



I

安信证券投资基金 2006 年半年度报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

签发日期：二〇〇六年八月二十四日

一、	重要提示	3
二、	基金产品概况	3
1、	基金概况	3
2、	基金的投资	3
3、	基金管理人	4
4、	基金托管人	4
5、	信息披露	4
6、	登记注册机构	4
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
1、	主要财务指标（未经审计）	5
2、	净值表现	5
四、	管理人报告	6
1、	基金管理人及基金经理简介	6
2、	基金运作合规性声明	6
3、	基金经理工作报告	7
五、	托管人报告	7
六、	财务会计报告（未经审计）	8
(一)、	资产负债表	8
(二)、	经营业绩表	9
(三)、	收益分配表	10
(四)、	净值变动表	10
(五)、	会计报表附注	10
七、	投资组合报告	15
(一)、	基金资产组合	15
(二)、	按行业分类的股票投资组合	15
(三)、	股票明细	16
(四)、	报告期内股票投资组合的重大变动	17
(五)、	按债券品种分类的债券投资组合	18
(六)、	基金投资前五名债券明细	19
(七)、	权证投资组合	19
(八)、	资产支持证券投资组合	19
(九)、	投资组合报告附注	19
八、	基金份额持有人户数和持有人结构	20
九、	重大事件	21
十、	备查文件目录	23

一、 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2006 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

二、 基金产品概况

1、 基金概况

基金名称:	安信证券投资基金
基金简称:	基金安信
交易代码:	500003
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1998 年 6 月 22 日
期末基金份额总额:	20 亿份
基金存续期:	15 年
基金上市地点:	上海证券交易所
基金上市日期:	1998 年 6 月 26 日

2、 基金的投资

投资目标: 本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险,确保基金资产的安全,并谋求基金长期稳定的投资收益。

投资策略: 本基金为成长型基金,本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%,其中投资于国债的比例控制在基金资产净值的 20-50%,股票资产的比例控制在 45-80%,现金比例根据运作情况调整。在股票资产中,70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。

本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好,在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势,财务状况良好,能保持较高的业绩增长,预期收入或利润增长率不低于同期 GDP 的增长



业绩比较基准：
风险收益特征：

率。
无
无

3、基金管理人

基金管理人：华安基金管理有限公司
注册及办公地址：上海市浦东南路 360 号
新上海国际大厦 38 楼
(邮政编码：200120)
法定代表人：王成明
信息披露负责人：冯颖
联系电话：021-58881111
传真：021-68863414
电子邮箱：fengying@huan.com.cn
客户服务热线：021-68604666, 40088-50099

4、基金托管人

基金托管人：中国工商银行股份有限公司
注册及办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
(邮政编码：100032)
法定代表人：姜建清
信息披露负责人：庄为
联系电话：010-66106912
传真：010-66106904
电子邮箱：custody@icbc.com.cn

5、信息披露

信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址：<http://www.huan.com.cn>
报告置备地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

6、登记注册机构

登记注册机构：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
办公地点：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标（未经审计）

财务指标	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
基金本期净收益：	357,182,322.92
加权平均基金份额本期净收益：	0.1786
期末可供分配基金收益	357,934,942.90
期末可供分配基金份额收益	0.1790
期末基金资产净值：	3,186,204,312.09
期末基金份额净值：	1.5931
基金加权平均净值收益率	14.03%
本期基金份额净值增长率	53.19%
基金份额累计净值增长率	268.21%

提示：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（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、净值表现

A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

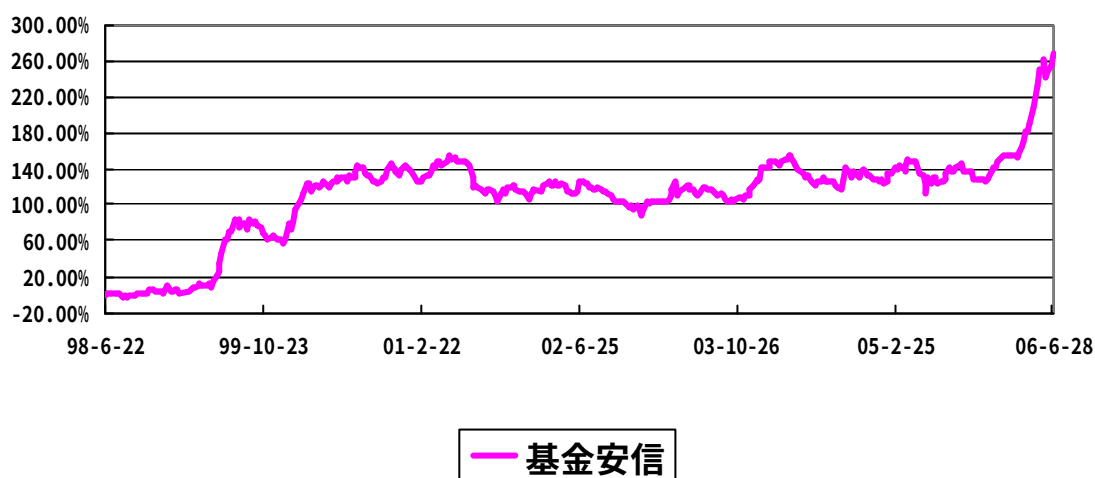
阶段	净值 增长率①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.19%	3.87%	-	-	-	-
过去三个月	35.66%	3.51%	-	-	-	-
过去六个月	53.19%	2.73%	-	-	-	-
过去一年	59.83%	2.36%	-	-	-	-
过去三年	74.24%	2.23%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	268.21%	2.36%	-	-	-	-

备注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率历史走势图

基金安信份额累计净值增长率历史走势图 1998/6/22-2006/06/30



四、管理人报告

1、基金管理人及基金经理简介

(1) 基金管理人

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托投资有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海广电（集团）有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至 2006 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺、基金安久、基金安瑞 4 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、180ETF 等 5 只开放式基金，管理资产规模达到 344.88 亿元。

(2) 基金经理

汤礼辉先生，经济学硕士，8 年证券、基金从业经历。曾在申银万国证券研究所工作。2000 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员，从事医药、金融行业及投资策略研究。现任研究发展部副总监、安信证券投资基金的基金经理、华安宝利配置基金的基金经理。

2、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《安信投资基金基金合同》、《基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，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，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

3、基金经理工作报告

2006 年上半年，A 股市场继续了其自身历史上少有的历史性重估。以股权分置改革为核心的中国资本市场改革完善了整个市场的基础制度，改变了中国股市的边缘化地位，并在此基础上有可能促使股票市场作为重要的资产类别成为全社会资产配置的核心之一。制度的完善和市场地位的提高有利于降低市场风险溢价、股权割裂局面的改变和管理层股权激励制度的逐步实施有利于大小股东和企业管理层利益更趋向一致，从而促使小股东折价的降低。

从经济层面看，全球经济和中国经济的强势超越 A 股市场投资者原先预期。美欧日三大经济体带动 OECD 工业生产保持快速增长。国内经济在外需和内需的双重带动下，出现了近年最快的季度增长率。从国内经济看，随着经济体自身增长潜力的不断释放和升值背景下总体宽松的货币供应使内需保持较高的状态。

从微观层面看，证券市场的投资机会根源于企业的成长。基金经理认为中国可能进入了一个不断涌现具备核心竞争力的企业的时代。

基金安信在 3 月 9 日公告更换基金经理。自基金经理调整以来，基金安信的投資操作可划分为两个阶段。第一阶段根据加速上涨的市场环境，进行了主题配置，增持了包括军工、商业、消费品、医药等在内的主题类资产，以丰富主题覆盖的广度。第二阶段，在市场加速上涨阶段结束之后，基金安信从更长远的角度出发，开始核心资产的重新构造。

基金安信自成立以来坚持以成长为核心的长期投资策略，这一基本风格在本基金经理任期内将会继续贯彻。基金经理认为，深度和广度是基金经理必须平衡的两个纬度，而只有加入了时间这一纬度，在广度和深度上才能更容易得到兼顾。在长期投资这一基础之外，基金安信将加强组合层面的分析与构造，实现自下而上和自上而下之间的结合，达到丰富组合投资思路的目的以适应目前在学习的道路上不断深化的 A 股市场和日新月异的中国经济和企业层面的变化。在一定程度上，基金经理认为，基金安信的目标是通过细分市场发展空间的研究寻找在成长的市场中具备可持续发展能力的上市公司。

五、托管人报告

2006 年上半年，本托管人在对安信基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何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。

2006 年上半年，安信基金的管理人——华安基金管理有限公司在安信基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在 2006 年上半年所编制和披露的安信基金半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

六、财务会计报告（未经审计）

（一）、资产负债表

二零零六年六月三十日				
单位：人民币元				
项 目	附注	2006年6月30日	2005年12月31日	
资产：				
银行存款		119,329,481.36	153,159,938.64	
清算备付金		4,073,303.77	2,172,891.93	
交易保证金		766,948.08	1,098,780.49	
应收证券清算款		11,262,127.57	-	
应收股利		845,154.00	-	
应收利息	4(1)	7,906,534.43	6,506,140.49	
其他应收款		-	-	
股票投资市值		2,412,781,920.64	1,576,118,675.73	
其中：股票投资成本		1,582,755,253.78	1,512,251,434.93	
债券投资市值		649,803,567.73	441,134,845.80	
其中：债券投资成本		651,560,865.40	435,226,577.95	
权证投资		-	-	
其中：权证投资成本		-	-	
配股权证		-	-	
买入返售证券		-	-	
待摊费用	4(2)	125,553.15	-	
其他资产		-	-	
资产合计		<u>3,206,894,590.73</u>	<u>2,180,191,273.08</u>	
负债：				
应付证券清算款		13,246,822.38	45,778,626.50	
应付管理人报酬		3,756,667.12	2,614,802.72	
应付托管费		626,111.16	435,800.45	
应付佣金	4(4)	1,192,733.32	1,113,914.62	
应付利息		-	-	
应付收益		-	-	
未交税金		-	-	
其他应付款	4(5)	1,500,000.00	1,500,000.00	
卖出回购证券款		-	-	
短期借款		-	-	
预提费用	4(6)	367,944.66	220,000.00	
其他负债		-	-	
负债合计		<u>20,690,278.64</u>	<u>51,663,144.29</u>	

所有者权益：

实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得	828,269,369.19	69,775,508.65
未分配收益	357,934,942.90	58,752,620.14
持有人权益合计	3,186,204,312.09	2,128,528,128.79
负债和所有者权益合计	3,206,894,590.73	2,180,191,273.08
基金份额净值	1.5931	1.0643

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、经营业绩表

自二零零六年一月一日至二零零六年六月三十日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2006年1月1日至6月30日	2005年1月1日至6月30日
收入：			
股票差价收入	4(7)	253,712,620.69	27,998,364.94
债券差价收入	4(8)	2,288,320.31	6,253,336.56
权证差价收入		78,462,446.26	-
债券利息收入		7,414,251.01	7,593,535.30
存款利息收入		505,897.42	842,945.76
股利收入		37,229,728.84	23,075,399.17
买入返售证券收入		387,386.30	-
其他收入	4(9)	288.75	12,665.74
收入合计		380,000,939.58	65,776,247.47
费用：			
基金管理人报酬	3(3)	18,863,585.61	15,559,226.07
基金托管费	3(3)	3,143,930.88	2,593,204.38
卖出回购证券支出		488,236.67	3,013.70
利息支出		-	-
其他费用	4(10)	322,863.50	292,812.36
其中：信息披露费		168,603.31	168,603.31
上市年费		29,752.78	29,752.78
审计费用		49,588.57	69,588.57
费用合计		22,818,616.66	18,448,256.51
基金净收益		357,182,322.92	47,327,990.96
加：未实现估值增值变动数		758,493,860.54	-30,168,775.50
基金经营业绩		1,115,676,183.46	17,159,215.46

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、收益分配表

自二零零六年一月一日至二零零六年六月三十日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2006年1月1日至6月30日	2005年1月1日至6月30日
本期基金净收益		357,182,322.92	47,327,990.96
加：期初未分配收益		58,752,620.14	13,831,209.21
可供分配基金净收益		415,934,943.06	61,159,200.17
减：本期已分配基金净收益	4(11)	58,000,000.16	12,000,000.12
期末基金未分配净收益		357,934,942.90	49,159,200.05

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、净值变动表

自二零零六年一月一日至二零零六年六月三十日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2006年1月1日至6月30日	2005年1月1日至6月30日
一、期初基金净值		2,128,528,128.79	2,035,119,374.06
二、本期经营活动：			
基金净收益		357,182,322.92	47,327,990.96
未实现估值增值变动数		758,493,860.54	-30,168,775.50
经营活动产生的基金净值变动数		1,115,676,183.46	17,159,215.46
三、本期向持有人分配收益		-58,000,000.16	-12,000,000.12
四、期末基金净值		3,186,204,312.09	2,040,278,589.40

所附附注为本会计报表的组成部分

(五)、会计报表附注

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制，会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会颁布并于2004年7月1日起实施的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

1、会计政策

本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、本报告期重大会计差错

无。

3、关联方关系和关联方交易

(1)、 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

关 联 人	关 系	交易性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金管理人 基金发起人	提取管理费	基金合同
中国工商银行股份有限公司	基金托管人	提取托管费	基金合同
上海国际信托投资有限公司	管理公司股东 基金发起人		
上海电气(集团)总公司	管理公司股东		
上海广电(集团)有限公司	管理公司股东		
上海沸点投资发展有限公司	管理公司股东		
上海工业投资(集团)有限公司	管理公司股东		

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). 通过关联方席位进行的交易

①本报告期(2006 年 1-6 月)通过关联人席位的股票成交量：无。

上年度的上半年(2005 年 1-6 月)通过关联人席位的股票成交量：无。

②本报告期(2006 年 1-6 月)通过关联人席位的债券和回购成交量：无。

上年度的上半年(2005 年 1-6 月)通过关联人席位的债券和回购成交量：无。

③本报告期(2006 年 1-6 月)与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：无。

上年度的上半年(2005 年 1-6 月)与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：无。

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费，按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提，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付给基金管理人。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 18,863,585.61 元。(上年度的上半年：15,559,226.07 元)

② 基金托管费



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 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提，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。

本基金在本报告期间需支付基金托管费 3,143,930.88 元。(上年度的上半年：2,593,204.38 元)

③ 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工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计算。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 119,329,481.36 元 (2005 年 6 月 30 日：167,113,255.68 元)。2006 年上半年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 466,674.94 元 (2005 年上半年：820,946.27 元)

(4). 基金各关联方投资本基金的情况

1、基金管理公司投资本基金的情况：

2006 年度的上半年 (2006 年 1-6 月) 基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	期初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例 (%)			持有份额	持有比例 (%)	
华安基金管理有限公司	14,433,600	0.72	-	-	14,433,600	0.72	-

2005 年度的上半年 (2005 年 1-6 月) 基金管理有限公司投资本基金的情况：

关联人	期初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例 (%)			持有份额	持有比例 (%)	
华安基金管理有限公司	12,000,000	0.60	-	-	12,000,000	0.60	-

(5). 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：

关联人	2006 年 6 月 30 日		2005 年 6 月 30 日	
	持有份额	持有比例 (%)	持有份额	持有比例 (%)
上海国际信托投资有限公司	18,000,000	0.90	18,000,000	0.90

4、基金会计报表重要项目的说明

(1). 应收利息明细：

明细项目	2006 年 6 月 30 日
银行存款利息	14,215.74



清算备付金利息	1,689.75
债券利息	7,890,628.94
买入返售证券利息	-
合计	7,906,534.43

(2). 待摊费用明细：

明细项目	2006 年 6 月 30 日
分红手续费	125,553.15
合计	125,553.15

(3). 投资估值增值明细：

明细项目	2006 年 6 月 30 日
股票估值增值余额	830,026,666.86
债券估值增值余额	-1,757,297.67
合计	828,269,369.19

(4). 应付佣金明细：

明细项目	2006 年 6 月 30 日
光大证券股份有限公司	489,444.68
中银国际证券有限责任公司	205,995.91
国信证券有限责任公司	245,299.53
海通证券股份有限公司	124,058.95
上海证券有限责任公司	24,148.63
申银万国证券股份有限公司	103,785.62
合计	1,192,733.32

(5). 其他应付款明细：

券商代垫交易保证金	2006 年 6 月 30 日
	1,500,000.00
合计	1,500,000.00

(6). 预提费用明细：

明细项目	2006 年 6 月 30 日
信息披露费	288,603.31
审计费用	49,588.57
上市年费	29,752.78
合计	367,944.66

(7). 卖出股票：



明细项目	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,384,097,854.16
减：佣金	1,158,573.64
成本总额	1,129,226,659.83
股票差价收入	253,712,620.69
(8). 卖出债券	
明细项目	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
卖出债券成交总额	970,459,129.91
减：成本总额	947,942,358.27
应收利息总额	20,228,451.33
债券差价收入	2,288,320.31
(9). 其他收入：	
明细项目	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
新股手续费返还	288.75
合 计	288.75
(10). 其他费用：	
明细项目	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
上市年费	29,752.78
信息披露费	168,603.31
审计费用	49,588.57
分红手续费	48,446.85
账户维护费用	12,540.00
交易所费用	5,910.49
其他	8,021.50
合 计	322,863.50
(11). 基金收益分配：	
除权日	本报告期发生额
2006 年 4 月 19 日	58,000,000.16
本期累计收益分配金额	58,000,000.16
(12). 因股权分置改革而获得非流通股 股股东支付的现金对价情况	
明细项目	2006 年 1 月 1 日至 6 月 30 日
股权分置现金对价对股票投资成本的累计	29,893,397.75

影响金额

5、本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

1. 本基金截止本报告期末流通受限股票情况如下：

名称	数量	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	受限期限
中工国际	48,489	358,818.60	854,376.18	市价	网下申购流通受限	2006-9-19
大同煤业	302,311	2,043,622.36	3,104,733.97	市价	网下申购流通受限	2006-9-23
中国银行	291,000	896,280.00	896,280.00	成本	未上市	2006-7-5
合计		3,298,720.96	4,855,390.15			

本基金截至 2006 年 6 月 30 日止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。

股票代码	股票名称	数量	总成本	总市值	年末估值单价	转让受限原因	停牌日	复牌日	复牌日开盘价格
600811	东方集团	4,000,000	29,798,137.64	28,440,000.00	7.11	股权分置改革停牌	2006-6-26	2006-7-6	6.73
600827	友谊股份	1,986,900	13,097,976.89	22,273,149.00	11.21	股权分置改革停牌	2006-5-22	2006-7-3	9.05
000657	中钨高新	300,655	4,187,376.06	4,070,868.70	13.54	股权分置改革停牌	2006-6-12	2006-7-6	14.66
合计			47,083,490.59	54,784,017.70					

2. 本基金截止本报告期末流通受限债券：无

七、投资组合报告

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	2,412,781,920.64	75.24%
2	债券	649,803,567.73	20.26%
3	银行存款和清算备付金合计	123,402,785.13	3.85%
4	其他资产	20,906,317.23	0.65%
	合计	3,206,894,590.73	100.00%

(二)、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
B	采掘业	303,752,935.53	9.53%
C	制造业	1,350,321,920.13	42.38%
C0	食品、饮料	104,026,144.00	3.26%
C1	纺织、服装、皮毛	131,577,083.48	4.13%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	435,772,205.99	13.68%
C5	电子	46,198,311.59	1.45%



C6	金属、非金属	188,010,868.70	5.90%
C7	机械、设备、仪表	351,559,710.00	11.03%
C8	医药、生物制品	93,177,596.37	2.92%
F	交通运输、仓储业	114,800,000.00	3.60%
G	信息技术业	51,877,373.80	1.63%
H	批发和零售贸易	201,315,149.00	6.32%
I	金融、保险业	140,576,280.00	4.41%
J	房地产业	70,210,000.00	2.20%
K	社会服务业	104,754,376.18	3.29%
L	传播与文化产业	46,733,886.00	1.47%
M	综合类	28,440,000.00	0.89%
	合计	2,412,781,920.64	75.73%

(三)、股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值的比例
1	600309	G 万 华	18,309,309	267,132,818.31	8.38%
2	000792	G 钾 肥	8,000,000	160,480,000.00	5.04%
3	600036	G 招 行	18,000,000	139,680,000.00	4.38%
4	600851	G 海 欣	33,651,428	131,577,083.48	4.13%
5	600028	中国石化	20,000,000	125,800,000.00	3.95%
6	600009	G 沪机场	8,000,000	114,800,000.00	3.60%
7	600761	G 合 力	7,000,000	101,290,000.00	3.18%
8	600066	G 宇 通	12,000,000	100,080,000.00	3.14%
9	600583	G 海 工	4,200,000	96,390,000.00	3.03%
10	600660	G 福 耀	10,000,000	82,000,000.00	2.57%
11	600519	G 茅 台	1,500,000	71,160,000.00	2.23%
12	000402	G 金融街	8,500,000	70,210,000.00	2.20%
13	002007	华兰生物	3,000,017	66,630,377.57	2.09%
14	000063	G 中 兴	1,807,574	51,877,373.80	1.63%
15	600153	G 建 发	10,000,000	50,400,000.00	1.58%
16	000987	G 穗友谊	4,500,000	49,950,000.00	1.57%
17	600456	G 宝 钛	1,050,000	49,350,000.00	1.55%
18	000061	G 农产品	5,000,000	47,250,000.00	1.48%
19	600037	G 歌 华	3,130,200	46,733,886.00	1.47%
20	000978	G 桂 旅	5,000,000	45,100,000.00	1.42%
21	000069	G 华侨城	3,500,000	40,600,000.00	1.27%
22	000898	G 鞍 钢	6,000,000	36,300,000.00	1.14%
23	000983	G 西 煤	4,519,204	36,244,016.08	1.14%
24	600261	G 浙阳光	2,489,356	34,178,857.88	1.07%
25	000651	G 格 力	2,303,793	31,631,077.89	0.99%
26	000729	G 燕 啤	3,556,000	30,652,720.00	0.96%



27	600879	G 火 箭	2,125,617	29,014,672.05	0.91%
28	600123	G 兰 花	2,259,578	29,012,981.52	0.91%
29	600694	大商股份	700,000	28,567,000.00	0.90%
30	600811	东方集团	4,000,000	28,440,000.00	0.89%
31	600316	洪都航空	800,000	27,512,000.00	0.86%
32	000768	G 西 飞	2,933,184	25,284,046.08	0.79%
33	600827	友谊股份	1,986,900	22,273,149.00	0.70%
34	000410	G 沈 机	1,603,154	21,883,052.10	0.69%
35	600350	G 基建	5,000,000	18,200,000.00	0.57%
36	600104	G 上 汽	2,502,502	14,864,861.88	0.47%
37	000538	G 云白药	461,499	13,498,845.75	0.42%
38	600348	G 国 阳	1,003,131	13,201,203.96	0.41%
39	000970	G 三 环	1,000,000	12,420,000.00	0.39%
40	002008	大族激光	786,099	12,019,453.71	0.38%
41	600196	G 复 星	1,600,000	10,720,000.00	0.34%
42	000950	G ST 建峰	1,350,892	8,159,387.68	0.26%
43	000657	中钨高新	300,655	4,070,868.70	0.13%
44	000401	G 冀 东	1,000,000	3,870,000.00	0.12%
45	601001	大同煤业	302,311	3,104,733.97	0.10%
46	600500	G 中 化	500,000	2,875,000.00	0.09%
47	600211	西藏药业	200,895	2,328,373.05	0.07%
48	600893	华润生化	323,600	2,213,424.00	0.07%
49	601988	中国银行	291,000	896,280.00	0.03%
50	002051	中工国际	48,489	854,376.18	0.03%

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或累计买入、累计卖出价值前二十名的股票明细

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的比例
01	600009	G 沪机场	103,112,462.02	4.84%
02	600028	中国石化	82,857,089.66	3.89%
03	000402	G 金融街	69,161,002.09	3.25%
04	600761	G 合 力	55,951,183.97	2.63%
05	000063	G 中 兴	52,878,965.96	2.48%
06	000069	G 华侨城	45,350,680.58	2.13%
07	600037	G 歌 华	42,346,226.77	1.99%
08	002007	华兰生物	38,175,807.72	1.79%
09	000898	G 鞍 钢	38,065,420.87	1.79%
10	000089	G 深机场	32,510,835.85	1.53%



11	000983	G 西 煤	29,958,333.30	1.41%
12	600519	G 茅 台	29,924,868.63	1.41%
13	600811	东方集团	29,822,475.27	1.40%
14	000987	G 穗友谊	29,451,504.30	1.38%
15	600316	洪都航空	28,420,126.02	1.34%
16	000061	G 农产品	27,092,653.25	1.27%
17	000651	G 格 力	25,131,130.94	1.18%
18	600036	G 招 行	24,651,200.45	1.16%
19	600879	G 火 箭	22,840,708.58	1.07%
20	000768	G 西 飞	22,822,475.06	1.07%

占期初基金资产净值
的比例

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值 的比例
01	000792	G 钾 肥	132,519,239.99	6.23%
02	600050	G 联 通	111,187,654.38	5.22%
03	600196	G 复 星	99,354,075.63	4.67%
04	000089	G 深机场	82,118,275.46	3.86%
05	600660	G 福 耀	65,025,991.34	3.05%
06	600309	G 万 华	59,426,794.80	2.79%
07	000970	G 三 环	49,890,050.58	2.34%
08	600598	G 北大荒	42,320,885.73	1.99%
09	600261	G 浙阳光	41,754,972.34	1.96%
10	600583	G 海 工	39,134,740.21	1.84%
11	600036	G 招 行	38,598,341.22	1.81%
12	600900	G 长 电	33,430,002.72	1.57%
13	000933	G 神 火	32,961,882.17	1.55%
14	600096	G 云天化	28,329,655.72	1.33%
15	600153	G 建 发	24,425,678.74	1.15%
16	000027	G 深能源	23,218,636.98	1.09%
17	000031	G 中粮地	21,977,968.89	1.03%
18	000972	G 中 基	20,776,881.20	0.98%
19	000549	湘火炬A	20,682,084.05	0.97%
20	600236	桂冠电力	20,388,827.08	0.96%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额。

买入股票的成本总额：1,229,623,876.43

卖出股票的收入总额：1,384,097,854.16

*注：买入股票的成本总额未扣减股权分置获得现金对价 29,893,397.75 元。

(五)、按债券品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	386,655,258.80	12.14%
2	金融债券	263,148,308.93	8.26%

3	企业债券	-	-
4	可转换债券	-	-
	合计	649,803,567.73	20.39%

(六)、基金投资前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	060210	06 国开 10	900,000	88,998,392.95	2.79%
2	060209	06 国开 09	800,000	79,572,685.00	2.50%
3	010214	02 国债(14)	670,770	67,352,015.70	2.11%
4	010308	03 国债(8)	571,900	55,703,060.00	1.75%
5	010010	20 国债(10)	469,620	47,131,063.20	1.48%

(七)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

本报告期末本基金所持有权证情况：无

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日（或最近交易日）的市场平均价计算，已发行未上市股票采用成本价计算，未上市交易的权证投资（包括配股权证）按公允价值估值。

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	668,167.59
2	权证交易保证金	98,780.49
3	应收证券清算款	11,262,127.57
4	应收股利	845,154.00
5	应收利息	7,906,534.43
6	待摊费用	125,553.15
	合计	20,906,317.23

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
—	—	—	—	—	—

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	成本总额(元)	获得途径
1	580997	招行 CMP1	9,000,000	0.00	股权分置改革被动持有
2	580005	万华 HXB1	2,661,862	0.00	股权分置改革被动持有
3	580993	万华 HXP1	3,992,793	0.00	股权分置改革被动持有
4	038005	深能 JTP1	2,532,690	0.00	股权分置改革被动持有
5	580990	茅台 JCP1	2,462,928	0.00	股权分置改革被动持有
6	038008	钾肥 JTP1	3,600,000	0.00	股权分置改革被动持有

八、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	126,461	-
平均每户持有基金份额	15,815.15	-
机构投资者持有的基金份额	719,300,170	35.97%
个人投资者持有的基金份额	1,280,699,830	64.03%

前十名持有人的名称

序号	项目	份额(份)	占总份额的比例
1	中国人寿保险股份有限公司	195,251,912	9.76%
2	中国人寿保险(集团)公司	185,886,535	9.29%
3	全国社保基金六零四组合	32,118,730	1.61%
4	上海宝钢集团公司	26,750,000	1.34%
5	中国平安保险(集团)股份有限公司	25,991,006	1.30%
6	全国社保基金六零二组合	25,046,121	1.25%
7	招商证券股份有限公司—招商银行股份 有限公司—招商证券基金宝集合资 产管理计划	21,846,048	1.09%
8	上海国际信托投资有限公司	18,000,000	0.90%
9	全国社保基金六零一组合	17,655,774	0.88%
10	华安基金管理有限公司	14,433,600	0.72%



九、 重大事件

(一)、 基金份额持有人大会决议：无

(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：

本基金管理人重大人事变动如下：

本基金管理人于 2006 年 2 月 15 日发布公告：鉴于第二届董事会任期已经届满，经华安基金管理有限公司第十三次股东会议选举，产生由王成明先生、韩方河先生、辜昌基先生、俞妙根先生、顾培柱先生、张军先生、萧灼基先生、吴伯庆先生、夏大慰先生组成的第三届董事会，其中萧灼基先生，吴伯庆先生、夏大慰先生为独立董事。杜建国先生、缪恒生先生、柳亚男先生、陶晋先生、李华强先生、朱勇先生不再担任本公司董事。

本基金管理人于 2006 年 3 月 9 日公告：研究决定对“安信证券投资基金”的基金经理作如下调整：决定聘用汤礼辉先生担任安信证券投资基金基金经理，林彤彤先生不再担任安信证券投资基金基金经理职务。

本基金管理人于 2006 年 5 月 27 日发布公告：经华安基金管理有限公司第三届董事会会议审议通过，并报中国证监会审核批准，免去杜建国先生董事长职务，由王成明先生代为履行公司董事长职务。

本基金管理人于 2006 年 8 月 19 日发布公告：经华安基金管理有限公司第三届董事会审议通过，决定免除王成明先生公司代行董事长的职务，同时选举俞妙根先生代为履行公司董事长的职务。

(三)、 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼：无

(四)、 基金投资策略的改变：无

(五)、 基金收益分配事项：

	分红公告日	权益登记日	除息日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配金额
本期第1次分红	2006-4-13	2006-4-18	2006-4-19	0.29 元	58,000,000.16

(六)、 基金改聘为其审计的会计师事务所情况,包括解聘原会计师事务所的原因,以及是否履行了必要的程序：没有更换会计师事务所。

(七)、 基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形,包括稽查或处罚的次数、原因及结论,如监管部门提出整改意见的,应简单说明整改情况：无

(八)、 本报告期间租用证券公司席位情况如下：

1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

新增席位



券商名称	上交所席位数	深交所席位数
-	-	-
退租席位		
券商名称	上交所席位数	深交所席位数
天同证券	1	1
上海证券	-	1

2、交易成交量及佣金情况：

(1). 股票交易情况：

券商名称	租用席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
上海证券有限责任公司	1	29,450,019.04	1.13%	24,148.63	1.16%
招商证券股份有限公司	1	152,302,355.51	5.84%	124,642.48	5.98%
申银万国证券股份有限公司	1	219,172,541.71	8.40%	171,503.62	8.23%
光大证券股份有限公司	1	685,622,655.79	26.27%	551,649.16	26.47%
国信证券有限责任公司	2	593,897,147.82	22.76%	465,400.51	22.33%
海通证券股份有限公司	1	229,111,874.07	8.78%	187,720.82	9.01%
国泰君安证券股份有限公司	1	76,857,626.05	2.95%	62,921.41	3.02%
红塔证券股份有限公司	1	244,663,535.94	9.38%	200,177.13	9.60%
渤海证券有限责任公司	1	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	378,405,421.43	14.50%	296,105.27	14.21%
合计	11	2,609,483,177.36	100.00%	2,084,269.03	100.00%

(2). 债券及回购交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例
上海证券有限责任公司	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	24,196,555.00	3.22%	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	616,689,096.20	81.96%	431,900,000.00	55.95%
国信证券有限责任公司	42,606,445.70	5.66%	340,000,000.00	44.05%
海通证券股份有限公司	14,826,940.00	1.97%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	10,000,020.00	1.33%	-	-
红塔证券股份有限公司	44,137,434.10	5.87%	-	-
渤海证券有限责任公司	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-
合 计	752,456,491.00	100.00%	771,900,000.00	100.00%

(九)、其他重要事项

1、基金公告事项：

公告事项	披露日期
华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金 2005 年度收益分配决议	[2006-03-28]
华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金 2005 年度收益分配实施公告	[2006-04-13]
华安基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告	[2006-06-20]
华安基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告	[2006-06-28]



十、 备查文件目录

- 1、《安信证券投资基金基金合同》
- 2、《安信证券投资基金招募说明书》
- 3、《安信证券投资基金托管协议》
- 4、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。
- 5、上述文件的存放地点和查阅方式如下：
存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互
联网站 <http://www.huaan.com.cn>。
查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基
金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
2006 年 8 月 24 日