成本的差额调整债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

7、收入的确认和计量

(1)股票差价收入于卖出股票成交日确认,并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

(2)债券差价收入

卖出交易所上市债券:于成交日确认债券差价收入,并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账。

卖出银行间同业市场交易债券:于实际收到价款时确认债券差价收入,并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

(3)权证价差收入于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

(4)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含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,在债券实际持有期间内逐日计提。

(5)存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账;若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与帐面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失,列入利息收入减项。存款利息收入以净额列示。

(6)股利收入于除息日确认,并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

(7)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的金额入账。

(8)其他于实际收到时确认收入。

8、费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率逐日计提。

(2)基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提。

(3)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。

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定,按实际支出金额,列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第五位的,则采用待摊或预提的方法。

9、实收基金

每份基金份额面值为 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额。

10、基金的收益分配政策

(1) 在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为 12 次,全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 50%,若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

(2) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红。

(3) 基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配。

(4) 基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

(5) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

(6) 每一基金份额享有同等分配权。

(7) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

11、为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计

本基金自 2006 年 8 月 7 日至 2006 年 12 月 31 日止并无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取其他会计政策和会计估计。

12、会计政策、会计估计变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由

本基金自 2006 年 8 月 7 日至 2006 年 12 月 31 日止并无会计政策、会计估计变更。

(三)税项

1、印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,基金管理人运用基金买卖股票按照 2‰的税率征收印花税。

根据财税[2005]11 号文《财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,从 2005 年 1 月 24 日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由现行的 2‰调整为 1‰。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,自 2005 年 6 月 13 日起,基金作为流通股股东在股权分置改革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。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围,不征收营业税;根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》,自 2004 年 1 月 1 日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20%的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自 2005 年 6 月 13 日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102 号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按 50%计算应纳税所得额。

(二)重大会计差错的内容和更正金额

无

(三)关联方关系及其交易

1、主要关联方关系

企业名称	与本基金的关系
汇添富基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金直销机构、基金份额持有人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
东方证券股份有限公司	基金管理人股东、基金代销机构、基金份额持有人
东航金戎控股有限责任公司	基金管理人股东
文汇新民联合报业集团	基金管理人股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、通过主要关联方席位进行的交易

2006 年 8 月 7 日至 2006 年 12 月 31 日期间:

1)交易情况:

关联方名称	交易品种	本期间成交金额(元)	占本期间交易金额比例
东方证券股份有限公司	股票买卖	1,777,825,908.55	29.52%
东方证券股份有限公司	债券买卖	—	—
东方证券股份有限公司	债券回购	—	—

2)佣金:

关联方名称	年度佣金(元)	占全年佣金总量比例	年末佣金余额(元)	占年末应付佣金总量比例
东方证券股份有限公司	1,441,567.24	29.63%	251,004.77	9.41%

上述佣金按市场佣金率计算,并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。

3、关联方报酬

(1)基金管理人报酬

基金管理费

A 基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

B 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核后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,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

本基金的基金管理人报酬的计提与支付情况如下:

单位:元

	2006年8月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
年(期)初金额	—
本年(期)计提	35,063,771.88
本年(期)支付	25,951,463.70
年(期)末金额	9,112,308.18

(2)基金托管人报酬

基金托管费

A 基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

B 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付;由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

本基金的基金托管费的计提与支付情况如下:

单位:元

	2006年8月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
年(期)初金额	—
本年(期)计提	5,843,961.98
本年(期)支付	4,325,243.97
年(期)末金额	1,518,718.01

4、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工商银行股份有限公司保管,并按银行间同业存款利率计息,由基金托管人保管的银行存款余额及产生的利息收入情况如下:

单位:元

项目	2006年12月31日
银行存款余额	260,241,133.16
项目	2006年8月7日(基金合同生效日)至2006年12月31日期间
银行存款产生的利息收入	5,248,481.48

5、与关联方银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期本基金与关联方未发生银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6、关联方持有本基金份额情况:

本基金基金管理人、基金托管人、基金管理人主要股东及其控制的机构自 2006 年 8 月 7 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间未持有本基金份额。

(四)报告期末流通转让受到限制的资产的说明:

截至 2006 年 12 月 31 日,本基金卖出回购证券款余额为 19,600,000.00。相关的因受质押而流通受限的债券资产明细如下:

债券代码	债券名称	数量	成本	年末估值总额	回购起始日	回购到期日
060217	06国开 17	200,000	19,718,843.48	19,718,843.48	2006/12/28	2007/01/04

本基金所持该流通受限债券,以不含息价格计价,按成本估值。

(五)资产负债表日后事项

1、本基金管理人于 2007 年 2 月 8 日通过代销申购本基金人民币 500 万元,取得本基金份额 2,937,017.62 份,占申购确认日基金总份额的 0.063%,申购费率为 0.3%。

2、本基金于 2007 年 2 月 28 日对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 1.00 元进行分红。

除以上情况外,无其他需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

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(元)	占基金总资产比例
股票	7,374,604,432.26	93.59%
债券	148,412,375.65	1.88%
权证	17,673,000.00	0.23%
银行存款及清算备付金合计	270,524,040.50	3.43%
其他资产	68,380,163.55	0.87%
资产总值	7,879,594,011.96	100.00%

二、报告期末按行业分类的股票投资组合

分类	股票市值	占基金资产净值比
A 农,林,牧,渔业	137,017,461.48	1.76%
B 采掘业	323,760,000.00	4.16%
C 制造业	3,017,984,061.30	38.74%
C0 食品,饮料	1,428,845,336.01	18.34%
C4 石油,化学,橡胶,塑料	746,758,846.29	9.59%
C5 电子	76,935,961.25	0.99%
C6 金属,非金属	290,735,710.00	3.73%
C7 机械,设备,仪表	189,994,618.60	2.44%
C8 医药,生物制品	284,713,589.15	3.65%
D 电力,煤气及水的生产和供应业	121,148,000.00	1.56%
F 交通运输,仓储业	176,877,000.00	2.27%
G 信息技术业	568,716,725.35	7.17%
H 批发和零售贸易	734,293,942.68	9.43%
I 金融,保险业	1,221,809,000.00	15.68%
J 房地产业	832,104,328.73	10.68%
K 社会服务业	132,675,412.72	1.70%
M 综合类	118,218,500.00	1.52%
合计	7,374,604,432.26	94.66%

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	证券代码	证券名称	库存数量	证券市值(元)	市值占净值比例
1	600519	贵州茅台	8,387,668	736,688,880.44	9.46%
2	600036	招商银行	40,000,000	654,400,000.00	8.40%
3	002024	苏宁电器	12,717,024	577,352,889.60	7.41%
4	600143	金发科技	9,895,375	396,408,722.50	5.09%
5	000002	万 科 A	22,867,800	353,078,832.00	4.53%
6	600028	中国石化	35,500,000	323,760,000.00	4.16%
7	600016	民生银行	27,500,000	220,500,000.00	3.60%
8	000869	张 裕 A	5,495,849	273,803,197.18	3.51%
9	600030	中信证券	9,000,000	246,420,000.00	3.16%
10	600050	中国联通	43,000,000	200,810,000.00	2.58%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于汇添富基金管理有限公司网站 www.99htffund.com 的年度报告正文。

四、报告期内股票投资组合的重大变动

1、累计买入价值超出期末基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

股票代码	股票名称	买入累计金额(元)	占期末基金资产净值比例
600519	贵州茅台	402,410,446.16	5.17%
600036	招商银行	355,517,393.14	4.56%
002024	苏宁电器	329,314,135.70	4.23%
600143	金发科技	241,351,507.64	3.10%
600028	中国石化	231,949,820.52	2.98%
000869	张 裕 A	195,097,348.99	2.50%
000002	万 科 A	195,031,513.23	2.50%
600016	民生银行	183,021,553.93	2.35%
600030	中信证券	176,869,395.53	2.27%
600887	伊利股份	176,220,490.87	2.26%
600050	中国联通	153,547,928.34	1.97%
000063	中兴通讯	138,852,194.69	1.78%
600694	大商股份	138,096,072.37	1.77%
600549	厦门钨业	134,718,979.21	1.73%
600066	宇通客车	133,894,684.40	1.72%
600269	赣粤高速	125,046,416.77	1.61%
000538	云南白药	119,758,568.23	1.54%
600900	长江电力	118,076,416.74	1.52%
000402	金 融 街	117,642,300.08	1.51%
002069	獐子岛	116,774,055.04	1.50%

2、累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

股票代码	股票名称	卖出累计金额(元)	占期末基金资产净值比例
600036	招商银行	71,207,445.93	0.91%
600269	赣粤高速	57,861,831.70	0.74%
000898	鞍钢股份	48,938,806.03	0.63%
600050	中国联通	48,358,456.48	0.62%
600028	中国石化	45,984,328.38	0.59%
600066	宇通客车	45,104,309.35	0.58%
600016	民生银行	44,054,183.15	0.57%
600309	烟台万华	33,511,373.87	0.43%
000400	许继电气	29,750,265.14	0.38%
600900	长江电力	27,798,641.06	0.36%
600887	伊利股份	24,181,809.67	0.31%
600089	特变电工	23,779,424.07	0.31%
601588	北辰实业	22,232,114.66	0.29%
000538	云南白药	15,057,824.50	0.19%
600549	厦门钨业	14,762,261.29	0.19%
600312	平高电气