

# 海富通风格优势股票型证券投资基金 2007 年半年度报告

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2007.8.28

## 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。本半年度报告已经董事会全体独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 24 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。

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

## 目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标和基金净值表现.....	2
三、管理人报告.....	4
（一）基金管理人及基金经理情况.....	4
（二）报告期内基金运作的遵规守信情况的说明.....	4
（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释.....	4
（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	5
四、托管人报告.....	5
五、财务会计报告.....	6
（一）半年度会计报表.....	6
（二）半年度会计报表附注.....	8
六、投资组合报告.....	15
七、基金份额持有人情况.....	22
八、开放式基金份额变动情况.....	23
九、重大事件揭示.....	23
十、备查文件.....	25

## 一、基金简介

### (一) 基金基本资料

- 1、基金名称：海富通风格优势股票型证券投资基金
- 2、基金简称：海富通优势
- 3、交易代码：519013
- 4、基金运作方式：契约型开放式
- 5、基金合同生效日：2006年10月19日
- 6、报告期末基金份额总额：5,743,723,695.79份
- 7、基金合同存续期：无
- 8、基金份额上市的证券交易所：无
- 9、上市日期：无

### (二) 基金产品说明

1、投资目标：在适度控制风险并保持资产良好流动性的前提下，通过积极选择不同风格优势的股票，力争为投资者提供长期稳定的超额回报。

2、投资策略：本基金将在适度的大类资产配置的基础上，运用“风格优选，积极轮换，精选个股”策略，把握不同风格优势策略在不同阶段的变动趋势和投资机会，并在策略内自下而上精选个股，实现基金资产的超额收益。本基金的投资策略主要包括资产配置策略、风格轮换策略和精选证券策略。

3、业绩比较基准：MSCI China A × 75% + 上证国债指数 × 25%。

4、风险收益特征：本基金是股票型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

### (三) 基金管理人

- 1、名称：海富通基金管理有限公司
- 2、注册地址：上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼
- 3、办公地址：上海浦东新区世纪大道88号金茂大厦37楼
- 4、邮政编码：200121
- 5、法定代表人：邵国有
- 6、信息披露负责人：奚万荣
- 7、联系电话：021-68604999-591
- 8、传真：021-50479057
- 9、电子邮箱：wrxixi@hftfund.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：北京市西城区金融大街25号

- 3、办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
- 4、邮政编码：100032
- 5、法定代表人：郭树清
- 6、信息披露负责人：尹东
- 7、联系电话：010-67595104
- 8、传真：010-66275853
- 9、电子邮箱：yindong@ccb.cn

#### (五)信息披露

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.hftfund.com>  
 本报告置备地点：基金管理人及基金托管人的办公场所

#### (六)其他有关资料

##### 基金注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司  
 办公地址：北京市西城区金融大街27号投资广场23层

## 二、主要财务指标和基金净值表现

所述基金业绩指标不包括持有人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	
1	基金本期净收益	2,657,704,063.53 元
2	基金份额本期净收益	0.2981 元
3	期末可供分配基金收益	1,484,199,889.47 元
4	期末可供分配基金份额收益	0.2584 元
5	期末基金资产净值	8,199,743,283.44 元
6	期末基金份额净值	1.428 元
7	基金加权平均净值收益率	25.54%
8	本期基金份额净值增长率	52.88%
9	基金份额累计净值增长率	106.08%

注：本基金合同生效日为2006年10月19日，以上财务指标中“本期”指2007年1月1日至2007年6月30日止期间。

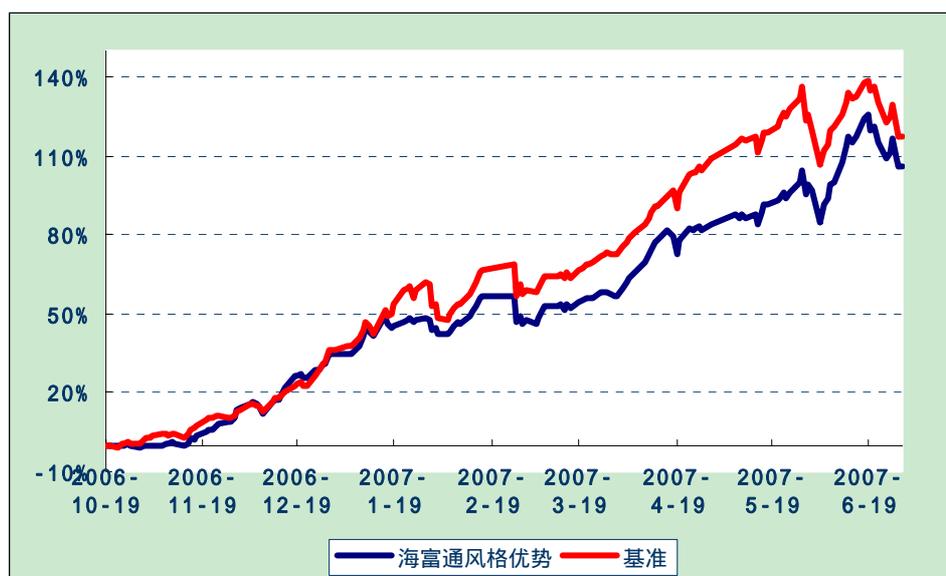
## (二) 基金净值表现

### 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：

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)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1) - (3)	(2) - (4)
过去 1 个月	3.33%	2.62%	-3.62%	2.33%	6.95%	0.29%
过去 3 个月	31.61%	2.03%	25.88%	1.95%	5.73%	0.08%
过去 6 个月	52.88%	1.80%	59.36%	1.92%	-6.48%	-0.12%
自基金合同生效起至今	106.08%	1.65%	117.19%	1.71%	-11.11%	-0.06%

### 2、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变动的比较 海富通风格优势股票型证券投资基金基金(海富通优势)累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

(2006年10月19日至2007年6月30日)



- (1) 本基金合同于2006年10月19日生效,截至报告日本基金合同生效未满一年。
- (2) 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。建仓期满至今,本基金投资组合均达到本基金合同第十二条(二)(六)规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

### 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

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。本海富通风格优势股票型证券投资基金是基金管理人管理的第六只开放式基金；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、海富通股票证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金和海富通精选贰号混合型证券投资基金六只开放式基金。

##### 2、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，2007年4月起兼任海富通精选贰号基金基金经理。

丁俊先生，硕士。2002年7月至2006年4月就职于平安资产管理公司，曾任权益投资部研究主管，2006年4月加入海富通基金管理有限公司，现任海富通精选基金、海富通风格优势基金和海富通精选贰号基金基金经理助理。

#### (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、《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》、《海富通风格优势股票型证券投资基金招募说明书》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

二零零七年上半年，A股市场延续了二零零六年的单边上扬，截至6月30日上证综指涨幅达到42.8%。强劲的宏观经济和持续超越预期的上市公司业绩成为指数不断创出新高的根本动力。由此激发的股市赚钱效应也唤醒了储蓄资金的投资意识，新增资金源源不断涌入A股市场。但低价绩差股的持续暴涨导致了A股市场的结构性泡沫。同时政府为抑制流动性和宏观经济热度，陆续出台了发行特别国债、降低出口退税、QDII等政策。在此综合影响下A股市场再次出现了宽幅振荡走势，一批得益于宏观经济高速增长而业绩超越预期的蓝筹公司成为市场稳定的中流砥柱，市场重新回归到价值判断时代。行业方面，天相行业指数中有22个涨幅超过了100%，贸易、综合、化纤、纺织服装和交通仓储涨幅居前。

针对上述市场特征,海富通优势基金风格上向大盘股和价值股转移,适当降低中小盘股配置比例,并从三个角度对持仓进行了结构调整:一是基于人民币加速升值的判断,重点配置了保险、地产等受益行业的龙头公司;二是在二零零六年涨幅相对滞后的行业如家电、汽车中,积极挖掘低估的优势公司加以持有;三是自下而上选择宏观经济高速增长背景下业绩有望继续超越预期的公司。考虑到海富通优势基金年初大比例分红后规模迅速膨胀,净值增长落后于本期业绩基准。

报告期内,海富通优势基金净值上涨 52.88%,同期业绩基准上涨 59.36%,超额收益为-6.48 个百分点。

#### **(四) 宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

海富通认为,未来中国经济依然将在出口、消费、投资三架马车齐头并进的拉动下保持高速增长态势,为 A 股市场持续走牛奠定坚实的基础。而政府为防止经济由偏快向过快发展,预计还将继续落实和出台市场化的宏观调控政策。但也应该看到,市场化的宏观调控政策有利于优化经济发展结构,拉长经济上升周期,促进上市公司业绩继续保持高速增长。

基于此海富通优势基金风格上将侧重于成长类资产,着重关注以下投资方向:一是继续把握人民币加速升值的主线,在金融、地产、航空等受益行业中积极寻觅优势公司;二是针对国家陆续推出的节能减排、淘汰落后产能等相关政策,选择能够从中获益的龙头公司;三是关注外延式增长,挖掘有实质性变化的资产重组和注入;四是继续寻觅全球产业转移和中国产业结构升级下存在飞跃发展机会的公司;五是选择能在奥运经济中切实受益且能以此为契机提升自身核心竞争力的公司。

#### **四、托管人报告**

中国建设银行股份有限公司根据《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》和《海富通风格优势股票型证券投资基金托管协议》,托管海富通风格优势股票型证券投资基金(以下简称海富通优势基金)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在海富通优势基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,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基金托管人应尽的义务。

本报告期,按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,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优势基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由海富通优势基金管理人-海富通基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的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真实、准确和完整。

## 五、财务会计报告

### (一): 半年度会计报表

#### 1、资产负债表

2007年6月30日资产负债表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

	附注	2007年 6月30日	2006年 12月31日
资产			
银行存款		729,081,363.96	226,558,581.38
清算备付金		14,012,610.14	12,173,115.21
交易保证金		9,032,466.04	250,000.00
应收证券清算款		661,373.14	0.00
应收股利		321,367.50	0.00
应收利息	1	7,293,475.75	672,567.40
应收申购款		6,865,748.36	7,291,707.22
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		6,955,987,192.80	2,381,507,885.56
其中: 股票投资成本		4,930,574,693.36	1,773,555,743.21
债券投资市值		442,508,819.62	135,684,000.00
其中: 债券投资成本		442,560,517.33	135,494,737.94
权证投资市值		160,000,000.00	40,299,792.00
其中: 权证投资成本		95,381,981.66	34,854,187.63
买入返售证券		0.00	0.00
资产总计		8,325,764,417.31	2,804,437,648.77
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		10,916,426.59	6,903,819.96
应付赎回款		93,572,958.36	63,347,464.81
应付赎回费		349,046.38	238,495.70
应付管理人报酬		10,871,991.53	3,478,291.27
应付托管费		1,811,998.58	579,715.20
应付佣金	2	7,499,156.82	2,664,190.39
应付利息		0.00	0.00
其他应付款	3	750,000.00	250,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
预提费用	4	249,555.61	143,492.04
负债合计		126,021,133.87	77,605,469.37
持有人权益			

实收基金	5	5,743,723,695.79	2,023,268,021.61
未实现利得	6	971,819,698.18	548,265,171.58
未分配基金净收益		1,484,199,889.47	155,298,986.21
持有人权益合计		8,199,743,283.44	2,726,832,179.40
(2007年6月30日每单位基金资产净值：1.428元)			
(2006年12月31日每单位基金资产净值：1.348元)			
负债及持有人权益总计		8,325,764,417.31	2,804,437,648.77

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## 2、经营业绩表及收益分配表

2007年半年度经营业绩、收益分配表  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	2007.1.1 - 2007.6.30
<b>收入</b>		
股票差价收入	7	2,608,458,665.90
债券差价收入	8	1,824,564.23
权证差价收入	9	68,652,489.56
债券利息收入		6,703,491.94
存款利息收入		9,099,853.29
股利收入		35,400,008.55
买入返售证券收入		5,713,609.11
其他收入	10	14,804,892.52
收入合计		2,750,657,575.10
<b>费用</b>		
基金管理人报酬		77,694,665.80
基金托管费		12,949,110.94
卖出回购证券支出		2,002,276.73
其他费用	11	307,458.10
其中：信息披露费		176,475.00
审计费用		49,588.57
费用合计		92,953,511.57
基金净收益		2,657,704,063.53
加：未实现估值增值/(减值)变动数	6	1,476,391,811.29
基金经营业绩		4,134,095,874.82
基金净收益		2,657,704,063.53

加：期初基金净收益		155,298,986.21
本期申购基金份额的损益平准金		309,993,564.90
本期赎回基金份额的损益平准金		(685,635,907.25)
可供分配基金净收益		<u>2,437,360,707.39</u>
减：本期已分配基金净收益	12	<u>(953,160,817.92)</u>

未分配基金净收益 1,484,199,889.47  
后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

### 3、基金净值变动表

2007 年半年度基金净值变动表  
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

2007.1.1 - 2007.6.30

期初基金净值		<u>2,726,832,179.40</u>
本期经营活动		
基金净收益		2,657,704,063.53
未实现估值增值/(减值)变动数		<u>1,476,391,811.29</u>
经营活动产生的基金净值变动数		<u>4,134,095,874.82</u>
本期基金份额交易		
基金申购款		14,027,639,205.42
其中：分红再投资		<u>326,300,174.88</u>
基金赎回款		<u>11,735,663,158.28</u>
基金份额交易产生的基金净值变动数		<u>2,291,976,047.14</u>
本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		<u>953,160,817.92</u>
期末基金净值		<u>8,199,743,283.44</u>

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

## (二) 半年度会计报表附注

### 1. 本基金的基本情况

海富通风格优势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[2006]第179号《关于同意海富通风格优势股票型证券投资基金募集的批复》核准,由海富通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《海富通风格优势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2,217,258,171.44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(2006)第136号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同》于2006年10月19日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为2,218,085,859.91份基金份额,其中认购资金利息折合827,688.47份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通风格优势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的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。在通常市场情况下,基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%,权证投资0%-3%,现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%,其中基金保留的现金或者投资于一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

2、半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相一致。基金因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价冲减股票投资成本。本基金原比较基准中的上证指数自2007年1月1日起调整为MSCI China A指数,相应的基准权重不变。

3、根据财政部、国家税务总局财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,从2007年5月30日起,基金买卖股票按3‰缴纳股票交易印花税。

4、本报告期无重大会计差错。

5、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

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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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。

## (2) 关联方交易

通过关联方席位进行的交易：

2007年1月1日至2007年6月30日						
	买卖股票成交量		买卖债券成交量		买卖权证成交量	
	成交量	占本期成交量	成交量	占本期成交量的比例	成交量	占本期成交量
海通证券	人民币元	的比例	人民币元	的比例	人民币元	的比例
	9,648,576,439.60	39.45%	388,785,831.60	54.15%	285,153,190.96	64.68%
	买卖回购成交量		交易佣金			
	成交量	占本期成交量	佣金	占本期佣金总量的比例		
	人民币元	的比例	人民币元	的比例		
	1,342,000,000.00	11.61%	8,034,671.71	39.89%		

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。

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。

### 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。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 77,694,665.80 元。

### 基金托管费

支付基金托管人中国建设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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 12,949,110.94 元。

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建设银行保管，并按银行间同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 729,081,363.96 元(2006 年 6 月 30 日：无)。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 8,659,469.76 元(2006 年上半年度：无)。

本基金在本报告期内与关联方中国建设银行之间通过银行间同业市场进行交易情况如下：

	2007年1月1日 至2007年6月30日 (单位：人民币元)
买入债券结算金额	0.00
卖出债券结算金额	0.00
卖出回购证券协议金额	158,400,000.00
卖出回购证券利息支出	57,284.38

本基金关联方及其控制机构在本报告期内从未持有本基金份额。

## 6、基金会计报表重要项目说明

### (1) 应收利息

	2007年6月30日 (单位：人民币元)
应收债券利息	7,122,552.58
应收银行存款利息	164,487.64
应收清算备付金利息	6,316.85
应收直销申购款利息	118.68
应收权证交易保证金利息	0.00
	<hr/> 7,293,475.75 <hr/>

### (2) 应付佣金

	2007年6月30日 (单位：人民币元)
中国国际金融有限公司	2,876,742.87
中银国际证券责任有限公司	1,499,575.03
海通证券股份有限公司	1,460,795.87
申银万国证券股份有限公司	1,063,196.39
招商证券股份有限公司	598,846.66
中信证券股份有限公司	0.00
	<hr/> 7,499,156.82 <hr/>

### (3) 其他应付款

	2007年6月30日 (单位：人民币元)
应付券商席位保证金	750,000.00

750,000.00

(4) 预提费用

2007年6月30日	
(单位:人民币元)	
信息披露费	199,967.04
审计费用	49,588.57
	249,555.61

(5) 实收基金

	基金份额数	基金份额面值
	(单位:份)	(单位:人民币元)
2006年12月31日	2,023,268,021.61	2,023,268,021.61
本期申购	13,627,270,610.06	13,627,270,610.06
其中: 红利再投资	323,069,474.40	323,069,474.40
本期赎回	(9,906,814,935.88)	(9,906,814,935.88)
2007年6月30日	5,743,723,695.79	5,743,723,695.79

(6) 未实现利得

	单位:人民币元		
	未实现估值 增值/(减值) (a)	未实现利得/ (损失)平准金	合计
2006年12月31日	613,587,008.78	(65,321,837.20)	548,265,171.58
本期净变动数	1,476,391,811.29	0.00	1,476,391,811.29
本期申购基金份额	0.00	90,375,030.46	90,375,030.46
其中: 红利再投资	0.00	(2,093,279.95)	(2,093,279.95)
本期赎回基金份额	0.00	(1,143,212,315.15)	(1,143,212,315.15)
2007年6月30日	2,089,978,820.07	(1,118,159,121.89)	971,819,698.18

(a) 未实现估值增值/(减值)按投资类别分项列示如下:

2007年6月30日	
(单位:人民币元)	
股票投资	2,025,412,499.44
权证投资	64,618,018.34
债券投资	(51,697.71)
	2,089,978,820.07

(7) 股票差价收入

2007年1月1日

	至 2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
卖出股票成交总额	12,205,946,813.56
减：应付佣金总额	(10,250,128.54)
减：卖出股票成本总额	(9,587,238,019.12)
	<u>2,608,458,665.90</u>

(8) 债券差价收入

	2007 年 1 月 1 日
	至 2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
卖出及到期兑付债券结算金额	1,869,364,510.61
减：应收利息总额	(16,740,293.63)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(1,850,799,652.75)
	<u>1,824,564.23</u>

(9) 权证差价收入

	2007 年 1 月 1 日
	至 2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
卖出权证成交金额	229,895,880.96
减：应付佣金总额	(207,476.71)
减：卖出权证成本总额	(161,035,914.69)
	<u>68,652,489.56</u>

(10) 其他收入

	2007 年 1 月 1 日
	至 2007 年 6 月 30 日
	(单位：人民币 元)
赎回基金补偿收入	14,248,597.85
转换基金补偿收入	208,941.46
其他	347,353.21
	<u>14,804,892.52</u>

(11) 其他费用

2007 年 1 月 1 日  
至 2007 年 6 月 30 日  
(单位：人民币 元)

信息披露费	176,475.00
审计费用	49,588.57
交易所回购交易费用	32,477.96
其他	48,916.57
	<u>307,458.10</u>

## (12) 收益分配

2007年1月1日			现金	再投资	发放红利
至2007年6月30日	登记日	分红率	形式发放(元)	形式发放(元)	合计(元)
		每10份基金			
第一次中期分红	2007/1/17	份额4.56元	626,860,643.04	326,300,174.88	953,160,817.92
			<u>626,860,643.04</u>	<u>326,300,174.88</u>	<u>953,160,817.92</u>

## 7、报告期末流通转让受到限制的基金资产的说明

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。因新股认购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。

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。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。

序号	股票代码	股票名称	类型	成功申购日期	流通受限截止日期	申购价格(元)	期末单价(元)	数量(股)	期末成本(元)	期末市值(元)	占基金净值的比例
1	600963	岳阳纸业	非公开发行	2007-3-26	2008-3-24	11.10	14.90	16,500,000	183,150,000.00	245,850,000.00	3.00%
2	000002	万科A	非公开发行	2006-12-25	2007-12-26	7.00	13.01	9,000,000	63,000,000.00	117,090,000.00	1.43%
3	601919	中国远洋	新股发行	2007-6-20	2007-9-25	8.48	18.26	352,030	2,985,214.40	6,428,067.80	0.08%
4	002128	露天煤业	新股发行	2007-4-10	2007-7-17	9.80	36.10	87,837	860,802.60	3,170,915.70	0.04%
5	002133	广宇集团	新股发行	2007-4-20	2007-7-26	10.80	17.79	119,692	1,292,673.60	2,129,320.68	0.03%
6	601008	连云港	新股发行	2007-4-17	2007-7-25	4.98	14.60	138,007	687,274.86	2,014,902.20	0.02%
7	002134	天津普林	新股发行	2007-4-26	2007-8-15	8.28	17.51	95,400	789,912.00	1,670,454.00	0.02%
8	002129	中环股份	新股发行	2007-4-10	2007-7-19	5.81	15.52	98,899	574,603.19	1,534,912.48	0.02%

9	002137	实益达	新股发行	2007-6-4	2007-9-12	10.30	47.19	25,390	261,517.00	1,198,154.10	0.01%
10	002135	东南网架	新股发行	2007-5-11	2007-8-29	9.60	23.24	46,891	450,153.60	1,089,746.84	0.01%
11	002132	恒星科技	新股发行	2007-4-17	2007-7-26	8.00	18.80	44,423	355,384.00	835,152.40	0.01%
12	002127	新民科技	新股发行	2007-4-10	2007-7-17	9.40	18.14	44,106	414,596.40	800,082.84	0.01%
13	002130	沃尔核材	新股发行	2007-4-10	2007-7-19	15.72	48.85	15,964	250,954.08	779,841.40	0.01%
14	002131	利欧股份	新股发行	2007-4-17	2007-7-26	13.69	30.31	19,284	263,997.96	584,498.04	0.01%
15	002136	安纳达	新股发行	2007-5-23	2007-8-29	8.08	22.81	14,784	119,454.72	337,223.04	0.00%
合计								26,602,707	255,456,538.41	385,513,271.52	4.70%

## 六、投资组合报告

### (一) 报告期末基金资产组合情况

资产类别	金额(元)	占基金总资产的比例
股票	6,955,987,192.80	83.55%
债券	442,508,819.62	5.31%
银行存款和清算备付金合计	743,093,974.10	8.93%
应收证券清算款	661,373.14	0.01%
权证	160,000,000.00	1.92%
其他资产	23,513,057.65	0.28%
合计	8,325,764,417.31	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)	市值占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	250,366,365.70	3.05%
C 制造业	2,948,487,960.54	35.96%
C0 食品、饮料	364,277,689.60	4.44%
C1 纺织、服装、皮毛	800,082.84	0.01%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	245,850,000.00	3.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	204,769,969.34	2.50%
C5 电子	5,158,560.58	0.06%
C6 金属、非金属	595,512,366.28	7.26%
C7 机械、设备、仪表	1,340,180,367.32	16.34%
C8 医药、生物制品	142,280,195.20	1.74%
C99 其他制造业	49,658,729.38	0.61%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	353,760,000.00	4.31%
E 建筑业	1,089,746.84	0.01%
F 交通运输、仓储业	417,211,370.00	5.09%

G 信息技术业	321,453,365.92	3.92%
H 批发和零售贸易	372,256,321.66	4.54%
I 金融、保险业	1,086,710,284.90	13.25%
J 房地产业	806,514,911.24	9.84%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化产业	157,080,000.00	1.92%
M 综合类	241,056,866.00	2.94%
合计	6,955,987,192.80	84.83%

### (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	期末数量(股)	期末市值 (人民币元)	市值占基金资产 净值的比例
1	601318	中国平安	5,099,990	364,700,284.90	4.45%
2	000002	万科A	21,000,000	346,530,000.00	4.23%
3	600786	东方锅炉	5,499,968	346,387,984.64	4.22%
4	600000	浦发银行	8,000,000	292,720,000.00	3.57%
5	600036	招商银行	11,000,000	270,380,000.00	3.30%
6	600963	岳阳纸业	16,500,000	245,850,000.00	3.00%
7	000527	美的电器	8,000,000	243,200,000.00	2.97%
8	000652	泰达股份	8,030,000	227,088,400.00	2.77%
9	000858	五粮液	7,000,000	220,220,000.00	2.69%
10	600415	小商品城	1,990,266	201,016,866.00	2.45%
11	000157	中联重科	5,200,000	200,200,000.00	2.44%
12	600019	宝钢股份	18,000,000	198,000,000.00	2.41%
13	601006	大秦铁路	12,000,000	181,680,000.00	2.21%
14	000983	西山煤电	6,415,000	181,095,450.00	2.21%
15	000825	太钢不锈	9,000,000	180,540,000.00	2.20%
16	600797	浙大网新	20,000,165	175,601,448.70	2.14%
17	600383	金地集团	5,000,000	171,100,000.00	2.09%
18	600030	中信证券	3,000,000	158,910,000.00	1.94%
19	600037	歌华有线	6,000,000	157,080,000.00	1.91%
20	600900	长江电力	10,000,000	151,200,000.00	1.84%
21	600718	东软股份	3,500,166	145,851,917.22	1.78%
22	000402	金融街	4,999,895	144,996,955.00	1.77%
23	600875	东方电机	2,232,962	142,641,612.56	1.74%
24	002007	华兰生物	3,420,197	142,280,195.20	1.73%
25	600641	万业企业	7,999,923	141,758,635.56	1.73%
26	002028	思源电气	2,116,816	133,105,390.08	1.62%
27	000528	柳工	5,063,660	124,059,670.00	1.51%
28	600886	国投电力	8,000,000	123,840,000.00	1.51%
29	600628	新世界	6,146,908	118,082,102.68	1.44%

30	000501	鄂武商 A	9,000,000	112,410,000.00	1.37%
31	600309	烟台万华	2,000,000	107,120,000.00	1.31%
32	600585	海螺水泥	1,785,375	105,265,710.00	1.28%
33	600176	中国玻纤	7,000,917	97,312,746.30	1.19%
34	000759	武汉中百	6,505,731	88,477,941.60	1.08%
35	600195	中牧股份	3,987,580	84,217,689.60	1.03%
36	600795	国电电力	6,000,000	78,720,000.00	0.96%
37	600219	南山铝业	3,000,000	68,070,000.00	0.83%
38	600495	晋西车轴	2,469,380	67,414,074.00	0.82%
39	600028	中国石化	5,000,000	66,100,000.00	0.81%
40	600519	贵州茅台	500,000	59,840,000.00	0.73%
41	000768	西飞国际	1,742,400	53,787,888.00	0.66%
42	600693	东百集团	3,017,343	53,286,277.38	0.65%
43	600208	中宝股份	3,999,909	48,878,887.98	0.60%
44	600529	山东药玻	3,388,876	42,801,503.88	0.52%
45	000572	海马股份	2,000,000	40,040,000.00	0.49%
46	600765	力源液压	817,000	28,799,250.00	0.35%
47	601919	中国远洋	352,030	6,428,067.80	0.08%
48	002128	露天煤业	87,837	3,170,915.70	0.04%
49	002133	广宇集团	119,692	2,129,320.68	0.03%
50	601008	连云港	138,007	2,014,902.20	0.02%
51	002137	实益达	41,390	1,953,194.10	0.02%
52	002134	天津普林	95,400	1,670,454.00	0.02%
53	002129	中环股份	98,899	1,534,912.48	0.02%
54	002135	东南网架	46,891	1,089,746.84	0.01%
55	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.01%
56	002127	新民科技	44,106	800,082.84	0.01%
57	002130	沃尔核材	15,964	779,841.40	0.01%
58	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.01%
59	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.00%
		股票投资合计：	293,549,134	6,955,987,192.80	84.83%

#### （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）	占期初基金资产净值的比例
1	601006	大秦铁路	634,100,977.65	23.25%
2	000858	五粮液	583,257,286.39	21.39%
3	600030	中信证券	572,122,128.56	20.98%
4	000793	华闻传媒	419,027,434.34	15.37%

5	600000	浦发银行	349,450,991.63	12.82%
6	600019	宝钢股份	334,035,544.78	12.25%
7	600037	歌华有线	314,204,115.41	11.52%
8	000002	万科A	302,974,078.25	11.11%
9	601398	工商银行	298,881,208.80	10.96%
10	000983	西山煤电	278,020,887.79	10.20%
11	600016	民生银行	260,730,492.10	9.56%
12	000625	长安汽车	253,265,025.58	9.29%
13	600036	招商银行	250,916,908.88	9.20%
14	600786	东方锅炉	245,030,313.18	8.99%
15	601318	中国平安	222,465,896.57	8.16%
16	600717	天津港	209,094,970.76	7.67%
17	600123	兰花科创	203,819,274.34	7.47%
18	600963	岳阳纸业	203,785,266.32	7.47%
19	000825	太钢不锈	194,358,501.16	7.13%
20	600270	外运发展	188,344,294.07	6.91%
21	000651	格力电器	178,664,358.49	6.55%
22	600797	浙大网新	175,973,183.19	6.45%
23	600005	武钢股份	173,955,544.27	6.38%
24	600028	中国石化	172,513,441.50	6.33%
25	000652	泰达股份	167,697,445.38	6.15%
26	600415	小商品城	163,515,752.66	6.00%
27	600628	新世界	156,608,868.48	5.74%
28	600195	中牧股份	155,599,800.71	5.71%
29	600886	国投电力	155,068,652.36	5.69%
30	600900	长江电力	146,731,706.56	5.38%
31	600718	东软股份	131,709,289.00	4.83%
32	600641	万业企业	130,488,980.58	4.79%
33	000402	金融街	129,570,209.22	4.75%
34	600176	中国玻纤	129,411,552.98	4.75%
35	600795	国电电力	129,157,398.06	4.74%
36	600383	金地集团	123,884,792.99	4.54%
37	600501	航天晨光	117,418,505.14	4.31%
38	601166	兴业银行	116,350,380.00	4.27%
39	000527	美的电器	107,850,910.50	3.96%
40	601699	潞安环能	107,411,016.15	3.94%
41	600309	烟台万华	105,708,621.72	3.88%
42	000501	鄂武商A	102,281,783.06	3.75%
43	000759	武汉中百	101,101,071.32	3.71%
44	002028	思源电气	98,856,478.86	3.63%
45	600528	中铁二局	93,911,838.58	3.44%

46	000768	西飞国际	92,552,621.94	3.39%
47	000777	中核科技	89,324,704.03	3.28%
48	000157	中联重科	89,218,035.96	3.27%
49	600348	国阳新能	88,729,590.38	3.25%
50	000528	柳 工	86,763,705.08	3.18%
51	002007	华兰生物	86,747,984.92	3.18%
52	600509	天富热电	86,574,371.40	3.17%
53	000012	南 玻 A	86,186,328.10	3.16%
54	600312	平高电气	85,179,943.96	3.12%
55	000927	一汽夏利	83,472,580.37	3.06%
56	600215	长春经开	82,957,022.13	3.04%
57	600125	铁龙物流	78,186,188.44	2.87%
58	000538	云南白药	76,289,868.76	2.80%
59	600835	上海机电	76,037,438.29	2.79%
60	600690	青岛海尔	74,768,709.26	2.74%
61	600495	晋西车轴	72,881,399.36	2.67%
62	600240	华业地产	70,798,418.69	2.60%
63	600849	上海医药	69,263,745.87	2.54%
64	600208	中宝股份	67,552,357.64	2.48%
65	600875	东方电机	66,200,937.81	2.43%
66	600895	张江高科	64,177,369.17	2.35%
67	600616	第一食品	61,046,186.70	2.24%
68	600236	桂冠电力	57,083,420.90	2.09%
69	600428	中远航运	56,732,400.57	2.08%
70	600511	国药股份	55,746,442.61	2.04%
71	600693	东百集团	54,696,170.40	2.01%

## 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）	占期初基金资产净值的比例
1	600030	中信证券	840,706,369.99	30.83%
2	000858	五 粮 液	789,044,611.24	28.94%
3	601006	大秦铁路	709,913,195.72	26.03%
4	000793	华闻传媒	490,415,314.66	17.98%
5	601398	工商银行	469,551,212.03	17.22%
6	000625	长安汽车	334,764,845.13	12.28%
7	600016	民生银行	334,027,390.18	12.25%
8	000002	万 科 A	299,237,106.14	10.97%
9	600717	天津港	299,088,113.24	10.97%
10	600000	浦发银行	240,609,450.80	8.82%

11	600037	歌华有线	240,500,825.60	8.82%
12	600028	中国石化	239,119,193.74	8.77%
13	000651	格力电器	236,367,075.39	8.67%
14	600036	招商银行	227,444,032.41	8.34%
15	601166	兴业银行	205,578,093.98	7.54%
16	600270	外运发展	205,225,215.25	7.53%
17	600123	兰花科创	192,668,430.35	7.07%
18	600019	宝钢股份	188,075,851.39	6.90%
19	601699	潞安环能	183,978,169.68	6.75%
20	600005	武钢股份	177,074,855.75	6.49%
21	600835	上海机电	161,819,713.92	5.93%
22	600583	海油工程	146,061,953.24	5.36%
23	000983	西山煤电	143,087,512.99	5.25%
24	600886	国投电力	130,135,173.61	4.77%
25	000528	柳 工	124,978,539.60	4.58%
26	600501	航天晨光	117,618,235.55	4.31%
27	600312	平高电气	115,984,949.59	4.25%
28	600528	中铁二局	115,149,546.55	4.22%
29	600509	天富热电	114,736,848.42	4.21%
30	600125	铁龙物流	113,356,366.31	4.16%
31	600195	中牧股份	112,344,518.56	4.12%
32	600616	第一食品	111,877,316.95	4.10%
33	000825	太钢不锈	110,426,689.14	4.05%
34	600240	华业地产	107,469,469.91	3.94%
35	600895	张江高科	105,903,921.75	3.88%
36	600639	浦东金桥	100,013,203.16	3.67%
37	000012	南 玻 A	98,163,252.73	3.60%
38	600849	上海医药	95,494,774.03	3.50%
39	600215	长春经开	95,076,589.22	3.49%
40	000538	云南白药	94,675,705.59	3.47%
41	600879	火箭股份	94,569,546.63	3.47%
42	000527	美的电器	94,468,386.09	3.46%
43	600859	王府井	93,920,230.64	3.44%
44	600690	青岛海尔	92,896,759.51	3.41%
45	600348	国阳新能	90,425,594.28	3.32%
46	000777	中核科技	87,020,322.17	3.19%
47	000157	中联重科	85,748,918.37	3.14%
48	600787	中储股份	83,394,850.35	3.06%
49	000927	一汽夏利	79,600,791.65	2.92%
50	600258	首旅股份	77,139,592.20	2.83%
51	600511	国药股份	76,850,222.20	2.82%

52	600236	桂冠电力	72,032,375.19	2.64%
53	600084	*ST 新天	64,753,374.04	2.37%
54	000759	武汉中百	63,977,497.55	2.35%
55	600797	浙大网新	60,665,115.22	2.22%
56	000501	鄂武商 A	60,130,504.90	2.21%
57	600697	欧亚集团	59,920,177.71	2.20%
58	601318	中国平安	58,316,701.70	2.14%
59	000024	招商地产	57,681,165.13	2.12%
60	600875	东方电机	56,943,474.80	2.09%
61	600795	国电电力	56,600,509.57	2.08%
62	600631	百联股份	55,250,710.07	2.03%
63	600428	中远航运	54,557,725.66	2.00%

### 3、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	卖出股票收入总额
12,744,256,969.27	12,205,946,813.56

### (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(元)	市值占净值比例
国债	52,135,224.00	0.64%
金融债券	59,988,000.00	0.73%
央行票据	330,385,595.62	4.03%
企业债	0.00	0.00%
可转换债券	0.00	0.00%
其他债券	0.00	0.00%
债券投资合计	442,508,819.62	5.40%

### (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(元)	市值占净值比例
07 央行票据 04	194,218,446.58	2.37%
06 央行票据 78	136,167,149.04	1.66%
06 进出 05	59,988,000.00	0.73%
02 国债	40,100,000.00	0.49%
21 国债	10,025,424.00	0.12%

### (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(元)	市值占净值比例
五粮 YGC1	160,000,000.00	1.95%

### (八) 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	数量(份)	成本(元)	期末持有数量(份)
1	030002	五粮 YGC1	主动投资	11,268,526	211,139,843.48	5,000,000
2	580013	武钢 CWB1	被动持有	4,498,472	10,423,865.24	0

### (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股票。
- 3、基金其他资产的构成

其他资产	金额(人民币元)
交易保证金	9,032,466.04
应收股利	321,367.50
应收利息	7,293,475.75
应收申购款	6,865,748.36
其他应收款	0.00
买入返售证券	0.00
待摊费用	0.00
合计	23,513,057.65

- 4、基金持有的处于转股期的可转换债券明细  
无。
- 5、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。
- 6、报告期内本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

### 七、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(户):	219,843
报告期末平均每户持有的基金份额(份):	26,126.48

#### (二) 报告期末基金份额持有人结构

项目	数量(份)	占总份额的比例
基金份额总额:	5,743,723,695.79	100.00%
其中:机构投资者持有的基金份额	227,019,647.95	3.95%
个人投资者持有的基金份额	5,516,704,047.84	96.05%

#### (三) 公司从业人员持有的基金份额的总量及占该只基金份额的比例

无。

## 八、开放式基金份额变动情况

单位：份	
基金合同生效日的基金份额总额	2,218,085,859.91
报告期期初份额总额	2,023,268,021.61
报告期期末基金份额总额	5,743,723,695.79
报告期内基金总申购份额	13,627,270,610.06
报告期内基金总赎回份额	9,906,814,935.88

## 九、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、报告期内，基金管理人、基金托管人的基金托管部门无重大人事变动。
- 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  
本基金于1月18日在《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》上发布第一次分红公告，向基金份额持有人按每10份基金份额派发红利4.56元。
- 6、报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。
- 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、本基金租用6家证券公司专用交易席位共7个，其中：报告期内本基金增加租用了中国国际金融有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中银国际证券责任有限公司5家证券公司专用交易席位5个。本基金租用的所有证券公司专用交易席位交易有关情况如下：

代号	券商名称	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	权证成交金额（元）	占权证成交总额
1	海通证券	9,648,576,439.60	39.45%	388,785,831.60	54.15%	285,153,190.96	64.68%
2	中金公司	6,520,680,798.57	26.66%	165,184,138.60	23.01%	24,472,226.16	5.55%
3	申银万国	2,859,481,494.44	11.69%	164,003,142.30	22.84%	0.00	0.00%
4	中银国际	2,369,330,282.79	9.68%	0.00	0.00%	131,221,819.93	29.77%
5	招商证券	1,821,976,867.38	7.45%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

6	中信证券	1,239,492,208.49	5.07%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
	合计	24,459,538,091.27	100.00%	717,973,112.50	100.00%	440,847,237.05	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	实付佣金（元）	实付佣金比率
1	海通证券	1,342,000,000.00	11.61%	8,034,671.71	39.89%
2	中金公司	5,466,500,000.00	47.30%	5,360,245.62	26.62%
3	申银万国	3,922,300,000.00	33.94%	2,331,987.88	11.58%
4	中银国际	0.00	0.00%	1,972,117.12	9.79%
5	招商证券	0.00	0.00%	1,425,714.01	7.08%
6	中信证券	825,600,000.00	7.15%	1,015,062.32	5.04%
	合计	11,556,400,000.00	100.00%	20,139,798.66	100.00%

上述佣金按市场佣金率计算，已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。

9、其他在报告期内发生的重大事件，以及基金管理人判断为重大事件的事项。

- (1.) 2007年1月18日、2月26日、3月9日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上分别刊登了关于增加中信金通证券、联合证券、国海证券为开放式基金代销机构的公告。
- (2.) 2007年1月20日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于海富通风格优势基金暂停申购及转换转入业务公告。
- (3.) 2007年1月22日、2月5日、4月23日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上分别刊登了关于旗下开放式基金在深圳发展银行、中信建投证券、广发证券开展网上交易费率优惠活动的公告。
- (4.) 2007年1月23日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于旗下基金代销机构天和证券变更为财通证券的公告。
- (5.) 2007年1月29日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于恢复海富通风格优势基金申购及转换转入业务公告。
- (6.) 2007年2月3日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于增加海富通风格优势基金经理的公告。
- (7.) 2007年2月13日、3月30日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上分别刊登了关于旗下基金申购重庆钢铁、武钢股份分离交易可转债的公告。
- (8.) 2007年3月10日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于变更基金经理的公告。
- (9.) 2007年3月27日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于旗下基金投资岳阳纸业非公开发行股票的公告。
- (10.) 2007年5月19日，本基金的管理人在《上海证券报》、《中国证券报》和《证券时报》上刊登了关于开通浦发银行卡网上交易的公告。

## 十、备查文件

### (一) 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立海富通风格优势股票型证券投资基金的文件
- 2、海富通风格优势股票型证券投资基金基金合同
- 3、海富通风格优势股票型证券投资基金招募说明书
- 4、海富通风格优势股票型证券投资基金托管协议
- 5、中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- 6、报告期内海富通风格优势股票型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 或 40088-40099

网址：[www.hftfund.com](http://www.hftfund.com)

海富通基金管理有限公司

2007 年 8 月 28 日