

海富通强化回报混合型证券投资基金 2007年第二季度报告

一、重要提示
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。
基金管理人声明：独立董事陈强先生因没有时间撰写季度报告，无法保证本报告内容的真实性、准
确性、完整性，理由是：陈家强先生因工作原因提出辞职，公司目前正在办理独立董事变更手续。请投
资者特别关注。

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7月19日复核了本报告中的
财务指标、净值表现和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。

基金经理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产，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。

本报告期为 2007 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。本报告中的财务资料未经审计。

二、基金概况

| | |
|----------------|-------------------------|
| 1. 基金简称： | 海富通回报 |
| 2. 基金运作方式： | 契约型开放式 |
| 3. 基金合同生效日： | 2006年6月25日 |
| 4. 报告期末基金份额总额： | 1,380,649,621.72份 |
| 5. 投资目标： | 每年超越三年期定期存款(税前)加权平均收益率。 |

本基金简介：通过合理的资产配置策略和精选证券是获得回报的主要来源，而风险管理及风险管理是保证回报的重要手段。因此，本基金运用资产配置、精选证券和收益管理三个层次的投资策略，实现基金的回报目标。

三、业绩比较基准：三年期定期存款(税前)加权平均收益率。

本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。

基金经理人：海富通基金管理有限公司 招商银行股份有限公司

（一）主要财务指标和基金净值表现

| | |
|---------------|-------------------|
| 基金本期净收益 | 469,166,366.19元 |
| 加权平均基金份额本期净收益 | 0.3948元 |
| 期末基金资产净值 | 2,146,105,721.91元 |

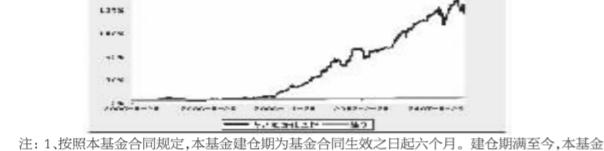
基金份额净值 1.3804 元

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，计入费用后实际收益水平要低于所
列数字。

（二）报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长(1) | 净值增长(2) | 业绩比较基准收益率差(3) | 业绩比较基准标准差(4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|-------|---------|---------|---------------|--------------|---------|---------|
| 过去3个月 | 20.89% | 1.99% | 1.02% | 0.03% | 28.87% | 1.98% |

（三）本基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的历史走势对比图
(2006年5月25日至2007年6月30日)



注：1.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。建仓期间至今，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。

（四）报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值增长(1) | 净值增长(2) | 业绩比较基准收益率差(3) | 业绩比较基准标准差(4) | (1)-(3) | (2)-(4) |
|-------|---------|---------|---------------|--------------|---------|---------|
| 过去3个月 | 20.89% | 1.99% | 1.02% | 0.03% | 28.87% | 1.98% |

（五）投资组合报告

（一）报告期末本基金资产组合情况

| 项目 | 金额(元) | 占基金资产总值比例 |
|--------------|------------------|-----------|
| 股票 | 1,599,617,828.08 | 74.11% |
| 债券 | 145,629,783.56 | 6.74% |
| 银行存款和清算备付金合计 | 393,955,183.84 | 18.25% |
| 应收证券清算款 | 693,295.73 | 0.03% |
| 权证 | 14,400,000.00 | 0.67% |
| 合计 | 2,158,479,462.92 | 100.00% |

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

| 项目 | 金额(元) | 占基金资产总值比例 |
|------------------|------------------|-----------|
| A 农、林、牧、渔业 | 793,000.00 | 0.02% |
| B 采掘业 | 271,150,915.70 | 6.73% |
| C 制造业 | 1,598,188,497.87 | 39.70% |
| C0 食品、饮料 | 78,018,874.00 | 1.94% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 800,082.84 | 0.02% |
| C2 木材、家具 | 0.00 | 0.00% |
| C3 造纸、印刷 | 48,245,932.00 | 2.25% |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 104,890,523.35 | 4.89% |
| C5 电子 | 4,403,520.58 | 0.21% |
| C6 金属、非金属 | 115,667,752.40 | 5.39% |
| C7 机械、设备、仪表 | 373,441,063.88 | 17.40% |
| C8 医药、生物制品 | 37,776,728.96 | 1.76% |
| C9 其他制造业 | 12,999,584.78 | 0.61% |
| D 电力、煤气及水的生产、供应业 | 20,812,096.00 | 0.97% |
| E 建筑业 | 1,089,746.84 | 0.05% |
| F 交通运输、仓储业 | 136,953,498.60 | 6.38% |
| G 信息产业 | 61,209,000.00 | 2.85% |
| H 批发和零售贸易 | 27,256,026.00 | 1.27% |
| I 金融、保险业 | 212,273,145.76 | 9.89% |
| J 房地产业 | 160,096,498.84 | 7.46% |
| K 社会服务业 | 430,731.00 | 0.02% |
| L 传播与文化产业 | 47,124,000.00 | 2.20% |
| M 综合类 | 90,440,708.00 | 4.21% |
| 合计 | 1,599,617,828.08 | 74.54% |

（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 | 600786 | 东方锅炉 | 1,099,885 | 125,950,870.00 | 5.57% |
| 2 | 601318 | 中国平安 | 1,758,140 | 125,724,591.40 | 5.56% |
| 3 | 600001 | 民生银行 | 7,572,052 | 86,548,554.36 | 4.03% |
| 4 | 600028 | 中国石化 | 6,000,000 | 79,320,000.00 | 3.70% |
| 5 | 000527 | 美的电器 | 2,320,036 | 70,529,094.40 | 3.29% |
| 6 | 000002 | 万科A | 4,500,000 | 58,545,000.00 | 2.73% |
| 7 | 000572 | 海螺水泥 | 2,500,000 | 50,050,000.00 | 2.30% |
| 8 | 600963 | 卧龙地产 | 2,932,400 | 46,245,920.00 | 2.25% |
| 9 | 600037 | 华银电力 | 1,800,000 | 47,124,000.00 | 2.20% |
| 10 | 600652 | 泰达股份 | 1,574,956 | 44,539,727.00 | 2.08% |

（四）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组合

| 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 | 601318 | 中国平安 | 4,000,000 | 286,040,000.00 | 7.11% |
| 2 | 600786 | 东方锅炉 | 3,896,528.00 | 246,403,333.44 | 6.10% |
| 3 | 600028 | 中国石化 | 16,000,000 | 211,520,000.00 | 5.25% |
| 4 | 600037 | 华银电力 | 7,000,000 | 183,360,000.00 | 4.55% |
| 5 | 000527 | 美的电器 | 6,000,000 | 182,400,000.00 | 4.53% |
| 6 | 600963 | 卧龙地产 | 7,088,150 | 180,251,654.50 | 4.48% |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 10,710,000 | 122,415,300.00 | 3.04% |
| 8 | 000002 | 万科A | 5,850,000 | 111,852,000.00 | 2.78% |
| 9 | 000652 | 泰达股份 | 3,736,401.00 | 105,665,420.28 | 2.62% |
| 10 | 600415 | 小商品城 | 1,030,977.00 | 104,128,677.00 | 2.59% |

（五）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 市值(元) | 市值占基金资产净值比例 |
|----|--------|------|----------------|-------|-------------|
| 1 | 070204 | 国债 | 99,345,221.98 | 2.47% | |
| 2 | 070204 | 国债 | 46,073,660.10 | 1.14% | |
| 3 | 070109 | 国债 | 171,269,220.00 | 4.03% | |
| 4 | 070109 | 国债 | 99,952,300.00 | 0.86% | |
| 5 | 070210 | 国债 | 69,832,020.00 | 0.59% | |

（六）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名权证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 数量(张) | 市值(元) | 市值占基金资产净值比例 |
| --- | --- | --- | --- | --- | --- |

<tbl_r cells="6" ix="