

友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金 半年度报告 (2007 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：二〇〇七年八月二十五日

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。本半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 8 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。

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

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、主要财务指标和基金净值表现	5
(一) 主要会计数据和财务指标	5
(二) 基金净值表现	5
三、管理人报告	6
(一) 基金管理人及基金经理情况	6
(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	7
(四) 对宏观经济、证券市场及行业走势的展望	7
四、托管人报告	8
五、财务会计报告	8
(一) 基金会计报表	8
(二) 基金财务会计报表附注	11
六、投资组合报告	16
(一) 报告期末基金资产组合情况	16
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合	16
(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	17
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动	19
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合	21
(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	21
(七) 投资组合报告附注	21
七、基金份额持有人户数、持有人结构	22
(一) 报告期末基金份额持有人户数	22
(二) 报告期末基金份额持有人结构	22
八、开放式基金份额变动情况	23

九、重大事项揭示	23
十、备查文件	26

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：	682,494,006.05 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、法定代表人：	齐亮
6、信息披露负责人：	陈晖
7、联系电话：	021-5047 2222
8、传真：	021-5047 8668
9、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、法定代表人：	肖钢
6、信息披露负责人：	宁敏
7、联系电话：	010-6659 4977
8、传真：	010-6659 4942
9、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、登载半年度报告正文的 管理人互联网网址：	http://www.aig-huatai.com
3、半年度报告置备地点：	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、基金注册登记机构名称：	友邦华泰基金管理有限公司
2、办公地址：	上海市浦东新区世纪大道 88 号金茂大厦 40 楼

二、主要财务指标和基金净值表现

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	2007 年上半年
1	基金本期净收益	490,762,542.20 元
2	基金份额本期净收益	0.6540 元
3	期末可供分配基金收益	320,447,606.85 元
4	期末可供分配基金份额收益	0.4695 元
5	期末基金资产净值	1,221,023,061.00 元
6	期末基金份额净值	1.7891 元
7	基金加权平均净值收益率	44.41%
8	本期基金份额净值增长率	75.94%
9	基金份额累计净值增长率	282.66%

(二) 基金净值表现

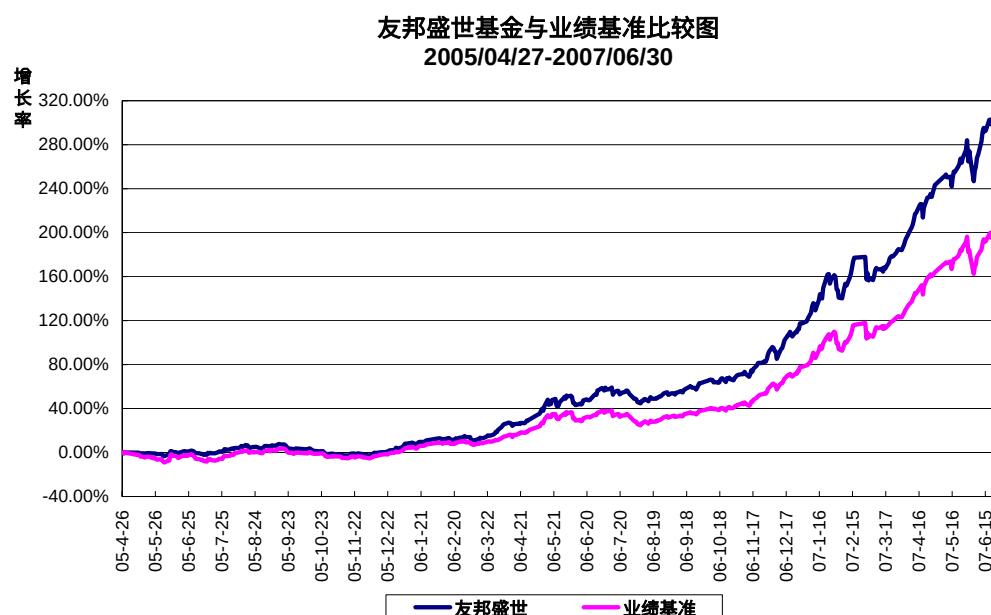
1、基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率的比较列表

阶段	净值 增长率 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
过去一个月	2.23%	2.25%	-3.16%	2.16%	5.39%	0.09%
过去三个月	34.60%	1.92%	23.31%	1.78%	11.29%	0.14%
过去六个月	75.94%	1.95%	54.58%	1.76%	21.36%	0.19%
过去一年	144.03%	1.60%	101.83%	1.41%	42.20%	0.19%
自基金合同 生效日起至	282.66%	1.31%	175.14%	1.19%	107.52%	0.12%

今						
---	--	--	--	--	--	--

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



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%。

2、经董事会审议通过，同意李文杰先生辞去本基金基金经理职务，并由汪晖先生于 2007 年 5 月 31 日起担任本基金基金经理。详情请参见 2007 年 5 月 31 日的《关于变更友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金经理的公告》。

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、上证红利交易型开放式指数证券投资基金和友邦华泰积极成长混合型证券投资基金。

2、基金经理或基金经理小组成员情况

汪晖先生，1991年毕业于南京化工大学无机材料专业，获硕士学位；2000年获南京大学经济学硕士学位。1994年至2002年任华泰证券有限公司高级经理；2002年至2003年任华宝信托投资公司信托基金经理；2003年至2004年任华泰证券有限公司投资经理；2004年7月加入友邦华泰基金管理有限公司。

注：经基金管理人研究决定，自2007年7月26日起增聘梁丰先生为友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金的基金经理，与现任基金经理汪晖先生组成基金经理小组共同管理该基金。

附：梁丰先生简历

梁丰先生，经济学硕士。13年证券（基金）从业经历。历任中信集团中大投资管理有限公司证券投资部总经理、总经理助理、中信基金股权投资部总监、2004年3月至2006年1月任中信经典配置基金的基金经理，2005年11月至2007年4月任中信红利精选股票基金的基金经理。2007年加入友邦华泰基金管理有限公司，2007年7月起担任友邦华泰基金管理有限公司投资部总监。

（二）报告期内基金运作的合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，未发现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1.7891元，累计净值为2.7941元，本报告期内基金份额净值上涨75.94%，本基金的业绩比较基准上涨54.58%。本基金在上半年实施了一次分红，基金份额持有人每份合计共获得0.60元的现金红利。

上半年，宏观经济继续保持高景气上升周期，上市公司利润持续强劲增长，推动股市延续06年以来的牛市运行趋势。股市上涨的财富效应也刺激居民继续调整资产组合，大量储蓄存款转化为股市资金，股票、房产等资产价格持续膨胀。在资金推动下，市场一度出现非理性上涨：开户数大幅度增加，成交急速放大，缺乏基本面支持的股票全面上涨，市场估值水平迅速上升。政府持续调控宏观经济，通过加息和提高准备金率等工具紧缩流动性，抑制资产价格的过快上涨。管理层针对股票市场也出台调控措施，力图改善股票市场供求关系。特别是大幅调高股票交易印花税，A股市场于5月底一度步入调整震荡。

本基金基于对宏观经济和流动性等各方面分析，把握牛市带来的投资机遇。上半年充分分享了股市上涨的果实，为基金持有人创造良好回报。

（四）对宏观经济、证券市场及行业走势的展望

针对上半年宏观经济运行出现的问题，政府将继续出台相应的政策进行调

控。顺差过大、投资过快、通货膨胀趋势以及股市和房地产价格上涨过快，这些都将是政府下半年宏观调控的重点。另一方面，美国次级贷款事件引发了近期全球股市的振荡。随着 A 股市场结束了自 5 月底以来的调整并连创新高，市场估值水平短期内大幅度提升，增加了股市短期振荡的可能性。

由于宏观经济继续处于高景气周期，企业利润增速将保持较高增速，市场向好的趋势没有根本改变，市场热点活跃、轮动较快。A 股市场投资取向在发生变化，可能由原来资金推动逐步转向以业绩推动、资产注入等因素的事件推动为主要特征。

本基金将精选估值合理，成长性较高的个股，重点关注蓝筹股的投资机会。主要配置于金融、地产、终端消费服务、资源品以及部分具有国际竞争优势的投资品行业的公司。国民对经济增长信心增强，流动性充裕、本币、通胀和利率皆趋升，金融、地产和资源品能较好地规避通胀，分享宏观经济增长和资产价格上升所带来的收益。随着居民收入的提高和社会保障体系的健全改善，消费增长和结构升级具有可持续性，在政府持续宏观调控下，百货零售、旅游酒店、通讯传媒、医药保健、软件服务等行业显示出稳定增长的特征。受益于整体制造业配套环境的改善，产业结构升级和国际转移，装备、零部件及相关原材料制造业市场需求良好，竞争优势逐步显现。本基金将重点从上述行业中挑选持续增长的优势企业进行投资。

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。

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。

本半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。

中国银行股份有限公司
2007 年 8 月 21 日

五、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	2007年6月30日	2006年12月31日
资产：			

银行存款	4 (1)	99,611,066.62	114,602,966.02
清算备付金		7,288.22	723,552.18
交易保证金	4 (2)	829,345.10	888,549.12
应收证券清算款		—	—
应收股利		560,671.20	—
应收利息	4 (3)	473,811.97	27,402.50
应收申购款		1,937,828.17	135,155.35
其他应收款		—	—
股票投资市值	4 (4)	1,061,196,979.81	593,861,881.73
其中：股票投资成本	4 (5)	804,155,113.81	432,377,150.91
债券投资市值	4 (4)	69,951,420.00	—
其中：债券投资成本		69,951,420.00	—
权证投资	4 (4)	2,785,247.21	—
其中：权证投资成本		811,900.18	—
买入返售证券		—	—
待摊费用	4 (6)	—	—
其他资产		—	—
资产合计		1,237,353,658.30	710,239,506.90
负债：			
应付证券清算款		8,775,083.01	16,991,692.87
应付赎回款		2,911,898.14	861,337.25
应付赎回费		10,930.36	2,469.17
应付管理人报酬		1,553,371.50	849,148.44
应付托管费		258,895.26	141,524.73
应付佣金	4 (7)	1,159,912.02	588,352.14
应付利息		—	—
应付收益		—	—
未交税金		—	—
其他应付款	4 (8)	1,250,250.00	750,000.00
卖出回购证券款		—	—
预提费用	4 (9)	410,257.01	261,000.00
其他负债		—	—
负债合计		16,330,597.30	20,445,524.60
持有人权益：			
实收基金	4 (10)	682,494,006.05	442,070,287.33
未实现利得	4 (11)	218,081,448.10	122,614,051.11
未分配收益		320,447,606.85	125,109,643.86
持有人权益合计		1,221,023,061.00	689,793,982.30
负债及持有人权益合计		1,237,353,658.30	710,239,506.90

2、经营业绩表及收益分配表

经营业绩表 (单位：元)

项 目	附注	2007年上半年	2006年上半年
收入：			
股票差价收入	4 (12)	493,579,437.11	176,788,888.21
债券差价收入	4 (13)	-66,433.19	-243,783.74
权证差价收入	4 (14)	526,808.35	11,756,860.34
债券利息收入		139,756.29	458,535.05
存款利息收入		1,087,698.67	418,001.96
股利收入		4,460,133.55	6,024,903.38
买入返售证券收入		—	—
其他收入	4 (15)	820,577.47	877,711.79
收入合计		500,547,978.25	196,081,116.99
费用：			
基金管理人报酬		8,198,489.88	4,742,664.69
基金托管费		1,366,415.06	790,444.08
卖出回购证券支出		—	—
利息支出		—	—
其他费用	4 (16)	220,531.11	199,721.60
其中：信息披露费		178,520.47	148,767.52
审计费用		31,736.54	39,671.58
费用合计		9,785,436.05	5,732,830.37
基金净收益		490,762,542.20	190,348,286.62
加：未实现估值增值变动数		97,530,482.21	76,173,399.71
基金经营业绩		588,293,024.41	266,521,686.33

收益分配表 (单位：元)

项 目	附注	2007年上半年	2006年上半年
本期基金净收益		490,762,542.20	190,348,286.62
加：期初基金净收益		125,109,643.86	-9,031,795.26
加：本期申购基金单位的损益平准金		95,176,327.62	38,137,402.48
减：本期赎回基金单位的损益平准金		87,500,084.67	37,363,415.95
可供分配基金净收益		623,548,429.01	182,090,477.89
减：本期已分配基金净收益	4 (17)	303,100,822.16	136,860,968.46
期末基金净收益		320,447,606.85	45,229,509.43

3、基金净值变动表 (单位：元)

项 目	附注	2007年上半年	2006年上半年
-----	----	----------	----------

一、期初基金净值		689,793,982.30	683,033,735.13
二、本期经营活动：			
基金净收益		490,762,542.20	190,348,286.62
未实现估值增值变动数		97,530,482.21	76,173,399.71
经营活动产生的基金净值变动数		588,293,024.41	266,521,686.33
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		997,619,332.11	482,662,710.47
其中：分红再投资		97,414,020.42	27,232,033.88
基金赎回款		-751,582,455.66	-726,396,751.33
基金单位交易产生的基金净值变动数		246,036,876.45	-243,734,040.86
四、本期向持有人分配收益		-303,100,822.16	-136,860,968.46
五、期末基金净值		1,221,023,061.00	568,960,412.14

(二) 基金财务会计报表附注

1、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一致。

2、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。

3、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) 通过关联方交易单元进行的交易

关联方及关联方交易	2007年上半年		2006年上半年	
	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	679,197,627.49	25.21	228,840,534.02	16.96
2、债券交易				
华泰证券有限责任公司	—	—	—	—
3、债券回购交易				
华泰证券有限责任公司	—	—	—	—
4、权证交易				
华泰证券有限责任公司	249,119.00	3.38	1,535,166.49	13.06
5、佣金				
华泰证券有限责任公司	552,619.53	25.34	184,080.76	16.81

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

① 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。

	2007年上半年	2006年上半年
管理人报酬(元)	8,198,489.88	4,742,664.69

② 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。

	2007年上半年	2006年上半年
托管人报酬(元)	1,366,415.06	790,444.08

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	2007年上半年	2006年上半年
	金额(元)	金额(元)
1、银行间债券交易		
中国银行股份有限公司	70,262,104.93	29,824,298.63
2、银行间回购交易		
中国银行股份有限公司	—	—

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	—	—

4) 关联方投资本基金的情况

①基金管理人投资本基金的情况

本报告期，基金管理人未投资本基金。

②基金管理人主要股东及其控制的机构投资本基金的情况

关联方名称	持有基金份额(份)		占总基金份额比例(%)	
	期末	期初	期末	期初
华泰证券有限责任公司	51,531,847.23	51,531,847.23	7.55	11.66

截至 2006 年 6 月 30 日，华泰证券有限责任公司持有本基金 63,531,847.23 份，占总基金份额的 13.81%。

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	保管的银行存款(元)		利息收入(元)	
	期末	期初	07年上半年	06年上半年
中国银行股份有限公司	99,611,066.62	114,602,966.02	1,072,747.49	407,906.40

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。

4、会计报表重要项目的说明（单位：元）

(1) 银行存款

项 目	2007年6月30日
银行活期存款	99,611,066.62
银行定期存款	—
合 计	99,611,066.62

(2) 交易保证金

项 目	2007年6月30日
深圳结算保证金	690,795.98
权证交易保证金	138,549.12
合 计	829,345.10

(3) 应收利息

项 目	2007年6月30日
应收银行存款利息	30,732.67
应收结算备付金利息	3.30
应收权证保证金利息	62.30
应收债券利息	443,013.70
合 计	473,811.97

(4) 投资估值增值

项 目	2007年6月30日
股票估值增值	257,041,866.00
债券估值增值	—
权证估值增值	1,973,347.03
合 计	259,015,213.03

(5) 股票投资成本

项 目	2007年上半年
期初股票投资成本	432,377,150.91
加：买入股票投资成本	1,289,743,082.98
减：卖出股票结转投资成本	917,964,401.70
减：因股权分置改革获得的现金对价	718.38
期末股票投资成本	804,155,113.81

(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	2007年6月30日
应付华泰证券佣金	233,320.71
应付中信建投佣金	341,876.72
应付国泰君安佣金	63,250.79
应付联合证券佣金	93,929.26
应付中信万通佣金	21,490.54
应付申银万国佣金	101,902.09
应付银河证券佣金	115,232.33
应付中投证券佣金	106,328.82
应付中信证券佣金	82,580.76
合 计	1,159,912.02

(8) 其他应付款

项 目	2007年6月30日
应付券商垫付保证金	1,250,000.00
应付银行间债券交易费	250.00
合 计	1,250,250.00

(9) 预提费用

项 目	2007年6月30日
预提信息披露费	378,520.47
预提审计费用	31,736.54
合 计	410,257.01

(10) 实收基金

项 目	2007年上半年
期初实收基金	442,070,287.33
加：本期申购基金	743,669,130.73
其中：红利再投资基金份额	83,502,503.54
减：本期赎回基金	503,245,412.01
期末实收基金	682,494,006.05

(11) 未实现利得

项 目	2007年上半年
期初未实现利得	122,614,051.11
加：本期投资估值增值变动数	97,530,482.21
加：本期申购的未实现利得平准金	158,773,873.76
其中：红利再投资的未实现利得平准金	11,313,042.73
减：本期赎回的未实现利得平准金	160,836,958.98
期末未实现利得	218,081,448.10

(12) 股票差价收入

项 目	2007年上半年
卖出股票收入总额	1,412,730,282.62
减：卖出股票成本总额	917,964,401.70
交易佣金	1,186,443.81
卖出股票差价收入	493,579,437.11

(13) 债券差价收入

项 目	2007年上半年
卖出债券收入总额	29,402,994.33
减：卖出债券成本总额	29,462,000.00
卖出债券应收利息	7,427.52
交易佣金	—
卖出债券差价收入	-66,433.19

(14) 权证差价收入

项 目	2007年上半年
卖出权证收入总额	3,538,260.38
减：卖出权证成本总额	3,011,452.03
交易佣金	—
卖出权证差价收入	526,808.35

(15) 其他收入

项 目	2007年上半年
赎回费收入	820,577.47
合 计	820,577.47

(16) 其他费用

项 目	2007年上半年
-----	----------

信息披露费	178,520.47
审计费用	31,736.54
债券托管账户服务费	9,000.00
银行债券交易费用	250.00
其他费用	1,024.10
合 计	220,531.11

(17) 已分配基金净收益

项 目	2007年上半年
分红时间	2007/01/19
基金份额分红金额	0.60
分配总金额	303,100,822.16
其中：现金红利	205,686,801.74
现金红利再投资	97,414,020.42

5、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

截至本报告期末，本基金未持有因股权分置改革而停牌的股票。

(2) 基金参与网下申购流通受限的股票

股票代码	股票名称	数量	总成本	总市值	占资产净值比例 (%)	估值方法	受限期限
601328	交通银行	384,408	3,036,823.20	4,224,643.92	0.35	收盘价	自上市日起三个月
601919	中国远洋	84,637	717,721.76	1,545,471.62	0.13	收盘价	自上市日起三个月

六、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例(%)
1	股票投资	1,061,196,979.81	85.76
2	债券投资	69,951,420.00	5.65
3	权证投资	2,785,247.21	0.23
4	资产支持证券	—	—
5	银行存款和清算备付金合计	99,618,354.84	8.05
6	应收证券清算款	—	—
7	其他资产	3,801,656.44	0.31
	合计	1,237,353,658.30	100.00

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—

B	采掘业	20,024,174.41	1.64
C	制造业	494,106,570.77	40.47
C0	其中：食品、饮料	69,998,498.92	5.73
C1	纺织、服装、皮毛	—	—
C2	木材、家具	1,432,900.00	0.12
C3	造纸、印刷	17,958,800.00	1.47
C4	石油、化学、塑胶、塑料	36,538,153.85	2.99
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	120,714,946.17	9.89
C7	机械、设备、仪表	243,624,851.83	19.95
C8	医药、生物制品	3,378,620.00	0.28
C99	其他	459,800.00	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	30,690,872.00	2.51
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	25,001,789.62	2.05
G	信息技术业	53,749,720.00	4.40
H	批发和零售贸易	66,757,910.32	5.47
I	金融、保险业	256,567,900.18	21.01
J	房地产业	85,450,813.76	7.00
K	社会服务业	11,660,868.75	0.96
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	17,186,360.00	1.41
	合 计	1,061,196,979.81	86.91

(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	600036	招商银行	3,708,816	91,162,697.28	7.47
2	000858	五 粮 液	2,153,102	67,736,588.92	5.55
3	601318	中国平安	933,502	66,754,728.02	5.47
4	600586	金晶科技	3,098,319	61,563,598.53	5.04
5	000338	潍柴动力	686,777	53,911,994.50	4.42
6	000157	中联重科	1,380,105	53,134,042.50	4.35
7	600030	中信证券	735,000	38,932,950.00	3.19
8	600325	华发股份	1,217,046	36,913,005.18	3.02
9	600383	金地集团	939,289	32,142,469.58	2.63
10	600900	长江电力	1,902,600	28,767,312.00	2.36
11	600361	华联综超	1,032,500	28,589,925.00	2.34
12	600067	冠城大通	1,107,000	23,855,850.00	1.95
13	600686	金龙汽车	1,000,000	23,500,000.00	1.92
14	000039	中集集团	800,000	23,456,000.00	1.92
15	600786	东方锅炉	361,340	22,757,193.20	1.86
16	600026	中海发展	959,100	22,040,118.00	1.81
17	600596	新安股份	491,615	21,232,851.85	1.74

18	600000	浦发银行	545,600	19,963,504.00	1.63
19	000001	深发展 A	715,067	19,678,643.84	1.61
20	600718	东软股份	469,000	19,543,230.00	1.60
21	600050	中国联通	3,065,000	17,991,550.00	1.47
22	600697	欧亚集团	863,742	17,542,600.02	1.44
23	000617	石油济柴	565,621	17,534,251.00	1.44
24	000488	晨鸣纸业	2,000,000	17,440,000.00	1.43
25	600282	南钢股份	1,300,000	17,342,000.00	1.42
26	600694	大商股份	264,326	16,269,265.30	1.33
27	600547	山东黄金	221,000	16,197,090.00	1.33
28	000063	中兴通讯	281,000	15,286,400.00	1.25
29	600415	小商品城	151,000	15,251,000.00	1.25
30	600015	华夏银行	1,199,928	14,447,133.12	1.18
31	000792	盐湖钾肥	323,900	14,374,682.00	1.18
32	600183	生益科技	1,000,000	12,270,000.00	1.00
33	000978	桂林旅游	643,605	11,423,988.75	0.94
34	000680	山推股份	658,321	10,388,305.38	0.85
35	000024	招商地产	196,506	9,648,444.60	0.79
36	600592	龙溪股份	499,966	8,949,391.40	0.73
37	600660	福耀玻璃	232,657	7,100,691.64	0.58
38	600481	双良股份	350,000	5,306,000.00	0.43
39	601328	交通银行	384,408	4,224,643.92	0.35
40	600219	南山铝业	174,500	3,959,405.00	0.32
41	000612	焦作万方	142,300	3,837,831.00	0.31
42	002073	青岛软控	97,700	3,136,170.00	0.26
43	600150	沪东重机	20,200	2,792,448.00	0.23
44	600062	双鹤药业	146,000	2,638,220.00	0.22
45	000002	万 科 A	133,050	2,543,916.00	0.21
46	000987	广州友谊	68,000	2,424,200.00	0.20
47	600052	*ST 广厦	154,000	2,306,920.00	0.19
48	600895	张江高科	112,000	1,935,360.00	0.16
49	600089	特变电工	54,755	1,683,716.25	0.14
50	601919	中国远洋	84,637	1,545,471.62	0.13
51	000690	宝新能源	96,000	1,512,960.00	0.12
52	600978	宜华木业	46,000	1,432,900.00	0.12
53	002032	苏 泊 尔	39,400	1,426,280.00	0.12
54	601166	兴业银行	40,000	1,403,600.00	0.11
55	600519	贵州茅台	10,000	1,196,800.00	0.10
56	000983	西山煤电	40,000	1,129,200.00	0.09
57	600675	中华企业	48,040	1,090,988.40	0.09
58	600517	置信电气	31,000	1,069,190.00	0.09
59	600690	青岛海尔	65,000	1,040,000.00	0.09
60	600801	华新水泥	44,000	1,025,200.00	0.08

61	601699	潞安环能	25,000	1,021,750.00	0.08
62	002028	思源电气	15,920	1,001,049.60	0.08
63	600096	云天化	38,000	930,620.00	0.08
64	600973	宝胜股份	34,000	928,540.00	0.08
65	600693	东百集团	52,000	918,320.00	0.08
66	600582	天地科技	15,000	894,750.00	0.07
67	601001	大同煤业	34,929	883,354.41	0.07
68	000616	亿城股份	53,000	805,070.00	0.07
69	600737	中粮屯河	85,000	662,150.00	0.05
70	600591	上海航空	100,000	624,000.00	0.05
71	000759	武汉中百	40,000	544,000.00	0.04
72	000910	大亚科技	40,000	518,800.00	0.04
73	600029	南方航空	60,000	514,800.00	0.04
74	002024	苏宁电器	10,000	469,600.00	0.04
75	600525	长园新材	10,000	459,800.00	0.04
76	000960	锡业股份	14,000	455,140.00	0.04
77	000878	云南铜业	13,000	448,500.00	0.04
78	600396	金山股份	20,000	410,600.00	0.03
79	600809	山西汾酒	12,000	402,960.00	0.03
80	600806	昆明机床	15,000	400,500.00	0.03
81	600028	中国石化	30,000	396,600.00	0.03
82	600497	驰宏锌锗	6,000	396,180.00	0.03
83	000661	长春高新	30,000	386,400.00	0.03
84	600518	康美药业	30,000	354,000.00	0.03
85	600269	赣粤高速	20,000	277,400.00	0.02
86	000548	湖南投资	14,000	236,880.00	0.02
87	000825	太钢不锈	5,000	100,300.00	0.01
		合计		1,061,196,979.81	86.91

(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	600036	招商银行	92,122,836.97	13.36
2	000858	五粮液	52,657,131.80	7.63
3	601318	中国平安	52,417,852.37	7.60
4	600030	中信证券	46,525,523.32	6.74
5	600383	金地集团	35,176,130.77	5.10
6	600019	宝钢股份	34,714,371.11	5.03
7	600586	金晶科技	32,169,313.64	4.66
8	000488	晨鸣纸业	29,205,485.56	4.23
9	600631	百联股份	27,249,164.46	3.95
10	600361	华联综超	27,007,751.39	3.92

11	600067	冠城大通	26,693,795.39	3.87
12	600900	长江电力	26,487,792.88	3.84
13	600050	中国联通	24,784,483.91	3.59
14	600325	华发股份	24,535,025.31	3.56
15	600104	上海汽车	24,384,933.58	3.54
16	600786	东方锅炉	23,380,981.68	3.39
17	000157	中联重科	22,756,847.11	3.30
18	600596	新安股份	21,853,158.66	3.17
19	600282	南钢股份	21,365,794.23	3.10
20	600697	欧亚集团	18,604,333.19	2.70
21	600308	华泰股份	17,890,295.76	2.59
22	600718	东软股份	17,501,372.20	2.54
23	000039	中集集团	16,719,496.81	2.42
24	600183	生益科技	15,880,755.07	2.30
25	000528	柳 工	15,603,828.32	2.26
26	600015	华夏银行	15,576,150.88	2.26
27	000089	深圳机场	15,339,753.94	2.22
28	000792	盐湖钾肥	14,472,942.73	2.10
29	600436	片仔癀	14,313,554.49	2.08
30	600993	马应龙	13,851,629.78	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)	占期初资产净值比例(%)
1	600019	宝钢股份	75,007,182.49	10.87
2	600036	招商银行	74,115,094.45	10.74
3	000858	五 粮 液	68,079,221.52	9.87
4	600104	上海汽车	48,867,187.56	7.08
5	600496	长江精工	47,340,743.48	6.86
6	600125	铁龙物流	46,690,091.81	6.77
7	600308	华泰股份	45,247,266.08	6.56
8	600325	华发股份	44,501,640.39	6.45
9	000157	中联重科	36,415,355.83	5.28
10	600631	百联股份	35,763,382.96	5.18
11	000651	格力电器	35,690,826.52	5.17
12	601006	大秦铁路	35,515,601.76	5.15
13	600535	天士力	29,902,897.68	4.34
14	000837	秦川发展	29,692,435.61	4.30
15	600849	上海医药	29,175,047.73	4.23
16	000022	深赤湾 A	27,436,595.61	3.98
17	600005	武钢股份	26,673,171.01	3.87
18	600686	金龙汽车	24,708,623.89	3.58
19	600795	国电电力	24,604,357.28	3.57
20	600009	上海机场	24,254,498.52	3.52
21	000528	柳 工	23,826,012.84	3.45

22	000089	深圳机场	22,830,588.03	3.31
23	600993	马应龙	21,674,345.99	3.14
24	600436	片仔癀	21,571,702.01	3.13
25	001696	宗申动力	20,936,752.43	3.04
26	600016	民生银行	20,606,353.81	2.99
27	601398	工商银行	17,822,582.82	2.58
28	600123	兰花科创	17,539,096.42	2.54
29	600518	康美药业	17,373,602.83	2.52
30	600978	宜华木业	16,384,727.57	2.38
31	600897	厦门空港	16,044,581.23	2.33
32	600970	中材国际	16,039,923.64	2.33
33	600309	烟台万华	15,924,555.44	2.31
34	600521	华海药业	15,568,222.84	2.26
35	000428	华天酒店	15,318,789.84	2.22
36	000039	中集集团	14,724,909.24	2.13
37	600570	恒生电子	14,386,035.03	2.09
38	000917	电广传媒	13,887,481.23	2.01

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)
1,289,743,082.98	1,412,730,282.62

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
3	央行票据	69,951,420.00	5.73
4	企业债券	—	—
5	可转换债券	—	—
6	短期融资券	—	—
7	资产支持证券	—	—
	合 计	69,951,420.00	5.73

(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

序号	债券名称	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	05 央行票据 43	69,951,420.00	5.73

(七) 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

序号	代码	权证名称	数量	市值(元)	占资产净值比例(%)
1	580012	云化 CWB1	7,560	142,445.52	0.01
2	030002	五粮 YGC1	30,000	960,000.00	0.08
3	031003	深发 SFC1	71,507	1,089,766.68	0.09
4	031004	深发 SFC2	35,753	593,035.01	0.05

(2) 报告期内获得权证明细

序号	代码	权证名称	数量	成本(元)	获得方式
1	030002	五粮 YGC1	192,000	3,823,352.21	主动投资
2	031003	深发 SFC1	71,507	—	被动持有
3	031004	深发 SFC2	35,753	—	被动持有
4	580012	云化 CWB1	27,000	—	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	690,795.98
2	上海权证保证金	71,849.12
3	深圳权证保证金	66,700.00
4	应收股利	560,671.20
5	应收利息	473,811.97
6	应收基金申购款	1,937,828.17
	合计	3,801,656.44

5、本报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有可转换债券。

6、本报告期末按市值占基金净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

7、本报告期，基金管理公司未投资本基金。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

(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)：	10,942
2	报告期末平均每户持有基金份额(份)：	62,373.79

(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：	682,494,006.05	100
1	其中：机构投资者持有的基金份额	398,265,913.49	58.35

2	个人投资者持有的基金份额	284,228,092.56	41.65
---	--------------	----------------	-------

八、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	442,070,287.33
3	本报告期期间总申购份额	743,669,130.73
4	本报告期期间总赎回份额	503,245,412.01
5	本报告期期末基金份额总额	682,494,006.05

截至 2007 年 6 月 30 日,公司员工投资证券投资基金的有关制度尚未履行向中国证监会及相关派出机构备案程序,公司尚未允许员工购买本基金。

九、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

报告期内基金管理人、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

本基金于 2007 年 1 月 19 日实施了 2007 年第一次分红暨自基金合同生效以来的第五次分红,每份基金份额获得 0.60 元红利。

(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。

(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单元的有关情况

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交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、基金租用证券公司专用交易单元数量

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	中信建投证券有限责任公司	1
3	国泰君安证券股份有限公司	1
4	联合证券有限责任公司	1
5	申银万国证券股份有限公司	1
6	中国银河证券股份有限公司	1
7	中国建银投资证券有限责任公司	1
8	中信证券股份有限公司	1
	合计	9

4、基金租用证券公司专用席位交易情况

交易/证券公司	2007年上半年	
	金额(元)	比例(%)
1、股票交易		
华泰证券有限责任公司	679,197,627.49	25.21
兴业证券有限责任公司	101,256,477.21	3.76
中信建投证券有限责任公司	465,548,132.63	17.28
国泰君安证券股份有限公司	156,085,566.66	5.79
联合证券有限责任公司	171,478,288.27	6.36
中信万通证券有限责任公司	222,790,787.04	8.27
东方证券股份有限公司	195,426,772.87	7.25
申银万国有限责任公司	196,402,328.98	7.29
中国银河证券股份有限公司	264,864,136.80	9.83
中国建银投资证券有限责任公司	135,881,635.43	5.04
中信证券股份有限公司	105,534,603.18	3.92
合计	2,694,466,356.56	100.00
2、债券交易		
中信建投证券有限责任公司	109,662.00	27.91
申银万国有限责任公司	283,232.00	72.09
合计	392,894.00	100.00
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	249,119.00	3.38

东方证券股份有限公司	6,274,210.15	85.23
申银万国有限责任公司	275,548.84	3.74
中信证券股份有限公司	562,700.00	7.64
合计	7,361,577.99	100.00
5、佣金		
华泰证券有限责任公司	552,619.53	25.34
兴业证券有限责任公司	83,029.70	3.81
中信建投证券有限责任公司	381,749.13	17.51
国泰君安证券股份有限公司	127,990.01	5.87
联合证券有限责任公司	140,611.24	6.45
中信万通证券有限责任公司	174,335.47	8.00
东方证券股份有限公司	152,922.82	7.01
申银万国有限责任公司	161,049.70	7.39
中国银河证券股份有限公司	217,187.74	9.96
中国建银投资证券有限责任公司	106,328.82	4.88
中信证券股份有限公司	82,580.76	3.79
合计	2,180,404.92	100.00

5、本报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内，基金管理人代表基金新增租用了中投证券和中信证券的专用交易单元，并退租了兴业证券、中信万通证券和东方证券的交易单元。

(九) 其它事项

重大事件	信息披露报纸	披露日期
第五次分红预告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 1 月 16 日
调整第五次分红金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 1 月 19 日
在深圳发展银行开展网上银行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	2007 年 1 月 19 日
关于申购费率优惠公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 1 月 26 日
增加中信金通,财通证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 2 月 2 日
增加万联证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 2 月 7 日
增加山西证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 2 月 12 日
关于费率优惠申购期限提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 2 月 13 日
增加长江证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 3 月 23 日
网上交易开通公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2007 年 4 月 6 日

关于调整申购费率标准的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2007 年 4 月 27 日
关于开通“银联通”网上交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2007 年 5 月 11 日
关于调整费用计算方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2007 年 5 月 23 日
基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2007 年 5 月 31 日
增加中原证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2007 年 6 月 4 日
更新招募说明书摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2007 年 6 月 9 日

十、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

二〇〇七年八月二十五日