

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金 年度报告 (2006 年)

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二 七年三月二十八日

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。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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告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，投资者在做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。

报告期间：2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日

目 录

一、基金简介	4
(一) 基金基本资料	4
(二) 基金产品说明	4
(三) 基金管理人	4
(四) 基金托管人	4
(五) 信息披露	5
(六) 其他有关资料	5
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况	5
(一) 主要会计数据和财务指标	5
(二) 基金净值表现	5
三、过往三年每年的基金收益分配情况	7
三、管理人报告	7
(一) 基金管理人及基金经理情况	7
(二) 报告期内基金运作的遵规守信情况的说明	7
(三) 报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释	8
(四) 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望	8
(五) 基金内部监察报告	9
四、托管人报告	9
五、审计报告	10
六、财务会计报告	11
(一) 基金会计报表	11
(二) 基金财务会计报表附注	13
六、投资组合报告	23
(一) 报告期末基金资产组合情况	23
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合	23
(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细	24
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动	25
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合	27
(六) 投资组合报告附注	28
八、基金份额持有人情况	28

(一) 报告期末基金份额持有人户数	28
(二) 报告期末基金份额持有人结构	28
九、开放式基金份额变动情况	29
十、重大事项揭示	29
十一、备查文件	32

一、基金简介

(一) 基金基本资料

1、基金名称：	友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金
2、基金简称：	友邦盛世
3、交易代码：	460001
4、基金运作方式：	契约型开放式
5、基金合同生效日：	2005 年 4 月 27 日
6、报告期末基金份额总额：	442,070,287.33 份
7、基金合同存续期：	无
8、基金份额上市的交易所：	无
9、上市日期：	无

(二) 基金产品说明

1、投资目标：	主要通过股票选择，辅以适度的大类资产配置调整，追求管理资产的长期稳定增值。
2、投资策略：	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；以债券类资产作为降低组合风险的策略性投资工具，通过适当的大类资产配置来降低组合的系统性风险。
3、业绩比较基准：	中信标普 300 指数×70%+中信国债指数×30%
4、风险收益特征：	较高风险、较高收益

(三) 基金管理人

1、名称：	友邦华泰基金管理有限公司
2、注册地址：	上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼
3、办公地址：	上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼
4、邮政编码：	200121
5、国际互联网址：	http://www.aig-huatai.com
6、法定代表人：	齐亮
7、信息披露负责人：	陈晖
8、联系电话：	021-5047 2222
9、传真：	021-5047 8668
10、电子邮箱：	customer@aig-huatai.com

(四) 基金托管人

1、名称：	中国银行股份有限公司
2、注册地址：	北京市复兴门内大街 1 号
3、办公地址：	北京市复兴门内大街 1 号
4、邮政编码：	100818
5、国际互联网址：	http://www.boc.cn
6、法定代表人：	肖钢

7、信息披露负责人：	宁敏
8、联系电话：	010-6659 4977
9、传真：	010-6659 4942
10、电子邮箱：	tgxxpl@bank-of-china.com

(五) 信息披露

1、信息披露报纸名称：	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
2、登载年度报告正文的管理人互联网网址：	http://www.aig-huatai.com
3、年度报告置备地点：	上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼

(六) 其他有关资料

1、聘请的会计师事务所	
名称：	普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址：	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
2、基金注册登记机构	
名称：	友邦华泰基金管理有限公司
办公地址：	上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

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。

(一) 主要会计数据和财务指标

序号	主要会计数据和财务指标		
	项目	2006 年	2005 年 4 月 27 日 (基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日
1	基金本期净收益	335,510,870.60 元	9,284,922.51 元
2	基金份额本期净收益	0.6637 元	0.0130 元
3	期末可供分配基金收益	125,109,643.86 元	-9,031,795.26 元
4	期末可供分配基金份额收益	0.2830 元	-0.0133 元
5	期末基金资产净值	689,793,982.30 元	683,033,735.13 元
6	期末基金份额净值	1.5604 元	1.0070 元
7	基金加权平均净值收益率	54.50%	1.30%
8	本期基金份额净值增长率	109.81%	3.66%
9	基金份额累计净值增长率	117.49%	3.66%

注：本基金合同生效日为 2005 年 4 月 27 日，2005 年度主要财务指标的计算期间为 2005 年 4 月 27 日至 2005 年 12 月 31 日。

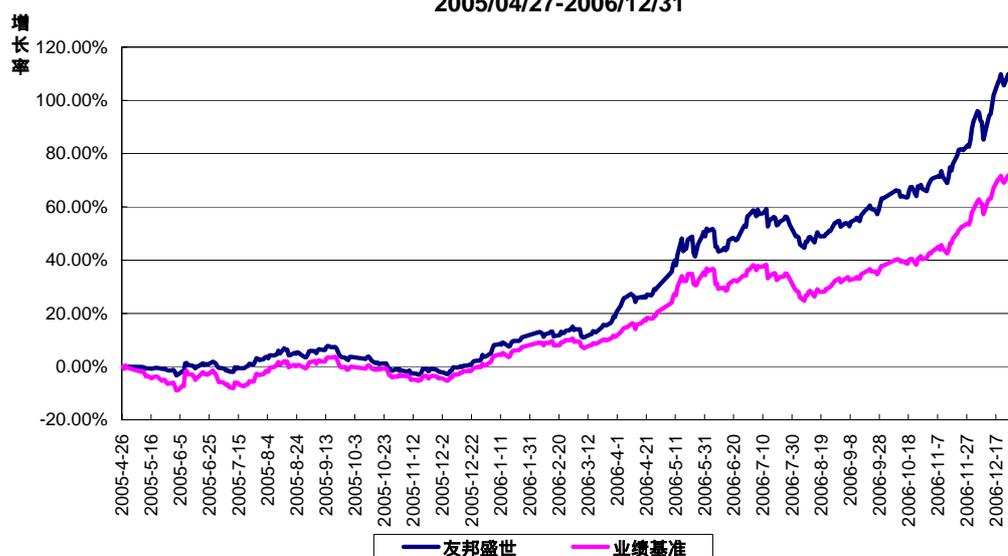
(二) 基金净值表现

1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	33.30%	1.28%	29.07%	0.99%	4.23%	0.29%
过去六个月	38.70%	1.18%	30.56%	0.99%	8.14%	0.19%
过去一年	109.81%	1.22%	77.22%	0.98%	32.59%	0.24%
自基金合同生效日起至 今	117.49%	1.05%	77.99%	0.96%	39.50%	0.09%

2、基金合同生效以来基金份额净值变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

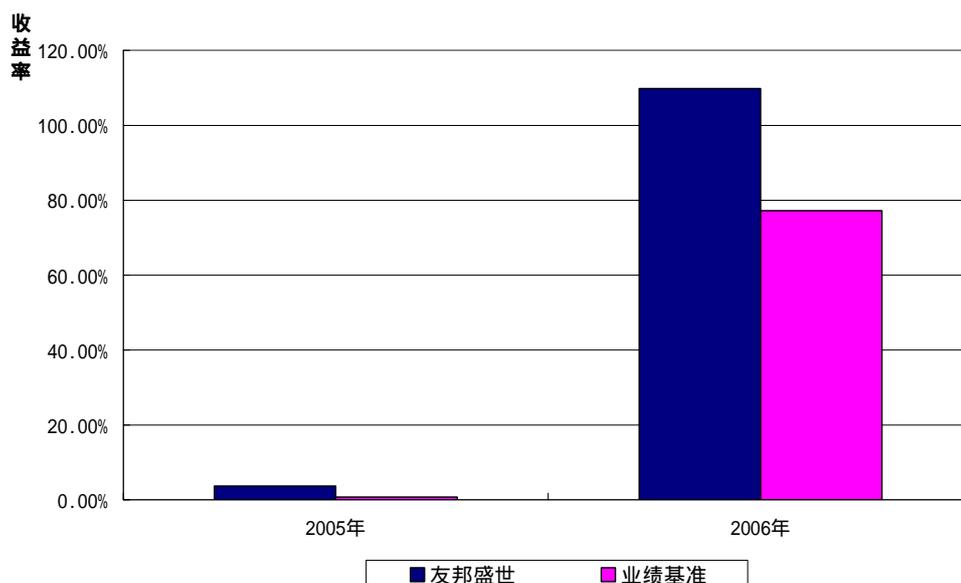
友邦盛世基金与业绩基准比较图
2005/04/27-2006/12/31



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第十三条（二）投资范围、（八）投资组合中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金净资产的 60%-90%，债券投资为基金净资产的 0%-40%。

3、自基金合同生效以来的净值增长率，及与同期业绩比较基准的收益率比较

友邦盛世基金与业绩基准历年收益率对比图



三、过往三年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
2005 年	0.300	8 月 23 日实施
2006 年	3.750	3 月 10 日、6 月 9 日和 11 月 20 日实施
合计	4.050	

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为 AIG Global Investment Corp.、华泰证券有限责任公司和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资额分别为 49%、49% 和 2%。目前公司旗下管理友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金、友邦华泰中短期债券投资基金和上证红利交易型开放式指数证券投资基金。

2、基金经理或基金经理小组成员情况

李文杰先生，工商管理学士，自 1999 年 8 月起历任美国国际集团（亚洲）投资有限公司基金管理部集中交易员、投资分析员、资深分析员，负责中国地区股票研究。2004 年 4 月加入友邦华泰基金管理有限公司。

(二) 报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及

基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.5604 元，累计净值为 1.9654 元，本报告期内基金份额净值上涨 109.81%，本基金的业绩比较基准上涨 77.22%。本基金在 2006 年实施了三次分红，基金份额持有人每份合计共获得 0.375 元的现金红利。

06 年 A 股市场沪深 300 指数上涨 118%，我们认为 06 年驱动股市上涨的因素主要有以下几个方面：首先是外贸顺差不断扩大导致的流动性过剩，造成 M2 高速增长，进而转化为 M1 的增长，随着其他资产包括债券、房地产等的投资回报率不断降低，更多的资金流入股市从而推动市场上涨。其次是宏观经济和公司基本面在 3 季度后等到明显好转使得股市的上涨有了更好的保障基础。从整体上市公司业绩变化来看，3 季度上市公司净利润同比增长达到 20%，远高于中报的水平，我们认为这主要是因为很多周期性行业从 3 季度开始好转，特别是大宗原材料行业中的钢铁、水泥等，从而在基本面上使股市上涨得到支撑。最后我们认为股改等因素的全面完成使得上市公司大股东更有动力将优质资产不断注入上市公司，从而使得资本市场的根本问题得到解决，股市整体的估值水平得到提升。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

若人民币升值幅度加大、速度加快，我们认为对股市的影响在于：可能会提供 A 股估值上升的短期动力；而长期升值效应可能导致资源向非贸易部门的集中，而使利润向非贸易部门转移，最终使非贸易部门跑赢贸易部门。德、日不同的升值策略都不同程度的带来了其股票市场整体市盈率的上升。我们认为类似的情景也可能在中国重演。以人民币计价的股票资产，在本币升值的大背景下，会得到国际投资者更多的追捧，估值会得到相应的提升。从东亚地区升值期间的行业表现来看，我们发现一个普遍的发展脉络：制造业强盛 - 贸易品行业竞争力凸现 - 收益从非贸易部门流向贸易部门 - 货币升值 - 资产价格上涨，贸易品行业竞争力下降 - 收益回流非贸易部门。非贸易品行业在升值期间指数收益率跑赢贸易品行业，但这种优势主要来自于其业绩的增长而非完全来自市盈率的提高。升值促使非贸易品要素价格上涨，促使非贸易部门利润上升，资产升值带来的财富效应带来人民可支配收入提高，刺激消费快速成长。

展望 1 季度宏观经济，我们认为经济景气继续上升。受高回报率、信贷投放、行政调控弱化影响，投资将出现反弹；受收入增加、居民财富上升影响，预计 1、2 月节日消费将超出预期。紧缩性政策或许在季度末出台，3、4 月份是加息的敏感时间窗口。

展望 1 季度 A 股市场，受资金推动影响，春节前市场估计保持强势上涨。随后上市公司公告超出预期的 06 年报业绩，而在去年 1 季度低基数基础上将体现 07 年 1 季度业绩高增长，加上不断涌入市场的良好品种（新股 IPO），这些因素都会继续刺激投资者乐观情绪。

指数有望创出新高，但市场也在不断积累估值风险，A 股估值已经超越全球其他市场而显得竞争力越来越小。预计下阶段股市上涨动力主要来自于 06 年业绩的超预期增长、所得税率下降和 20% 的 07 年 EPS 预期增幅。

调整压力将主要来自于新增股票融资、“小非”减持、可能的“加息”、可能低于预期的成长股年报。看好以下几类行业投资。一、投资品。投资反弹、产能过剩逐步缓解、业绩同比高增长、税收优惠。主要包括钢铁、电解铝和机械；二、高价奢侈品。其原因在于节日消费超预期，以及合理的 PEG。包括高价酒、汽车、旅游、航空机场；三、会计准则和税率优惠。相关商业地产和金融股权重估等。

（五）基金内部监察报告

2006 年度，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（1）全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先合规性设置并进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资遵循既定的投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合及个股投资符合比例控制的要求，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

（2）开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对新基金募集和建仓期运作、公司营销费用处理等项目的专项监察稽核活动，并对发现问题及时发出合规提示函，要求整改，有效提高了公司各部门的合规意识。

（3）促进公司各项内部管理制度的完善

按照证监会等监管机关的相关制度、规定和业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

（4）通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训等提高员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

四、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”）在对友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金（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。

五、审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20308 号

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金(以下简称“友邦华泰盛世中国基金”)会计报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年度的经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

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》、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是友邦华泰盛世中国基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价

会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了友邦华泰盛世中国基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天会计师事务所有限公司
中国·上海市
2007 年 3 月 23 日

注册会计师：汪 棣
注册会计师：王 灿

六、 财务会计报告

(一) 基金会计报表

1、 资产负债表 (单位：元)

项 目	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产：			
银行存款	7 (1)	114,602,966.02	38,099,108.63
清算备付金		723,552.18	216,158.55
交易保证金	7 (2)	888,549.12	754,288.37
应收证券清算款		-	-
应收股利		-	-
应收利息	7 (3)	27,402.50	386,392.75
应收申购款		135,155.35	319,632.50
其他应收款		-	-
股票投资市值	7 (4)	593,861,881.73	537,536,115.68
其中：股票投资成本	7 (5)	432,377,150.91	517,504,119.90
债券投资市值	7 (4)	-	109,539,740.00
其中：债券投资成本		-	109,539,740.00
权证投资	7 (4)	-	-
其中：权证投资成本		-	-
买入返售证券		-	-
待摊费用	7 (6)	-	-
其他资产		-	-
资产合计		710,239,506.90	686,851,436.48
负债：			

应付证券清算款		16,991,692.87	-
应付赎回款		861,337.25	1,945,609.39
应付赎回费		2,469.17	7,332.66
应付管理人报酬		849,148.44	859,033.41
应付托管费		141,524.73	143,172.26
应付佣金	7(7)	588,352.14	282,553.63
应付利息			-
应付收益			-
未交税金			-
其他应付款	7(8)	750,000.00	500,000.00
卖出回购证券款			-
预提费用	7(9)	261,000.00	80,000.00
其他负债			-
负债合计		20,445,524.60	3,817,701.35
持有人权益：			
实收基金	7(10)	442,070,287.33	678,263,941.86
未实现利得	7(11)	122,614,051.11	13,801,588.53
未分配收益		125,109,643.86	-9,031,795.26
持有人权益合计		689,793,982.30	683,033,735.13
负债及持有人权益合计		710,239,506.90	686,851,436.48

2、经营业绩表及收益分配表

经营业绩表 (单位：元)

项 目	附注	2006年	2005年
收入：			
股票差价收入	7(12)	323,239,110.01	4,549,514.40
债券差价收入	7(13)	-438,893.74	1,469,090.57
权证差价收入	7(14)	12,723,751.95	892,699.46
债券利息收入		490,274.23	1,640,493.33
存款利息收入		975,577.23	1,117,124.85
股利收入		8,625,419.73	6,938,511.91
买入返售证券收入		3,390.68	891,618.00
其他收入	7(15)	1,112,702.67	800,971.56
收入合计		346,731,332.76	18,300,024.08
费用：			
基金管理人报酬		9,289,413.19	7,287,899.07
基金托管费		1,548,235.47	1,214,649.86
卖出回购证券支出		-	202,564.38
利息支出		-	-
其他费用	7(16)	382,813.50	309,988.26
其中：信息披露费		300,000.00	200,000.00

审计费用		61,000.00	80,000.00
费用合计		11,220,462.16	9,015,101.57
基金净收益		335,510,870.60	9,284,922.51
加：未实现估值增值变动数		141,452,735.04	20,031,995.78
基金经营业绩		476,963,605.64	29,316,918.29

收益分配表 (单位：元)

项 目	附注	2006年	2005年
本期基金净收益		335,510,870.60	9,284,922.51
加：期初基金净收益		-9,031,795.26	-
加：本期申购基金单位的损益平准金		65,375,241.04	4,556,720.29
减：本期赎回基金单位的损益平准金		68,693,000.47	3,500,023.45
可供分配基金净收益		323,161,315.91	10,341,619.35
减：本期已分配基金净收益	7 (17)	198,051,672.05	19,373,414.61
期末基金净收益		125,109,643.86	-9,031,795.26

3、基金净值变动表 (单位：元)

项 目	附注	2006年	2005年
一、期初基金净值		683,033,735.13	900,519,775.77
二、本期经营活动：			
基金净收益		335,510,870.60	9,284,922.51
未实现估值增值变动数		141,452,735.04	20,031,995.78
经营活动产生的基金净值变动数		476,963,605.64	29,316,918.29
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		660,148,185.72	306,052,240.77
其中：分红再投资		35,140,681.87	4,678,320.73
基金赎回款		-932,299,872.14	-533,481,785.09
基金单位交易产生的基金净值变动数		-272,151,686.42	-227,429,544.32
四、本期向持有人分配收益		-198,051,672.05	-19,373,414.61
五、期末基金净值		689,793,982.30	683,033,735.13

(二) 基金财务会计报表附注

1、本基金的基本情况

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监

督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2005]第 19 号《关于同意友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金设立的批复》核准,由友邦华泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 900,348,752.84 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2005)第 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》于 2005 年 4 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 900,519,775.77 份基金份额,其中认购资金利息折合 171,022.93 份基金份额。本基金的基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于股票的比例为基金净资产的 60-90%,债券投资为基金净资产的 0-40%。此外,本基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的资产比例合计不低于基金净资产的 5%。

2、本年度报告中会计报表的编制遵守了基本会计假设。

3、本年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

(1) 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按照国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》及中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2) 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。比较会计报表的实际编制期间为 2005 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日。

(3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(4) 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。

(5) 基金资产的估值原则

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;

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债券按估值日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进行估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价计算所得的净价估值；

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；

因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，按估值日在证券交易所挂牌的该股票的市场交易收盘价高于配股价的差额估值，若市场交易收盘价低于配股价，则估值为零。

从获赠确认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按公允价值估值。

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。

(6) 证券投资的成本计价方法

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

(7) 待摊费用、预提费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用核算已经发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用，如信息披露费、审计费用和律师费用等，待摊费用在实际发生时入账，在受益期内平均摊销。

预提费用核算预计将发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应预提计入本期的费用，如信息披露费、审计费用和律师费用等，预提费用在预计发生时入账。

(8) 收入的确认和计量

股票差价收入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于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入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。

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。

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。

(9) 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 1.50%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。

(10) 基金的收益分配原则

本基金收益采用现金方式，投资人可选择现金红利自动转为基金份额进行再投资；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金分红；

每一基金份额享有同等分配权；

基金当期收益先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

基金收益分配后，每基金份额净值不能低于面值；

如果基金当期出现亏损，则不进行收益分配；

在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 6 次；

全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 80%，成立不满 3 个月，收益可不分配；

法律、法规或监管机构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

本报告期末采取其他的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

本报告期无会计政策和会计估计变更。

(13) 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。

(14) 股权分置改革现金对价处理

基金投资的股票，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复牌日冲减股票投资成本。

4、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》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

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。

基金买卖股票、债券的差价收入，自2004年1月1日起继续免征营业税和企业所得税。

对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时，代扣代缴20%的个人所得税。

从2005年6月13日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，暂减按50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定计征个人所得税。

从2005年1月24日起，股票买卖按照1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

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。

5、资产负债表日后事项

本基金管理人于2007年1月16日宣告2007年第一次分红，向截至2007年1月19日止在本基金注册登记人登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利4.40元。此外，根据本基金管理人于2007年1月19日发布的《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金调整第五次分红金额的公告》，2007年度第一次分红金额调整为按每10份基金份额派发红利6.00元。

6、本报告期关联方关系发生变化的情况，本报告期及上年度可比期间的关联方交易

(1) 关联方关系发生变化的情况

本报告期内，关联方关系未发生变化。

关联方名称	关联方关系
友邦华泰基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	基金管理人的发起股东
华泰证券有限责任公司	基金管理人的发起股东、基金代销机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东

关联方与基金进行的关联交易均在正常业务中按照一般商业条款而订立的。

(2) 关联方交易

1) 通过关联方席位进行的交易

关联方及关联方交易	2006年		2005年	
	金额(元)	比例(%)	金额(元)	比例(%)
1、股票交易				
华泰证券有限责任公司	441,535,750.98	17.00	406,485,562.84	29.87
2、债券交易				
华泰证券有限责任公司	-	-	2,175,932.70	4.41
3、债券回购交易				
华泰证券有限责任公司	-	-	573,200,000.00	8.24
4、权证交易				
华泰证券有限责任公司	1,535,166.49	12.06	-	-
5、佣金				
华泰证券有限责任公司	356,191.32	16.92	313,851.22	30.44

上述佣金按股票交易量的千分之一计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的股票、债券和回购交易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。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

2) 关联方报酬

管理人报酬

本基金应支付基金管理人报酬,按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人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。

	2006年	2005年
管理人报酬(元)	9,289,413.19	7,287,899.07

托管人报酬

本基金应支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

	2006年	2005年
托管人报酬(元)	1,548,235.47	1,214,649.86

3) 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

关联方及关联方交易	2006年	2005年
	金额(元)	金额(元)
1、银行间债券交易		
中国银行股份有限公司	29,824,298.63	140,373,213.59
2、银行间回购交易		
中国银行股份有限公司	-	190,905,000.00
3、银行间回购利息收入		
中国银行股份有限公司	-	-
4、银行间回购利息支出		
中国银行股份有限公司	-	176,402.41

4) 关联方投资本基金的情况

基金管理公司投资本基金的情况

本报告期及 2005 年度，基金管理公司均未投资本基金。

基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况

关联方名称	期末持有基金份额(份)		占总份额比例(%)	
	2006 年	2005 年	2006 年	2005 年
华泰证券有限责任公司	51,531,847.23	51,472,592.69	11.66	7.59

5) 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

关联方名称	期末保管的银行存款(元)		利息收入(元)	
	2006 年	2005 年	2006 年	2005 年
中国银行股份有限公司	114,602,966.02	38,099,108.63	957,424.32	999,754.08

本报告期，基金托管人中国银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

7、会计报表重要项目的说明

(1) 银行存款

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
银行活期存款	114,602,966.02	38,099,108.63
银行定期存款	-	-
合 计	114,602,966.02	38,099,108.63

(2) 交易保证金

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
深圳结算保证金	750,000.00	615,739.25
权证交易保证金	138,549.12	138,549.12
合 计	888,549.12	754,288.37

(3) 应收利息

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
-----	-------------	-------------

应收银行存款利息	26,975.81	14,516.33
应收结算备付金利息	358.16	107.03
应收权证保证金利息	68.53	68.53
应收债券利息	-	371,700.86
合 计	27,402.50	386,392.75

(4) 投资估值增值

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
股票估值增值	161,484,730.82	20,031,995.78
债券估值增值	-	-
权证估值增值	-	-
合 计	161,484,730.82	20,031,995.78

(5) 股票投资成本

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
期初股票投资成本	517,504,119.90	-
加：买入股票投资成本	1,100,663,308.46	939,015,692.36
减：卖出股票结转投资成本	1,183,332,465.68	418,285,406.30
减：因股权分置改革获得的现金对价	2,457,811.77	3,226,166.16
期末股票投资成本	432,377,150.91	517,504,119.90

(6) 待摊费用

本报告期末待摊费用余额为零。

(7) 应付佣金

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
应付华泰证券佣金	129,484.16	33,911.00
应付兴业证券佣金	36,868.35	-
应付中信建投佣金	86,402.36	96,907.88
应付国泰君安佣金	79,163.26	25,326.45
应付财富证券佣金	-	57,606.65
应付联合证券佣金	79,013.30	36,604.58
应付中信万通佣金	96,567.14	32,197.07
应付东方证券佣金	11,992.66	-
应付银河证券佣金	68,860.91	-
合 计	588,352.14	282,553.63

(8) 其他应付款

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
应付券商垫付保证金	750,000.00	500,000.00
合 计	750,000.00	500,000.00

(9) 预提费用

项 目	2006年12月31日	2005年12月31日
预提信息披露费	200,000.00	-
预提审计费用	61,000.00	80,000.00
合 计	261,000.00	80,000.00

(10) 实收基金

项 目	2006年	2005年
期初实收基金	678,263,941.86	900,519,775.77
加：本期申购基金	545,688,973.21	302,429,802.90
其中：红利再投资基金份额	30,736,551.66	4,596,052.55
减：本期赎回基金	781,882,627.74	524,685,636.81
期末实收基金	442,070,287.33	678,263,941.86

(11) 未实现利得

项 目	2006年	2005年
期初未实现利得	13,801,588.53	-
加：本期投资估值增值变动数	141,452,735.04	20,031,995.78
加：本期申购的未实现利得平准金	49,083,971.47	-934,282.42
其中：红利再投资的未实现利得平准金	2,247,071.51	70,914.57
减：本期赎回的未实现利得平准金	81,724,243.93	5,296,124.83
期末未实现利得	122,614,051.11	13,801,588.53

(12) 股票差价收入

项 目	2006年	2005年
卖出股票收入总额	1,507,842,551.75	423,189,520.73
减：卖出股票成本总额	1,183,332,465.68	418,285,406.30
交易佣金	1,270,976.06	354,600.03
卖出股票差价收入	323,239,110.01	4,549,514.40

(13) 债券差价收入

项 目	2006年	2005年
卖出债券收入总额	139,962,821.35	269,699,812.26
减：卖出债券成本总额	139,539,740.00	265,501,243.94
卖出债券应收利息	861,975.09	2,729,477.75
交易佣金	-	-
卖出债券差价收入	-438,893.74	1,469,090.57

(14) 权证差价收入

项 目	2006年	2005年
卖出权证收入总额	12,723,751.95	892,699.46
减：卖出权证成本总额	-	-
交易佣金	-	-

卖出权证差价收入	12,723,751.95	892,699.46
----------	---------------	------------

(15) 其他收入

项 目	2006年	2005年
基金合同生效前利息收入	-	123,821.47
赎回费收入	1,112,702.67	666,857.05
新股手续费返还	-	293.04
新债手续费返还	-	10,000.00
合 计	1,112,702.67	800,971.56

(16) 其他费用

项 目	2006年	2005年
信息披露费	300,000.00	200,000.00
审计费用	61,000.00	80,000.00
债券托管账户服务费	18,000.00	10,290.00
交易所回购交易费用	-	16,953.76
其他费用	3,813.50	2,744.50
合 计	382,813.50	309,988.26

(17) 已分配基金净收益

项 目	2006 年			2005 年
	2006-03-10	2006-06-09	2006-11-20	2005-8-23
基金份额分红金额	0.05	0.20	0.125	0.03
分配总金额	27,739,109.56	109,121,858.90	61,190,703.59	19,373,414.61
其中：现金红利	22,250,564.91	87,378,369.67	53,282,055.60	14,695,093.88
现金红利再投资	5,488,544.65	21,743,489.23	7,908,647.99	4,678,320.73

8、报告期末流通转让受到限制的基金资产的说明

(1) 因股权分置改革而停牌的股票

本基金截至 2006 年 12 月 31 日持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。停牌期间,这些股票的估值方法采用停牌前收盘价估值。

股票代码	股票名称	停牌日期	数量	总成本	估值单价	总市值	复牌日期	复牌开盘单价
方案实施阶段停牌：								
000549	S湘火炬	06-12-19	2,342,342	12,837,479.97	8.90	20,846,843.80	未知	未知

(2) 基金参与新股申购流通受限的股票

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申购。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的申购协议的规定,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。

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	数量	总成本	总市值	占基金资产净值比例(%)	估值方法	流通受限原因	受限期限
601006	大秦铁路	42,504	210,394.80	344,282.40	0.05	收盘价	网下公开发行未流通	2007-02-01起流通
601628	中国人寿	57,000	1,076,160.00	1,076,160.00	0.16	成本价	网上申购未上市	2007-01-09起流通

9、有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

自基金合同生效日起至本报告期末,本基金未投资非公开定向增发的流通受限制的股票;未投资可分离交易的可转债;未投资资产支持证券。

六、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)	占基金资产总值比例(%)
股票	593,861,881.73	83.61
债券	-	-
权证	-	-
银行存款和清算备付金合计	115,326,518.20	16.24
资产支持证券	-	-
其他资产	1,051,106.97	0.15
合计	710,239,506.90	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	-	-
B 采掘业	25,674,556.62	3.72
C 制造业	360,550,834.12	52.27
C0 食品、饮料	47,153,260.00	6.84
C1 纺织、服装、皮毛	-	-
C2 木材、家具	9,105,740.00	1.32
C3 造纸、印刷	18,561,947.35	2.69
C4 石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5 电子	8,734,231.24	1.27
C6 金属、非金属	61,060,400.18	8.85
C7 机械、设备、仪表	162,447,032.41	23.55
C8 医药、生物制品	53,488,222.94	7.75
C99 其他制造业	-	-

D 电力、煤气及水的生产和供应业	1,598,881.40	0.23
E 建筑业	19,928,140.50	2.89
F 交通运输、仓储业	68,865,758.03	9.98
G 信息技术业	3,062,867.60	0.44
H 批发和零售贸易	12,747,746.99	1.85
I 金融、保险业	64,585,624.83	9.36
J 房地产业	36,847,471.64	5.34
K 社会服务业	-	-
L 传播与文化产业	-	-
M 综合类	-	-
合计	593,861,881.73	86.09

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	2,063,600	47,153,260.00	6.84
2	600036	招商银行	2,273,769	37,198,860.84	5.39
3	000157	中联重科	1,471,408	32,709,399.84	4.74
4	600325	华发股份	2,198,218	30,291,444.04	4.39
5	600019	宝钢股份	3,432,615	29,726,445.90	4.31
6	000549	S 湘火炬	2,342,342	20,846,843.80	3.02
7	600496	长江精工	2,850,950	19,928,140.50	2.89
8	000651	格力电器	1,576,894	18,717,731.78	2.71
9	600308	华泰股份	1,361,845	18,561,947.35	2.69
10	600009	上海机场	979,916	18,530,211.56	2.69
11	600686	金龙汽车	1,060,492	18,091,993.52	2.62
12	000837	秦川发展	1,890,266	17,031,296.66	2.47
13	001696	宗申动力	1,590,692	15,509,247.00	2.25
14	000022	深赤湾 A	788,357	14,434,816.67	2.09
15	601006	大秦铁路	1,703,008	13,794,365.00	2.00
16	600104	上海汽车	1,632,268	13,335,629.56	1.93
17	600849	上海医药	1,887,712	12,855,318.72	1.86
18	600521	华海药业	939,900	12,726,246.00	1.84
19	600125	铁龙物流	1,534,000	12,686,180.00	1.84
20	600535	天士力	775,517	11,958,472.14	1.73
21	600005	武钢股份	1,806,000	11,486,160.00	1.67
22	600123	兰花科创	577,850	11,458,765.50	1.66
23	601398	工商银行	1,707,920	10,589,104.00	1.54
24	600361	华联综超	457,711	10,568,546.99	1.53
25	000039	中集集团	544,914	10,266,179.76	1.49
26	000001	S 深发展 A	650,561	9,413,617.67	1.36
27	600978	宜华木业	674,000	9,105,740.00	1.32
28	600028	中国石化	957,101	8,728,761.12	1.27

29	000625	长安汽车	934,000	8,331,280.00	1.21
30	600518	康美药业	682,959	7,382,786.79	1.07
31	600026	中海发展	676,100	6,997,635.00	1.01
32	600085	同仁堂	364,581	6,263,501.58	0.91
33	600469	风神股份	1,090,000	5,777,000.00	0.84
34	600348	国阳新能	369,000	5,487,030.00	0.80
35	600870	厦华电子	1,058,319	5,037,598.44	0.73
36	000951	中国重汽	191,000	4,775,000.00	0.69
37	600016	民生银行	327,000	3,335,400.00	0.48
38	002028	思源电气	106,300	3,179,433.00	0.46
39	600030	中信证券	108,564	2,972,482.32	0.43
40	600585	海螺水泥	79,999	2,399,970.00	0.35
41	000002	万科A	154,415	2,384,167.60	0.35
42	600533	栖霞建设	210,000	2,379,300.00	0.34
43	000807	云铝股份	215,972	2,302,261.52	0.33
44	002045	广州国光	163,378	2,254,616.40	0.33
45	002024	苏宁电器	48,000	2,179,200.00	0.32
46	600660	福耀玻璃	140,900	2,081,093.00	0.30
47	000060	中金岭南	113,000	1,958,290.00	0.28
48	600383	金地集团	97,000	1,792,560.00	0.26
49	600570	恒生电子	189,930	1,770,147.60	0.26
50	000528	柳工	99,000	1,692,900.00	0.25
51	600557	康缘药业	173,925	1,648,809.00	0.24
52	600269	赣粤高速	187,000	1,587,630.00	0.23
53	002008	大族激光	69,730	1,442,016.40	0.21
54	600310	桂东电力	129,996	1,319,459.40	0.19
55	600410	华胜天成	52,000	1,292,720.00	0.19
56	601628	中国人寿	57,000	1,076,160.00	0.16
57	000927	一汽夏利	197,000	1,061,830.00	0.15
58	000612	焦作万方	100,000	840,000.00	0.12
59	600270	外运发展	104,800	822,680.00	0.12
60	600089	特变电工	54,755	818,587.25	0.12
61	000538	云南白药	26,239	653,088.71	0.09
62	600312	平高电气	38,000	568,860.00	0.08
63	600900	长江电力	28,600	279,422.00	0.04
64	601333	广深铁路	1,700	12,240.00	0.00
		合计		593,861,881.73	86.09

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 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)	占期初资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	44,764,973.87	6.55
2	600028	中国石化	33,246,363.30	4.87

3	600031	三一重工	29,072,483.26	4.26
4	600325	华发股份	28,720,691.32	4.20
5	600870	厦华电子	28,154,992.62	4.12
6	600009	上海机场	26,842,994.49	3.93
7	600019	宝钢股份	26,667,029.97	3.90
8	000024	招商地产	26,546,743.57	3.89
9	600030	中信证券	25,533,029.25	3.74
10	600085	同仁堂	25,125,533.98	3.68
11	600036	招商银行	24,777,637.33	3.63
12	000002	万 科 A	24,191,110.47	3.54
13	000549	S 湘火炬	23,760,190.62	3.48
14	600557	康缘药业	21,130,324.35	3.09
15	000837	秦川发展	20,514,651.82	3.00
16	000157	中联重科	19,213,895.52	2.81
17	600418	江淮汽车	18,907,538.59	2.77
18	600900	长江电力	18,707,281.77	2.74
19	600361	华联综超	18,596,346.92	2.72
20	600496	长江精工	17,520,439.86	2.57
21	000651	格力电器	17,493,068.52	2.56
22	600018	上港集团	17,446,439.27	2.55
23	600639	浦东金桥	16,540,178.59	2.42
24	600050	中国联通	16,426,898.22	2.40
25	600521	华海药业	15,436,087.52	2.26
26	600337	美克股份	15,235,335.10	2.23
27	600423	柳化股份	15,217,426.08	2.23
28	601398	工商银行	15,156,848.92	2.22
29	600585	海螺水泥	14,979,249.74	2.19
30	600535	天士力	14,958,611.68	2.19
31	600005	武钢股份	14,704,952.00	2.15
32	600125	铁龙物流	14,206,423.11	2.08
33	600308	华泰股份	14,103,683.09	2.06
34	600686	金龙汽车	13,997,928.67	2.05
35	600104	上海汽车	13,764,953.50	2.02
36	000063	中兴通讯	13,693,838.07	2.00

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 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)	占期初资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	59,448,659.51	8.70
2	600309	烟台万华	51,833,432.26	7.59
3	600028	中国石化	45,147,906.96	6.61
4	600018	上港集团	44,772,469.23	6.55
5	600031	三一重工	44,313,528.68	6.49
6	000002	万 科 A	41,774,711.78	6.12
7	600900	长江电力	41,305,018.88	6.05

8	600870	厦华电子	40,025,217.23	5.86
9	000063	中兴通讯	38,825,062.13	5.68
10	600639	浦东金桥	38,342,950.47	5.61
11	600361	华联综超	35,939,975.11	5.26
12	600547	山东黄金	35,261,534.09	5.16
13	600761	安徽合力	34,583,344.80	5.06
14	000792	盐湖钾肥	32,863,127.40	4.81
15	600418	江淮汽车	32,810,751.55	4.80
16	600085	同仁堂	32,777,229.12	4.80
17	600009	上海机场	32,374,710.70	4.74
18	000024	招商地产	32,348,627.66	4.74
19	600030	中信证券	30,545,022.23	4.47
20	600270	外运发展	28,478,235.37	4.17
21	600550	天威保变	26,082,492.75	3.82
22	600519	贵州茅台	23,642,620.70	3.46
23	600019	宝钢股份	23,640,133.74	3.46
24	600050	中国联通	22,976,783.70	3.36
25	600337	美克股份	22,429,267.01	3.28
26	600535	天士力	22,317,524.69	3.27
27	600557	康缘药业	22,167,983.72	3.25
28	600886	国投电力	21,025,059.33	3.08
29	600029	S 南航	19,853,360.80	2.91
30	600423	柳化股份	18,673,560.69	2.73
31	600276	恒瑞医药	18,660,657.65	2.73
32	600835	上海机电	18,057,010.63	2.64
33	000866	扬子退市	17,118,111.81	2.51
34	600585	海螺水泥	16,968,802.72	2.48
35	000837	秦川发展	16,232,343.04	2.38
36	600205	S 山东铝	15,804,796.08	2.31
37	000651	格力电器	15,785,535.51	2.31
38	000858	五粮液	15,690,595.31	2.30
39	600458	时代新材	15,548,307.35	2.28
40	600012	皖通高速	15,288,799.33	2.24
41	600348	国阳新能	14,051,932.90	2.06
42	600236	桂冠电力	13,756,044.42	2.01
43	600000	浦发银行	13,692,429.42	2.00

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票成本总额(元)	卖出股票收入总额(元)
1,100,663,308.46	1,507,842,551.75

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

截至本报告期末，本基金未持有债券。

(六) 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的，也没有在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、基金投资权证的情况**(1) 报告期末所有权证明细**

截至本报告期末，本基金未持有权证。

(2) 报告期内获得权证证明细

序号	代码	权证名称	数量	成本(元)	市值(元)	市值占资产净值比例(%)	获得方式
1	038008	钾肥 JTP1	365,931	-	-	-	被动持有
2	580005	万华 HXB1	323,175	-	-	-	被动持有
3	580007	长电 CWB1	414,481	-	-	-	被动持有
4	580993	万华 HXP1	484,762	-	-	-	被动持有
5	580996	沪场 JTP1	878,017	-	-	-	被动持有
6	580997	招行 CMP1	2,697,322	-	-	-	被动持有

4、基金其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	750,000.00
2	上海权证保证金	71,849.12
3	深圳权证保证金	66,700.00
4	应收利息	27,402.50
5	应收基金申购款	135,155.35
	合计	1,051,106.97

5、截至本报告期期末，本基金未持有可转换债券。

6、截至本报告期期末，本基金未持有资产支持证券；本报告期内，本基金未投资资产支持证券。

7、本报告期，基金管理公司未投资本基金。

八、基金份额持有人情况**(一) 报告期末基金份额持有人户数**

1	报告期末基金份额持有人户数(户)：	2,812
2	报告期末平均每户持有基金份额(份)：	157,208.49

(二) 报告期末基金份额持有人结构

序号	持有人结构	数量(份)	占总份额比例(%)
	基金份额总额：	442,070,287.33	100
1	其中：机构投资者持有的基金份额	343,224,153.46	77.64
2	个人投资者持有的基金份额	98,846,133.87	22.36

九、开放式基金份额变动情况

序号	项目	份额(份)
1	基金合同生效日的基金份额总额	900,519,775.77
2	本报告期期初基金份额总额	678,263,941.86
3	本报告期期间总申购份额	545,688,973.21
4	本报告期期间总赎回份额	781,882,627.74
5	本报告期期末基金份额总额	442,070,287.33

十、重大事项揭示

(一) 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

(二) 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本基金管理人第一届董事会 2006 年第二次会议审议通过，李雄厚先生辞去公司副总经理的职务，有关临时公告刊登在 2006 年 9 月 11 日的中国证券报、上海证券报、证券时报。

经本基金管理人 2006 年第二次临时股东大会审议批准，Olin Wethington 先生自 2006 年 7 月 20 日起担任公司董事，Joel Epstein 先生辞去董事职务。

本报告期内，唐世春先生辞去本公司员工监事职务，2006 年 8 月 25 日起由陆音女士担任员工监事。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

(三) 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(四) 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

(五) 基金收益分配事项

报告期内基金进行了三次收益分配，每 10 份基金份额共分配 3.75 元。

(六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 61,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 年的审计服务。

(七) 基金管理人、基金托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处

罚。

(八) 基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订席位租用协议和证券研究服务协议。

3、基金租用证券公司专用席位数量

序号	证券公司	租用席位数量(个)
1	华泰证券有限责任公司	2
2	兴业证券股份有限公司	1
3	中信建投证券有限责任公司	1
4	国泰君安证券股份有限公司	1
5	联合证券有限责任公司	1
6	中信万通证券有限责任公司	1
7	东方证券股份有限公司	1
8	申银万国证券股份有限公司	1
9	中国银河证券有限责任公司	1
	合计	10

4、基金租用证券公司专用席位交易情况

交易/证券公司	2006年	
	金额(元)	比例(%)
1、股票交易		
华泰证券有限责任公司	441,535,750.98	17.00
兴业证券股份有限公司	259,531,312.38	9.99
中信建投证券有限责任公司	344,864,245.19	13.28
国泰君安证券股份有限公司	276,350,263.24	10.64
财富证券有限责任公司	218,323,029.84	8.41
联合证券有限责任公司	298,676,343.49	11.50
中信万通证券有限责任公司	311,188,150.10	11.98
东方证券股份有限公司	169,516,945.85	6.53

申银万国证券股份有限公司	192,680,636.65	7.42
中国银河证券有限责任公司	83,977,274.33	3.23
合计	2,596,643,952.05	100.00
2、债券交易	报告期内基金未进行交易所债券交易	
3、债券回购交易	报告期内基金未进行交易所债券回购交易	
4、权证交易		
华泰证券有限责任公司	1,535,166.49	12.06
兴业证券股份有限公司	3,072,353.27	24.14
中信建投证券有限责任公司	5,257,360.88	41.32
国泰君安证券股份有限公司	-	-
财富证券有限责任公司	1,892,891.09	14.88
联合证券有限责任公司	-	-
中信万通证券有限责任公司	-	-
东方证券股份有限公司	966,988.30	7.60
申银万国证券股份有限公司	-	-
中国银河证券有限责任公司	-	-
合计	12,724,760.03	100.00
5、佣金		
华泰证券有限责任公司	356,191.32	16.92
兴业证券股份有限公司	212,814.45	10.11
中信建投证券有限责任公司	282,785.77	13.43
国泰君安证券股份有限公司	226,607.57	10.76
财富证券有限责任公司	179,022.81	8.50
联合证券有限责任公司	244,913.74	11.63
中信万通证券有限责任公司	243,507.12	11.57
东方证券股份有限公司	132,648.40	6.30
申银万国证券股份有限公司	157,996.67	7.50
中国银河证券有限责任公司	68,860.91	3.27
合计	2,105,348.76	100.00

5、本报告期内租用证券公司席位的变更情况

本报告期内，基金管理人代表基金新增租用了东方证券、申银万国证券和中国银河证券的专用交易席位，并退租了财富证券的席位。

(九) 其它事项

重大事件	信息披露报纸	披露日期
暂停申购业务公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 2 月 24 日
2006 年第一次分红预告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 3 月 8 日
2006 年第一次分红公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 3 月 11 日
增加深圳发展银行为基金代 销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 4 月 4 日

增加招商银行为基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 5 月 10 日
申购费率优惠公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 6 月 2 日
增加湘财证券,东北证券,上海证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 6 月 2 日
2006 年第二次分红预告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 6 月 5 日
更新招募说明书摘要(第 2 次)	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 6 月 9 日
在深圳发展银行开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 6 月 9 日
2006 年第二次分红公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 6 月 12 日
增加交通银行为基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 8 月 18 日
2006 年第三次分红预告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 11 月 16 日
2006 年第三次分红公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 11 月 21 日
更新招募说明书摘要(第 3 次)	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2006 年 12 月 8 日

十一、备查文件

(一) 备查文件目录

- 1、中国证监会批准友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金的公告

(二) 存放地点和查阅方式

存放地点：上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼

查阅方式：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(三) 咨询方法

投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人友邦华泰基金管理有限公司。

客户服务中心：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638

公司网址：www.aig-huatai.com

友邦华泰基金管理有限公司

二 七年三月二十八日