海富通股票证券投资基金 2008年年度报告摘要

基金管理人:海富通基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司

送出日期: 2009年3月26日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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。本年度报告已经全部独立董事签字同意,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2009年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本报告期自2008年1月1日起至12月31日止。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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	海富通股票
交易代码	519005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年7月29日
报告期末基金份额总额	7,996,017,037.21份

2.2 基金产品说明

投资目标	精选景气行业和积极主动精选股票投资相结合,分享中国经济高速成长的成果,谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金采用双层次的投资策略:第一层次主要通过对股票市场的系统性风险进行分析,确定股票和现金资产的配置比例;第二层次主要是通过对行业景气循环和个股的研究,精选适合本投资组合风险收益特征的股票。
业绩比较基准	80%MSCI China A+20%上证国债
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高风险、较高收益的股票型基金产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	奚万荣	宁敏
	联系电话	021-38650891	010-66594977
	电子邮箱	wrxi@hftfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-50479057	010-66594942

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告/半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告/半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008年	2007年	2006年
本期已实现收益	-2,993,170,816.48	2,678,984,620.54	639,713,766.47
本期利润	-4,769,223,262.97	2,810,351,426.05	891,994,974.24
加权平均基金份额本期利润	-0.5927	0.5304	1.1696
本期基金份额净值增长率	-58.77%	97.02%	131.41%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年
期末可供分配基金份额利润	-0.5790	0.0209	0.0090
期末基金资产净值	3,366,270,757.75	9,046,844,255.56	3,632,118,772.65
期末基金份额净值	0.421	1.021	1.068

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去三个月	-12.47%	2.22%	-12.48%	2.36%	0.01%	-0.14%
过去六个月	-30.98%	2.36%	-26.23%	2.32%	-4.75%	0.04%
过去一年	-58.77%	2.46%	-54.65%	2.37%	-4.12%	0.09%
过去三年	88.00%	2.02%	93.15%	1.87%	-5.15%	0.15%
自基金合同生效起至今	87.06%	1.90%	104.46%	1.78%	-17.40%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

海富通股票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图

2005年7月29日至2008年12月31日

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有关投资范围的规定,即股票资产70%-95%,一年期以内的国家债券和现金的比例不低于5%。即时满足第14章(七)有关投资组合限制的各项比例要求。

2、为了能更公允地体现基金投资业绩,海富通基金管理有限公司自2007年1月1日起调整海富通股票基金业绩比较基准中股票部分的基准。原比较基准中的上证指数将调整为MSCI China A指数,相应的基准权重不变。

3.2.3 本基金自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通股票证券投资基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图

注:图中列示的2005年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期7月29日(基金合同生效日)起至12月31日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	-	-	-	-	
2007年	9.190	1,114,199,107.39	1,215,340,846.47	2,329,539,953.86	
2006年	10.300	418,427,743.15	185,202,819.45	603,630,562.60	
合计	19.490	1,532,626,850.54	1,400,543,665.92	2,933,170,516.46	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 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。本海富通股票证券投资基金是基金管理人管理的第四只开放式基金;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、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势股票型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选股票型证券投资基金和海富通稳健添利债券型证券投资基金八只开放式基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蒋征	本基金的基金经理;海富通强化回报基金基金经理;股票组合管理部总监	2007-1-30	2009-1-12	12年	工商管理硕士,持有基金从业人员资格证书,历任中国保险信托投资公司业务经理,嘉实基金管理有限公司丰和基金基金经理助理,2003年1月至2004年4月任泰和基金基金经理,2004年8月至2006年5月任华夏基金管理有限公司华夏大盘精选基金基金经理,2005年12月至2006年5月任基金兴安基金经理,2006年6月加入海富通基金管理有限公司,2006年9月起任海富通强化回报基金基金经理,2007年1月至2009年1月兼任海富通股票基金基金经理,2007年10月起任股票组合管理部总监。
徐子函	本基金的基金经理助理;海富通强化回报基金基金经理助理	2008-1-9	2009-1-12	9年	硕士学位,持有基金从业人员资格证书。历任美国保诚集团M&G基金管理公司商业拓展分析师,2003年4月加入海富通基金管理有限公司,历任交易员、股票分析师,2008年1月至2009年1月任海富通股票基金和海富通强化回报基金基金经理助理。

注:1、任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准:自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》及其他有关法律法规、基金合同的规定,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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司自成立以来,就建立有公平交易制度,并通过系统控制和事前、事中、事后的监控确保公平交易制度的执行。中国证监会于2008年3月20日颁布了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司根据该指导意见的具体要求,已完善现有的业务流程,建立了公平交易监控系统,并进行定期监控,以切实保护投资者的合法权益。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

根据本基金合同,公司旗下无投资风格与本基金相似的其他基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

2008年,上证指数的跌幅达到65%,创下了有史以来的最大年跌幅,超过了同期香港恒生指数和美国道琼斯指数的跌幅。市场出现单边下跌主要是由于投资者对全球金融危机和国内宏观经济形势变化、上市公司盈利预期下滑的担忧所致。08年上半年美国次贷危机逐步扩散,国际油价屡创新高,国内通货膨胀形势严峻,而到了下半年随着国际金融市场危机迅速恶化,全球经济增长快速走弱。我国宏观政策目标也由上半年的抑制通胀转变为大力刺激内需以保持经济稳定增长。九月份央行四年来首次下调人民币贷款利率,开始了降息的步伐,并且取消了银行信贷额度上限。管理层也开始救市,出台了印花税单边征收等利好,但市场依旧被悲观气氛笼罩,没有止住下跌的步伐,十月份上证指数出现了1994年8月以来的最大月跌幅。十一月国务院推出促进经济增长的十项措施,并宣布将在2010年底前共投资4万亿元,股市开始止跌企稳,市场信心有所恢复。

纵观一年的投资业绩表现,偶尔有些亮点,但更多的是反思和总结。2008年初我们认为宏观经济的增速可能由于上一年的基数和国家宏观调控的原因有所放缓,但是整个经济体的增长以及企业收入和利润的增长是稳定可期的,是可以抵御国内外种种不利因素的,如美国的次债危机、国内的出口放缓以及明显抬头的通货膨胀,因此本基金重点配置了金融业资产、周期类资产和上游资源类,并在大盘的剧烈下跌中依然保持了较高的仓位。我们当时对经济形势的判断,认为政府会因为保持稳定而推出强烈的财政政策刺激经济。然而,随着国际经济和金融形势的迅速恶化,国内的经济政策特别是货币政策和国际利率走向日行渐远,加上大小非压力的实质涌现,股指快速下跌。而后随着国家针对性的“数市”政策,本基金在3000点附近,1800点附近两次增仓,配置了大比例的金融类资产。特别是“四万亿政策”出台后,我们果断的加大了机械、建材、电力设备和金融股的配置,净值自底部有了明显的回升,但终究因为前期失地太多,大势已去而无可奈何。

本报告期内,基金净值增长率为-58.77%,而同期基金业绩比较基准收益率为-54.65%,基金净值落后业绩比较基准4.12个百分点,主要原因是在市场大跌过程中保持了较高的股票仓位。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二零零九年中国经济依然面临不确定性,但随着中央政府经济刺激政策陆续落实,由于信贷集中投放而形成的实体经济流动性的宽裕,企业去库存进程的完成和需求的恢复,A股市场会面临一些阶段性的机会。我们谨慎看待下半年的经济刺激政策实现的力度和效果,但是仍对国家在更深更广的领域内刺激经济,采用更有气魄的举措落实各大产业复兴政策怀有期待。基于上述判断,海富通股票基金将重点关注以下投资机会:一是将受益于经济复苏的周期类公司,很多历史上质地优秀、核心竞争优势明显、能够在经济低谷时扩大市场份额提高产业地位的龙头公司,在这一轮恢复性上涨过程中,应该得到业绩和估值的提升;二是符合国家产业政策方向的细分行业和公司,如新能源产品提供商等,这些公司尽管目前收入和利润有限,但是能够持续获得国家的政策支持和扶持;三是估值相对市场折价的金融类公司;四是能够在宏观经济波动过程中保持稳定增长的细分行业和公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设立估值委员会,委员会成员具有3年以上的基金及相关行业工作经验、专业技术技能,并且能够在估值委员会相关工作中保持独立性。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。

估值委员会下设估值工作小组。估值工作小组充分听取相关部门的建议,并和相关托管人充分协商后,向估值委员会提交估值建议报告以及估值政策和程序评估报告,以便估值委员会决策。

估值政策经估值委员会审阅同意,并经本公司业务管理委员会批准后实施。

基金会计部按照批准后的估值政策进行估值。除了投资总监外,其他基金经理不是估值委员会和估值工作小组的成员,不参与估值政策的决策。但是对于非活跃投资品种,基金经理可以向估值工作小组提供估值建议。上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1.本基金本报告期内无应分配的收益。

2.已实施的利润分配:无。

3.不存在应分配但尚未实施的利润。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在海富通股票证券投资基金(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、基金合同和托管协议的有关规定,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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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、基金合同和托管协议的规定,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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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(注:财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告。
投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:海富通股票证券投资基金

报告截止日:2008年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资 产:		
银行存款	804,440,665.73	148,267,420.12
结算备付金	7,241,222.50	2,039,675.95
存出保证金	1,806,186.79	4,881,313.87
交易性金融资产	2,564,847,842.96	8,635,092,564.57
其中:股票投资	2,564,847,842.96	7,926,662,066.57
基金投资	-	-
债券投资	-	708,430,498.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	9,622,323.50
买入返售金融资产	-	300,000,650.00
应收证券清算款	-	-
应收利息	164,942.16	13,663,964.06
应收股利	-	-
应收申购款	168,732.15	4,833,989.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,378,669,592.29	9,118,401,901.77
负债和所有者权益	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	2,509,276.12	55,232,822.85
应付管理人报酬	4,398,022.09	11,017,104.83
应付托管费	733,003.66	1,836,184.12
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,314,542.90	2,280,058.61
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,443,989.77	1,191,475.80
负债合计	12,398,834.54	71,557,646.21
所有者权益:		
实收基金	7,996,017,037.21	8,861,862,593.03
未分配利润	-4,629,746,279.46	184,981,662.53
所有者权益合计	3,366,270,757.75	9,046,844,255.56
负债和所有者权益总计	3,378,669,592.29	9,118,401,901.77

注:报告截止日2008年12月31日,基金份额净值0.421元,基金份额总额7,996,017,037.21份。

7.2 利润表

会计主体:海富通股票证券投资基金

本报告期:2008年1日1至2008年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-4,619,615,723.75	3,004,404,952.91
1.利息收入	11,886,148.56	16,809,778.69
其中:存款利息收入	5,626,291.54	7,728,509.97
债券利息收入	4,066,730.48	8,315,121.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,193,126.54	766,147.64
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-2,857,290,473.66	2,846,839,764.20
其中:股票投资收益	-2,902,749,680.82	2,778,969,446.25
基金投资收益	-	-
债券投资收益	379,532.72	1,390,463.93
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	328,798.25	45,459,674.61
股利收益	44,750,876.19	21,020,179.41
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,776,052,446.49	131,366,805.51
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	1,841,047.84	9,388,604.51
二、费用(以“-”号填列)	-149,607,539.22	-194,053,526.86
1.管理人报酬	-79,356,670.52	-88,919,093.18
2.托管费	-13,226,111.59	-14,819,848.83
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-55,955,059.70	-83,029,285.16
5.利息支出	-547,630.06	-6,757,663.50
其中:卖出回购金融资产支出	-547,630.06	-6,757,663.50
6.其他费用	-522,067.35	-527,636.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-4,769,223,262.97	2,810,351,426.05
所得税费用(以“-”号填列)	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-4,769,223,262.97	2,810,351,426.05

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:海富通股票证券投资基金

本报告期:2008年1日1至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	8,861,862,593.03	184,981,662.53	9,046,844,255.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,769,223,262.97	-4,769,223,262.97
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-865,845,555.82	-45,504,679.02	-911,350,234.84
其中:1.基金申购款	2,544,727,852.63	-928,376,504.22	1,616,351,348.41
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-3,410,573,408.45	882,871,825.20	-2,527,701,583.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	7,996,017,037.21	-4,629,746,279.46	3,366,270,757.75
项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,401,537,455.75	230,581,316.90	3,632,118,772.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,810,351,426.05	2,810,351,426.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	5,460,325,137.28	-526,411,126.56	4,933,914,010.72
其中:1.基金申购款	13,257,151,408.03	930,156,074.45	14,187,307,482.48
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-7,796,826,270.75	-1,456,567,201.01	-9,253,393,471.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-2,329,539,953.86	-2,329,539,953.86
五、期末所有者权益(基金净值)	8,861,862,593.03	184,981,662.53	9,046,844,255.56

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告不一致。

7.4.1.1 会计政策变更的说明

报告期内不存在会计政策变更。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,本基金自2008年9月16日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法,从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于2008年9月16日下调20,939,308.72元,相应调减本基金的净利润20,939,308.72元和基金资产净值20,939,308.72元。

7.4.1.3 差错更正的说明

报告期内不存在重大会计差错。

7.4.2 关联方关系

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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	5,135,982,203.97	24.36%	6,361,911,748.78	24.39%

7.4.3.1.2 权证交易

单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	149,712.91	1.40%	62,190,373.10	18.12%

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	4,365,706.36	24.67%	919,568.70	27.77%
关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券	5,272,971.10	24.65%	905,460.64	39.92%

注: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的证管费、经手费和适用期间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。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的管理费	79,356,670.52	88,919,093.18
其中:当期已支付	74,958,648.43	77,901,988.35
期末未支付	4,398,022.09	11,017,104.83

注:支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理费是按前一日基金资产净值的年费率(0.5%)计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理费=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
当期应支付的托管费	13,226,111.59	14,819,848.83
其中:当期已支付	12,493,107.93	12,983,664.71
期末未支付	733,003.66	1,836,184.12

注:支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值的年费率(0.25%)计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	96,100,000.00	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国银行	30,634,713.20	-	-	-	589,300,000.00	151,515.86

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.3.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2008年12月31日		上年度末 2007年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中国银行	1,166,724.69	0.0146%	194,132.34	0.0022%

7.4.3.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	804,440,665.73	5,446,384.29	148,267,420.12	7,426,516.51

注:本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2008年1月1日至2008年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
海通证券	601898	中煤能源	首次公开发行	448,823	7,553,691.09
上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
海通证券	601601	中国太保	首次公开发行	447,120	13,413,600.00
海通证券	601168	西部矿业	首次公开发行	81,536	1,099,105.28
海通证券	000616	亿城股份	公开增发	1,335,988	27,107,196.52
海通证券	601919	中国远洋	首次公开发行	224,700	1,095,456.00
海通证券	601808	中海油服	首次公开发行	827,000	11,147,960.00
海通证券	601005	重庆钢铁	首次公开发行	361,000	1,039,680.00
海通证券	126005	07武钢债	公开发行	37,100	37,100,000.00

7.4.4 期末(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000401	冀东水泥	08/06/30	09/07/01	非公开发行	11.83	9.90	5,000,000	59,150,000.00	49,500,000.00
600583	海油工程	08/12/31	09/12/31	非公开发行	11.55	11.57	4,000,000	46,200,000.00	46,280,000.00

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000652	泰达股份	08/12/30	资产重组	5.33	09/01/20	5.28	3,999,380	25,414,524.23	21,316,695.40
600886	国投电力	08/12/09	资产重组	9.13	09/03/04	10.04	388,600	3,279,888.61	3,547,918.00

注:本基金截至2008年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在消除所公布事项的重大影响后,经交易所批准复牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间债券正回购。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2008年12月31日止,基金未从事证券交易所债券正回购交易。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,564,847,842.96	75.91
	其中:股 票	2,564,847,842.96	75.91
2	固定收益投资	-	-
	其中:债 券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	811,681,888.23	24.03
6	其他资产	2,139,861.10	0.06
	合 计	3,378,669,592.29	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

行业	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A 农、林、牧、渔业	22,048,681.60	0.66
B 采掘业	199,347,278.00	5.92
C 制造业	676,353,541.37	20.09
C0 食品、饮料	39,513,327.48	1.17
C1 纺织、服装、皮毛	2,826,119.20	0.08
C2 木材、家具	-	-
C3 造纸、印刷	-	-
C4 石油、化学、塑胶、塑料	109,143,658.61	3.24
C5 电子	17,846,254.54	0.53
C6 金属、非金属	136,289,150.66	4.05
C7 机械、设备、仪表	305,531,642.64	9.08
C8 医药、生物制品	25,935,766.67	0.77
C99 其他制造业	39,267,621.57	1.17
D 电力、煤气及水的生产和供应业	17,652,738.00	0.52
E 建筑业	87,247,677.30	2.59
F 交通运输、仓储业	150,500,363.00	4.47
G 信息技术业	21,468,199.68	0.64
H 批发和零售贸易	210,898,970.37	6.27
I 金融、保险业	725,651,451.46	21.56
J 房地产业	157,333,689.01	4.67
K 社会服务业	19,295,253.17	0.57
L 传播与文化产业	2,650,000.00	0.08
M 综合类	274,400,000.00	8.15
合计	2,564,847,842.96	76.19

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600415	小商品城	5,000,000.00	274,400,000.00	8.15
2	000937	金牛能源	10,933,377.00	153,067,278.00	4.55
3	600030	中信证券	7,999,908.00	143,758,346.76	4.27
4	601398	工商银行	40,000,000.00	141,600,000.00	4.21
5	600000	浦发银行	8,000,000.00	106,000,000.00	3.15
6	600036	招商银行	7,000,000.00	85,120,000.00	2.53
7	601318	中国平安	2,915,657.00	77,527,319.63	2.3
8	600015	华夏银行	9,894,748.00	71,934,817.96	2.14
9	600239	云南城投	3,888,127.00	69,325,304.41	2.06
10	000527	美的电器	8,322,321.00	68,908,817.88	2.05

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www.hftfund.com网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(