



华安 MSCI 中国 A 股指数 增强型证券投资基金 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

目 录

一、	重要提示.....	3
二、	基金产品概况.....	3
	(一)、基金概况.....	3
	(二)、基金的投资.....	3
	(三)、基金管理人.....	4
	(四)、基金托管人.....	4
	(五)、信息披露.....	4
	(六)、登记注册机构.....	5
三、	主要财务指标和基金净值表现.....	5
	(一)、主要财务指标（未经审计）.....	5
	(二)、净值表现.....	5
四、	管理人报告.....	6
	(一)、基金管理人及基金经理简介.....	6
	(二)、基金运作合规性声明.....	7
	(三)、基金经理工作报告.....	7
五、	托管人报告.....	8
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.....	11
七、	投资组合报告.....	16
	(一)、基金资产组合.....	16
	(二)、股票投资组合.....	16
	(三)、股票明细.....	17
	(四)、报告期内股票投资组合的重大变动.....	22
	(五)、债券投资组合.....	24
	(六)、权证投资组合.....	24
	(七)、资产支持证券投资组合.....	24
	(八)、投资组合报告附注.....	24
八、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	25
	(一)、基金份额持有人户数和持有人结构.....	25
九、	开放式基金份额变动.....	26
十、	重大事件.....	26
十一、	备查文件目录.....	29

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,投资者在做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

(一)、基金概况

基金名称:	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
基金简称:	华安中国 A 股
交易代码:	040002
深交所行情代码:	160402
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2002 年 11 月 8 日
期末基金份额总额:	729,511,676.92 份
基金存续期:	不定期

(二)、基金的投资

投资目标: 运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。

投资策略: (1) 资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。

(2) 股票投资:本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比

较基准的跟踪偏离度,适时对投资组合进行调整,使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外,本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。

(3)其它投资:本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具,减少基金资产的风险并提高基金的收益。

业绩比较基准:

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 1 月 15 日,本基金的比较基准为:95%*上证 180 指数收益率+5%*金融同业存款利率;2006 年 1 月 16 日开始,95%×MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5%×金融同业存款利率

风险收益特征:

本基金为增强型指数基金,通过承担证券市场的系统性风险,来获取市场的平均回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。

(三)、基金管理人

基金管理人:	华安基金管理有限公司
注册地址:	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼
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@huanan.com.cn
客户服务热线:	40088-50099、021-68604666

(四)、基金托管人

基金托管人:	中国工商银行股份有限公司
注册地址:	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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

(五)、信息披露

信息披露报纸:	中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网网址:	http://www.huanan.com.cn

基金半年度报告置备 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼
地点：

(六)、登记注册机构

登记注册机构： 华安基金管理有限公司
办公地点： 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(单位：人民币元)

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。

(一)、主要财务指标（未经审计）

财务指标	本报告期
基金本期净收益：	214,224,715.99
加权平均基金份额本期净收益：	0.1844
期末可供分配基金收益	131,331,905.14
期末可供分配基金份额收益	0.1800
期末基金资产净值：	948,089,352.81
期末基金份额净值：	1.300
基金加权平均净值收益率	17.67%
本期基金份额净值增长率	52.80%
基金份额累计净值增长率	51.66%

(二)、净值表现

A、本报告期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	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	-	-
过去一个月	3.42%	1.61%	2.23%	1.66%	1.19%	-0.05%
过去三个月	34.84%	1.55%	30.99%	1.62%	3.85%	-0.07%
过去六个月	52.80%	1.27%	49.44%	1.32%	3.36%	-0.05%
过去一年	61.55%	1.10%	55.81%	1.16%	5.74%	-0.06%
过去三年	43.59%	1.05%	27.22%	1.07%	16.37%	-0.02%
自基金合同 生效起至今	51.66%	1.01%	26.24%	1.05%	25.42%	-0.04%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

华安MSCI中国A股份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图
2002/11/8--2006/6/30



四、 管理人报告

(一)、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

刘光华 先生：MBA，8 年银行、基金从业经历。曾在中国农业银行上海市分行国际业务部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 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、基金投资部基金经理助理。现任华安 MSCI 中国 A 股指数基金经理、上证 180ETF 基金经理。

(二)、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《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金合同》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》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。

(三)、基金经理工作报告

06 年 6 月 30 日，华安 MSCI 基金单位净值 1.3 元，累计净值 1.47 元，跟踪偏离度为 0.155%。

报告期内，本基金跟踪的标的指数发生了变更。从 05 年底至 06 年 1 月 15 日，本基金跟踪的是上证 180 指数，对应的比较基准为： $95\% \times \text{上证 180 指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。从 06 年 1 月 16 日开始，本基金的标的指数由原来的上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数（对本次变更的具体说明，可参阅本基金管理人于 06 年 1 月 14 日发布的公告），比较基准也相应变为 $95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$ 。06 年上半年，上证 180 指数上涨 46.64%，MSCI 中国 A 股指数上涨 52.57%，本基金的复合比较基准增长 49.44%。上半年本基金单位净值增长 52.8%，超越复合比较基准 3.36 个百分点。

今年上半年，A 股市场扭转了自 01 年以来的下跌趋势，覆盖沪深两市的 MSCI 中国 A 股指数 6 个月的涨幅超过了 50%。投资者的信心得到了较大地恢复，体现为两个交易所的新开户数大幅增长，二级市场的交易也趋于活跃。我们认为，推动本轮市场大幅上涨的主要因素包括：1) 05 年底、06 年初，A 股的估值水平偏低，无论是相对于历史、还是与周边市场如 H 股比较，A 股都极具吸引力。2) 我国经济继续保持较快的增长速度，为上市公司盈利增长提供了良好的经营环境。从统计数据看，反映企业盈利能力的重要指标工业企业利润总额在上半年的各月份，今年以来累计同比增幅都在 20% 左右，表明实体经济运行质量较高。3) 股改顺利推进，多数公司支付对价水平符合市场预期。更为重要的是，完成股改的公司中，控股股东与二级市场的投资者之间更易找到利益共同点，而包括管理层股权激励、整体上市、大股东二级市场增持等都有利于增强二级市场投资者的持股信心。4) 人民币升值的预期没有改变，在此背景下，A 股市场作为人民币资产的重要类别，也成为包括外资在内的各类机构增持的目标。

06 年上半年，我国的宏观经济再次出现了快速增长，GDP 同比增幅高达

10.9%，这同时也引发了政府关于经济可能出现过热的担忧。我们认为，本轮宏观调控与 04 年不同的是，CPI 并没有大幅上升。这决定了本轮调控更具有前瞻性，其目标是要延续在低通胀水平下经济适度增长的周期。

展望下半年，投资者首先需要检验的是上半年的市场上涨能否得到企业盈利增长的支持。这样，中报业绩将显得较为关键。其次，在股改接近尾声的时候，IPO 和再融资也重新启动。我们相信，大型蓝筹公司的上市是 A 股分享中国经济增长、并得以长期健康发展的基石。同时，我们也需要面对短期内资金面的供给能否跟上市场扩张步伐的现实。

华安 MSCI 基金将在上半年超越比较基准的基础上，利用下半年市场结构性波动的行情，运用本基金适度增强的特点，通过基金管理人的努力，争取下半年继续超越基准，回报基金持有人。

五、 托管人报告

2006年上半年，本托管人在对华安A股基金的托管过程中，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，华安A股基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安A股基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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华安A股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

项 目	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
资产：			
银行存款		59,571,144.31	100,068,029.25
清算备付金		659,372.66	1,177,468.18
交易保证金		842,891.14	250,000.00

应收证券清算款		2,048,076.20	941,937.69
应收股利		317,607.30	0.00
应收利息	4(1)	80,001.59	39,097.59
应收申购款		3,263,411.57	733,235.21
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		890,345,590.54	1,437,589,520.84
其中：股票投资成本		662,231,982.84	1,497,628,178.11
债券投资市值		29,658,961.96	0.00
其中：债券投资成本		29,658,961.96	0.00
配股权证		0.00	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		<u>986,787,057.27</u>	<u>1,540,799,288.76</u>

负债：

应付证券清算款		937,409.46	257,683.28
应付赎回款		5,845,277.39	6,026,588.91
应付赎回费		0.00	0.00
应付管理人报酬		773,456.11	1,435,385.31
应付托管费		154,691.20	287,077.06
应付佣金	4 (3)	1,149,969.73	682,503.09
应付利息		17,220.87	0.00
其他应付款	4 (4)	500,000.00	250,000.00
卖出回购证券款		29,100,000.00	0.00
预提费用	4 (5)	219,679.70	100,000.00
负债合计		<u>38,697,704.46</u>	<u>9,039,237.65</u>

所有者权益：

实收基金	4 (6)	729,511,676.92	1,729,244,455.42
未实现利得	4 (7)	87,245,770.75	-214,937,733.70
未分配收益		131,331,905.14	17,453,329.39
持有人权益合计		<u>948,089,352.81</u>	<u>1,531,760,051.11</u>
负债和所有者权益合计		<u>986,787,057.27</u>	<u>1,540,799,288.76</u>

(二)、经营业绩表

项 目	附注	2006年1-6月	2005年1-6月
收入：			
股票差价收入	4 (8)	181,252,723.88	-16,184,939.79
债券差价收入	4 (9)	-10,711.96	7,607,517.88

权证差价收入		25,016,364.20	0.00
债券利息收入		46,206.53	5,568,108.18
存款利息收入		410,330.54	421,624.17
股利收入		15,023,152.90	27,384,126.30
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	4 (10)	1,359.00	11,954.43
收入合计		<u>221,739,425.09</u>	<u>24,808,391.17</u>

费用：

基金管理人报酬		6,039,187.39	8,654,075.54
基金托管费		1,207,837.53	1,730,815.04
卖出回购证券支出		37,953.91	505,671.60
其他费用	4 (11)	229,730.27	235,870.19
其中：信息披露费		168,603.31	168,603.31
审计费用		51,076.39	49,588.57
费用合计		<u>7,514,709.10</u>	<u>11,126,432.37</u>

基金净收益		<u>214,224,715.99</u>	<u>13,681,958.80</u>
加：未实现估值增值变动数		288,152,264.97	-111,353,474.33
基金经营业绩		<u>502,376,980.96</u>	<u>-97,671,515.53</u>

(三)、收益分配表

项 目	附注	2006年1-6月	2005年1-6月
本期基金净收益		214,224,715.99	13,681,958.80
加：期初未分配收益		17,453,329.39	-742,002.92
加：本期损益平准金		-63,726,512.69	2,903,068.77
可供分配基金净收益		<u>167,951,532.69</u>	<u>15,843,024.65</u>
减：本期已分配基金净收益		36,619,627.55	0.00
期末基金未分配净收益		<u>131,331,905.14</u>	<u>15,843,024.65</u>

(四)、净值变动表

项 目	附注	2006年1-6月	2005年1-6月
一、期初基金净值		1,531,760,051.11	1,591,321,034.13
二、本期经营活动：			
基金净收益		214,224,715.99	13,681,958.80
未实现估值增值变动数		<u>288,152,264.97</u>	<u>-111,353,474.33</u>
经营活动产生的基金净值变动数		<u>502,376,980.96</u>	<u>-97,671,515.53</u>

三、本期基金单位交易：

基金申购款		702,805,832.69	1,610,961,008.45
-------	--	----------------	------------------

基金赎回款	-1,752,233,884.40	-952,416,945.70
基金单位交易产生的基金净值变动数	-1,049,428,051.71	658,544,062.75
四、本期向持有人分配收益	-36,619,627.55	0.00
五、期末基金净值	948,089,352.81	2,152,193,581.35

(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于 2005 年 7 月 1 日起颁布的《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	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构	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、基金代销机构	提取托管费 银行间债券买卖	基金合同
上海国际信托投资有限公司	基金管理人的股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人的股东		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东		
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东		

(2). 通过关联方席位进行的交易

本报告期本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券和回购交易。

上年度的上半年本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券和回购交易。

(3). 本报告期与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

关 联 人	买入债券结算金额	卖出债券结算金额	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行股份有限公司	29,710,500.00	29,700,000.00	-	-	-	-

上年度的上半年本基金没有与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(4). 基金管理人未运用固有资金对本基金进行投资。

(5). 关联方报酬

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% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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 6,039,187.39 元。（上年度的上半年：8,654,075.54 元）

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 0.2% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 1,207,837.53 元。（上年度的上半年：1,730,815.04 元）

(6). 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，自 2005 年 3 月 17 日起按银行活期利率计算，此前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 59,571,144.31 元（2005 年 6 月 30 日：237,533,143.76 元）。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 399,182.59 元（2005 年上半年：395,089.33 元）

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	本报告期末金额
银行存款利息	12,201.95
备付金利息	267.03
债券利息	67,532.61
买入返售证券利息	0.00
合计	80,001.59

(2). 投资估值增值明细：

明细项目	本报告期末金额
股票估值增值余额	228,113,607.70
债券估值增值余额	0.00
合计	228,113,607.70

(3). 应付佣金明细：

明细项目	本报告期末金额
中信证券股份有限公司	112,497.69
招商证券股份有限公司	112,955.38
申银万国证券股份有限公司	35,849.97
银河证券有限责任公司	78,603.26
国金证券有限责任公司 (原成都证券有限责任公司)	388,127.64
广发证券股份有限公司	421,935.79
合计	1,149,969.73

(4). 其他应付款明细：

	本报告期末金额
券商垫付交易保证金	500,000.00
合计	500,000.00

(5). 预提费用明细：

明细项目	本报告期末金额
信息披露费	168,603.31
审计费用	51,076.39
合计	219,679.70

(6). 实收基金变动明细：

明细项目	本报告期金额
期初数	1,729,244,455.42
加：本期因申购的增加数	694,240,925.31
减：本期因赎回的减少数	1,693,973,703.81
期末数	729,511,676.92

(7). 未实现利得明细：

明细项目	金额
期初未实现利得：	-214,937,733.70
其中：投资估值增值数：	-60,038,657.27
未实现利得平准金：	-154,899,076.43
加：本期投资估值增值发生数：	288,152,264.97
加：本期申购的未实现利得平准金：	-25,028,193.13
减：本期赎回的未实现利得平准金：	-39,059,432.61
期末未实现利得：	87,245,770.75
其中：投资估值增值数：	228,113,607.70
未实现利得平准金：	-140,867,836.95

(8). 卖出股票：

明细项目	本报告期发生额
卖出股票成交总额	1,762,793,655.45
减：佣金	1,484,370.39
成本总额	1,580,056,561.18
股票差价收入	181,252,723.88

(9). 卖出债券：

明细项目	本报告期发生额
卖出债券成交总额	29,700,000.00
减：成本总额	29,669,836.96
应收利息总额	40,875.00
债券差价收入	-10,711.96

(10). 其他收入：

明细项目	本报告期发生额
新股、配股手续费返还	1,359.00
合计	1,359.00

(11). 其他费用：

明细项目	本报告期发生额
审计费用	51,076.39
信息披露费	168,603.31
银行间费用	4,500.00
债券账户服务费	5,450.57
其他费用	100.00
合计	229,730.27

(12). 基金收益分配：

	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
本期分红	2006-6-2	2006-6-13	2006-6-13	0.50 元	36,619,627.55
本期累计收益分配金额					36,619,627.55

(13). 因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金

对价情况	2006 年上半年	2005 年上半年
明细项目		
股权分置现金对价对股票		
投资成本的累计影响金额	5,592,771.66	0.00

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列示如下：

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	停牌日期	半年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
600415	小商品城	2006-6-19	63.27	2006-7-4	57.05	60,000	2,151,424.21	3,796,200.00
600811	东方集团	2006-6-26	7.1	2006-7-6	6.73	493,964	2,253,494.96	3,507,144.40
600835	上海机电	2006-6-26	7.91	2006-7-10	8.69	881,361	6,440,332.65	6,971,565.51
600383	金地集团	2006-3-27	8.57	2006-7-11	9.43	643,387	2,967,693.94	5,513,826.59
600786	东方锅炉	2006-6-19	24.98	2006-7-4	27.00	70,000	935,797.20	1,748,600.00
600132	重庆啤酒	2006-6-26	24.83	2006-7-6	27.31	50,000	1,053,577.90	1,241,500.00
方案实施阶段停牌：								
000157	中联重科	2006-5-29	13.86	2006-7-14	10.88	300,000	1,879,356.37	4,158,000.00

000895	双汇发展	2006-5-31	31.17	-	-	300,000	4,811,460.25	9,351,000.00
600027	华电国际	2006-6-29	3.54	2006-8-1	2.46	504,402	1,641,786.42	1,785,583.08
600033	福建高速	2006-6-29	8.12	2006-7-14	6.15	350,000	2,645,563.60	2,842,000.00
600823	世茂股份	2006-6-15	5.12	2006-8-22	4.33	133,663	722,031.59	684,354.56
合计							27,502,519.09	41,599,774.14

本基金获配的新股和配股为流通受限、不能自由转让的资产。在估值时如果该股票还未上市，则按成本计价；如已上市，则按当日收盘价计价。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

股票名称	数量	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	流通受限期限
中国银行	194,000	597,520.00	597,520.00	按成本	网下认购未上市	2006-7-5 上市
合 计		597,520.00	597,520.00			

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

七、投资组合报告

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额	占基金总资产比例
1	股票	890,345,590.54	90.23%
2	债券	29,658,961.96	3.01%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款和清算备付金合计	60,230,516.97	6.10%
5	其他资产	6,551,987.80	0.66%
	合计	986,787,057.27	100.00%

(二)、股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票投资组合

	行业分类	市值	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	2,645,651.37	0.28%
B	采掘业	60,400,834.69	6.37%
C	制造业	422,638,995.19	44.58%
	C0 食品、饮料	68,627,042.98	7.24%
	C1 纺织、服装、皮毛	13,861,251.70	1.46%
	C3 造纸、印刷	6,309,434.00	0.67%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	50,310,409.85	5.31%
	C5 电子	14,414,124.46	1.52%
	C6 金属、非金属	136,706,980.95	14.42%
	C7 机械、设备、仪表	100,028,749.86	10.55%

C8	医药、生物制品	28,895,261.04	3.05%
C99	其他制造业	3,485,740.35	0.36%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	65,479,872.24	6.91%
E	建筑业	4,181,251.94	0.44%
F	交通运输、仓储业	76,386,247.15	8.06%
G	信息技术业	53,887,036.76	5.68%
H	批发和零售贸易	30,923,781.72	3.26%
I	金融、保险业	87,513,621.44	9.23%
J	房地产业	41,293,826.59	4.36%
K	社会服务业	14,140,923.30	1.49%
L	传播与文化产业	4,231,037.60	0.45%
M	综合类	26,024,990.55	2.74%
	合计	889,748,070.54	93.85%

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占资产净值比例
I 金融、保险业	597,520.00	0.06%
合计	597,520.00	0.06%

(三)、股票明细

1、指数投资的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	600036	G 招 行	3,900,000.00	30,069,000.00	3.17%
2	600028	中国石化	3,900,000.00	24,375,000.00	2.57%
3	600900	G 长 电	2,900,000.00	19,865,000.00	2.10%
4	600019	G 宝 钢	4,300,000.00	18,748,000.00	1.98%
5	600050	G 联 通	7,700,000.00	18,634,000.00	1.97%
6	600016	G 民 生	4,100,000.00	17,917,000.00	1.89%
7	600009	G 沪机场	1,150,000.00	16,571,500.00	1.75%
8	600519	G 茅 台	338,987.00	16,081,543.28	1.70%
9	600000	G 浦 发	1,600,000.00	15,856,000.00	1.67%
10	000002	G 万科 A	2,800,000.00	15,820,000.00	1.67%
11	600309	G 万 华	1,000,000.00	14,500,000.00	1.53%
12	000063	G 中 兴	450,000.00	12,874,500.00	1.36%
13	000858	G 五粮液	850,000.00	12,359,000.00	1.30%
14	000401	G 冀 东	3,009,940.00	11,558,169.60	1.22%
15	600795	国电电力	1,250,000.00	10,137,500.00	1.07%
16	600320	G 振 华	500,000.00	9,870,000.00	1.04%
17	000933	G 神 火	1,000,000.00	9,820,000.00	1.04%
18	000039	G 中 集	600,000.00	9,660,000.00	1.02%

19	000895	双汇发展	300,000.00	9,351,000.00	0.99%
20	600887	G 伊 利	390,000.00	8,888,100.00	0.94%
21	600018	G 上 港	500,000.00	8,575,000.00	0.90%
22	000792	G 钾 肥	420,000.00	8,526,000.00	0.90%
23	600104	G 上 汽	1,450,000.00	8,497,000.00	0.90%
24	000001	深发展 A	1,100,000.00	8,316,000.00	0.88%
25	000402	G 金融街	1,000,000.00	8,200,000.00	0.86%
26	000898	G 鞍 钢	1,300,000.00	7,956,000.00	0.84%
27	600030	G 中 信	502,091.00	7,953,121.44	0.84%
28	002024	苏宁电器	150,000.00	7,680,000.00	0.81%
29	600005	G 武 钢	2,550,000.00	7,242,000.00	0.76%
30	600832	G 明 珠	700,000.00	7,175,000.00	0.76%
31	600835	上海机电	881,361.00	6,971,565.51	0.74%
32	600269	G 赣 粤	654,500.00	6,427,190.00	0.68%
33	600694	大商股份	150,000.00	6,202,500.00	0.65%
34	600015	G 华 夏	1,350,000.00	6,088,500.00	0.64%
35	000825	G 太 钢	950,000.00	5,956,500.00	0.63%
36	000629	G 新钢钒	1,600,000.00	5,872,000.00	0.62%
37	600123	G 兰 花	450,000.00	5,850,000.00	0.62%
38	600660	G 福 耀	700,000.00	5,684,000.00	0.60%
39	600688	上海石化	900,000.00	5,598,000.00	0.59%
40	600642	G 申 能	906,038.00	5,563,073.32	0.59%
41	600383	金地集团	643,387.00	5,513,826.59	0.58%
42	000878	G 云 铜	552,950.00	5,463,146.00	0.58%
43	000538	G 云白药	180,000.00	5,211,000.00	0.55%
44	000069	G 华侨城	450,000.00	5,179,500.00	0.55%
45	600717	G 天津港	600,000.00	5,040,000.00	0.53%
46	600085	G 同仁堂	307,586.00	5,035,182.82	0.53%
47	000088	G 盐田港	550,000.00	5,005,000.00	0.53%
48	600418	G 江 汽	1,000,000.00	4,960,000.00	0.52%
49	000839	G 国 安	250,000.00	4,875,000.00	0.51%
50	000930	G 丰 原	850,000.00	4,870,500.00	0.51%
51	000983	G 西 煤	600,000.00	4,842,000.00	0.51%
52	600879	G 火 箭	350,000.00	4,721,500.00	0.50%
53	000729	G 燕 啤	550,000.00	4,702,500.00	0.50%
54	600026	G 中 海	712,698.00	4,547,013.24	0.48%
55	600839	G 长 虹	1,252,650.00	4,522,066.50	0.48%
56	000089	G 深机场	800,000.00	4,440,000.00	0.47%
57	600631	G 百 联	550,000.00	4,416,500.00	0.47%
58	600008	G 首 创	900,000.00	4,401,000.00	0.46%
59	000625	G 长 安	800,000.00	4,344,000.00	0.46%
60	000528	G 柳 工	521,800.00	4,237,016.00	0.45%
61	600183	G 生 益	385,922.00	4,229,705.12	0.45%
62	000157	中联重科	300,000.00	4,158,000.00	0.44%



63	000651	G 格 力	300,000.00	4,122,000.00	0.43%
64	600004	G 穗机场	600,000.00	4,122,000.00	0.43%
65	000027	G 深能源	501,000.00	4,063,110.00	0.43%
66	600011	G 华 能	800,000.00	4,024,000.00	0.42%
67	000709	G 唐 钢	1,000,000.00	3,960,000.00	0.42%
68	600585	G 海 螺	285,704.00	3,939,858.16	0.42%
69	600270	外运发展	359,509.00	3,918,648.10	0.41%
70	600177	G 雅戈尔	620,645.00	3,916,269.95	0.41%
71	600600	青岛啤酒	313,588.00	3,882,219.44	0.41%
72	600089	G 特 变	300,000.00	3,867,000.00	0.41%
73	600415	小商品城	60,000.00	3,796,200.00	0.40%
74	600690	G 海 尔	800,000.00	3,744,000.00	0.39%
75	600096	G 云天化	389,605.00	3,728,519.85	0.39%
76	600037	G 歌 华	250,240.00	3,688,537.60	0.39%
77	600649	G 原 水	650,000.00	3,679,000.00	0.39%
78	600348	G 国 阳	275,343.00	3,670,322.19	0.39%
79	600020	G 中 原	882,900.00	3,664,035.00	0.39%
80	600663	G 陆家嘴	500,000.00	3,605,000.00	0.38%
81	600271	G 航 信	120,000.00	3,601,200.00	0.38%
82	600884	G 杉 杉	557,415.00	3,584,178.45	0.38%
83	000630	G 铜 都	550,000.00	3,547,500.00	0.37%
84	000410	G 沈 机	256,570.00	3,543,231.70	0.37%
85	600001	G 邯 钢	900,000.00	3,537,000.00	0.37%
86	600500	G 中 化	624,208.00	3,533,017.28	0.37%
87	600811	东方集团	493,964.00	3,507,144.40	0.37%
88	000726	G 鲁 泰	450,000.00	3,460,500.00	0.36%
89	600205	山东铝业	183,690.00	3,350,505.60	0.35%
90	600886	G 华 靖	555,552.00	3,349,978.56	0.35%
91	000060	G 中 金	251,000.00	3,345,830.00	0.35%
92	000527	G 美 的	397,889.00	3,322,373.15	0.35%
93	600196	G 复 星	500,000.00	3,320,000.00	0.35%
94	600350	G 基 建	900,000.00	3,285,000.00	0.35%
95	000488	G 晨 鸣	627,987.00	3,265,532.40	0.34%
96	000912	G 泸天化	450,000.00	3,222,000.00	0.34%
97	600098	G 广 控	700,000.00	3,220,000.00	0.34%
98	600601	方正科技	800,000.00	3,200,000.00	0.34%
99	000800	G 轿 车	900,000.00	3,195,000.00	0.34%
100	600895	G 张 江	704,260.00	3,162,127.40	0.33%
101	000024	G 招商局	300,000.00	3,147,000.00	0.33%
102	000400	G 许 继	417,818.00	3,129,456.82	0.33%
103	000778	G 铸 管	496,800.00	3,095,064.00	0.33%
104	000581	G 威 孚	451,298.00	3,050,774.48	0.32%
105	600308	G 华 泰	385,304.00	3,043,901.60	0.32%
106	600029	南方航空	1,103,934.00	3,024,779.16	0.32%

107	000568	G 老 窖	200,000.00	2,926,000.00	0.31%
108	600066	G 宇 通	352,357.00	2,924,563.10	0.31%
109	000969	G 安泰 A	308,560.00	2,894,292.80	0.31%
110	000423	东阿阿胶	255,100.00	2,849,467.00	0.30%
111	600033	福建高速	350,000.00	2,842,000.00	0.30%
112	600276	G 恒 瑞	120,091.00	2,840,152.15	0.30%
113	600307	G 酒 钢	695,640.00	2,803,429.20	0.30%
114	600153	G 建 发	550,000.00	2,772,000.00	0.29%
115	600428	G 中 远	395,815.00	2,735,081.65	0.29%
116	600282	南钢股份	700,000.00	2,681,000.00	0.28%
117	600598	G 北大荒	584,029.00	2,645,651.37	0.28%
118	000422	G 宜 化	550,000.00	2,640,000.00	0.28%
119	600296	兰州铝业	300,000.00	2,622,000.00	0.28%
120	600808	G 马 钢	900,000.00	2,583,000.00	0.27%
121	600997	G 开 滦	345,000.00	2,566,800.00	0.27%
122	000822	G 海 化	550,000.00	2,557,500.00	0.27%
123	600010	G 包 钢	1,000,000.00	2,550,000.00	0.27%
124	600535	G 天士力	150,000.00	2,518,500.00	0.27%
125	600635	G 大 众	700,000.00	2,464,000.00	0.26%
126	600675	G 中 企	500,000.00	2,455,000.00	0.26%
127	000549	湘火炬 A	450,000.00	2,430,000.00	0.26%
128	600597	光明乳业	300,000.00	2,385,000.00	0.25%
129	600863	G 蒙 电	800,000.00	2,360,000.00	0.25%
130	600022	G 济 钢	549,606.00	2,324,833.38	0.25%
131	600362	G 江 铜	201,912.00	2,291,701.20	0.24%
132	000707	G 双 环	512,000.00	2,263,040.00	0.24%
133	600761	G 合 力	150,000.00	2,208,000.00	0.23%
134	600188	G 兖 煤	298,125.00	2,176,312.50	0.23%
135	600780	G 通 宝	700,000.00	2,170,000.00	0.23%
136	600508	G 上 能	300,000.00	2,133,000.00	0.22%
137	000939	凯迪电力	242,791.00	2,114,709.61	0.22%
138	000619	G 海型材	305,000.00	2,095,350.00	0.22%
139	000541	G 佛 照	210,976.00	2,052,796.48	0.22%
140	600797	G 网 新	565,220.00	2,023,487.60	0.21%
141	600198	G 大 唐	235,000.00	2,004,550.00	0.21%
142	000717	G 韶 钢	600,000.00	1,968,000.00	0.21%
143	600126	G 杭 钢	500,000.00	1,955,000.00	0.21%
144	600060	G 海 信	294,995.00	1,879,118.15	0.20%
145	000937	G 金 牛	300,000.00	1,866,000.00	0.20%
146	600027	华电国际	504,402.00	1,785,583.08	0.19%
147	600851	G 海 欣	450,847.00	1,758,303.30	0.19%
148	600786	东方锅炉	70,000.00	1,748,600.00	0.18%
149	600497	G 驰 宏	50,000.00	1,745,000.00	0.18%
150	000932	G 华 菱	450,000.00	1,728,000.00	0.18%

151	000031	G 中粮地	300,000.00	1,719,000.00	0.18%
152	000623	G 敖 东	100,000.00	1,698,000.00	0.18%
153	600068	G 葛洲坝	500,000.00	1,690,000.00	0.18%
154	600267	G 海 正	257,899.00	1,671,185.52	0.18%
155	000900	G 现投股	183,000.00	1,647,000.00	0.17%
156	600006	东风汽车	418,525.00	1,632,247.50	0.17%
157	000539	G 粤电力	350,000.00	1,627,500.00	0.17%
158	000554	泰山石油	277,162.00	1,590,909.88	0.17%
159	000652	G 泰 达	300,000.00	1,590,000.00	0.17%
160	600602	G 电 子	448,500.00	1,560,780.00	0.16%
161	000682	东方电子	500,000.00	1,545,000.00	0.16%
162	600747	G 大 显	683,941.00	1,538,867.25	0.16%
163	000807	G 云 铝	250,000.00	1,520,000.00	0.16%
164	000503	G 海 虹	181,713.00	1,508,217.90	0.16%
165	600591	G 上 航	500,000.00	1,465,000.00	0.15%
166	000751	G 锌 业	306,848.00	1,451,391.04	0.15%
167	600289	G 信 通	125,248.00	1,449,119.36	0.15%
168	600031	G 三 一	100,000.00	1,439,000.00	0.15%
169	000061	G 农产品	150,000.00	1,431,000.00	0.15%
170	600171	G 贝 岭	256,906.00	1,415,552.06	0.15%
171	000012	G 南 玻	162,600.00	1,391,856.00	0.15%
172	600770	G 综 艺	146,750.00	1,383,852.50	0.15%
173	600581	G 八 一	459,576.00	1,369,536.48	0.14%
174	000068	赛格三星	276,099.00	1,369,451.04	0.14%
175	600569	G 安 钢	558,879.00	1,346,898.39	0.14%
176	600718	G 东 软	112,125.00	1,342,136.25	0.14%
177	000559	G 钱 潮	375,000.00	1,335,000.00	0.14%
178	600628	G 新世界	150,000.00	1,318,500.00	0.14%
179	600643	爱建股份	200,000.00	1,314,000.00	0.14%
180	600100	G 同 方	142,737.00	1,306,043.55	0.14%
181	000680	G 山 推	240,000.00	1,300,800.00	0.14%
182	600859	王 府 井	100,000.00	1,295,000.00	0.14%
183	000425	徐工科技	207,600.00	1,287,120.00	0.14%
184	600138	G 中青旅	166,722.00	1,275,423.30	0.13%
185	000009	深宝安 A	343,800.00	1,247,994.00	0.13%
186	600132	重庆啤酒	50,000.00	1,241,500.00	0.13%
187	000970	G 三 环	100,000.00	1,238,000.00	0.13%
188	000793	G 燃 气	200,000.00	1,198,000.00	0.13%
189	600779	G 全 兴	162,446.00	1,187,480.26	0.13%
190	600871	仪征化纤	300,000.00	1,179,000.00	0.12%
191	000518	四环生物	500,000.00	1,145,000.00	0.12%
192	000698	G 沈 化	200,000.00	1,142,000.00	0.12%
193	600220	G 苏阳光	200,000.00	1,142,000.00	0.12%
194	000731	四川美丰	100,000.00	1,096,000.00	0.12%

195	600521	G 华 海	95,201.00	1,069,107.23	0.11%
196	600266	G 城 建	182,554.00	1,038,732.26	0.11%
197	000758	G 中 色	125,000.00	1,037,500.00	0.11%
198	600588	G 用 友	50,000.00	1,032,000.00	0.11%
199	000725	G 京东方	300,000.00	996,000.00	0.11%
200	000666	经纬纺机	200,000.00	988,000.00	0.10%
201	000659	G 中 富	300,000.00	942,000.00	0.10%
202	600547	G 鲁黄金	30,000.00	866,400.00	0.09%
203	600256	G 广 汇	150,000.00	834,000.00	0.09%
204	600740	G 山 焦	100,000.00	821,000.00	0.09%
205	600812	华北制药	250,000.00	795,000.00	0.08%
206	600121	G 郑煤电	174,469.00	772,897.67	0.08%
207	000828	G 东 控	200,000.00	772,000.00	0.08%
208	000869	G 张 裕	20,000.00	752,200.00	0.08%
209	000720	G 泰 山	256,000.00	747,520.00	0.08%
210	600866	G 星 湖	293,544.00	742,666.32	0.08%
211	600724	宁波富达	100,000.00	720,000.00	0.08%
212	600823	世茂股份	133,663.00	684,354.56	0.07%
213	000636	G 风 华	180,000.00	664,200.00	0.07%
214	600231	G 凌 钢	164,087.00	607,121.90	0.06%
215	000959	G 首 钢	200,000.00	592,000.00	0.06%
216	600210	G 紫 江	224,885.00	591,447.55	0.06%
217	600624	G 复 华	150,505.00	582,454.35	0.06%
218	600219	G 南 山	100,000.00	572,000.00	0.06%
219	000917	G 电 广	50,000.00	542,500.00	0.06%
220	000968	G 煤气化	100,000.00	490,000.00	0.05%
221	600637	G 上广电	104,718.00	468,089.46	0.05%
222	600170	G 建 工	95,188.00	415,019.68	0.04%
223	000960	G 锡 业	29,200.00	195,640.00	0.02%

2、积极投资的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	601988	中国银行	194,000	597,520.00	0.06%

(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% 或前二十名股票明细

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
1	000063	G 中 兴	39,695,671.09	2.59%
2	000002	G 万科 A	34,540,141.66	2.25%

3	600028	中国石化	20,959,105.62	1.37%
4	002025	航天电器	15,781,168.73	1.03%
5	600426	G 恒 升	13,969,793.08	0.91%
6	000039	G 中 集	13,024,957.67	0.85%
7	600036	G 招 行	13,016,635.05	0.85%
8	000069	G 华侨城	12,830,959.49	0.84%
9	000898	G 鞍 钢	12,552,063.07	0.82%
10	600900	G 长 电	12,449,358.18	0.81%
11	000401	G 冀 东	11,392,606.05	0.74%
12	000983	G 西 煤	10,805,023.03	0.71%
13	000402	G 金融街	10,777,504.19	0.70%
14	000001	深发展 A	10,561,268.74	0.69%
15	000933	G 神 火	10,386,976.67	0.68%
16	002007	华兰生物	9,988,710.98	0.65%
17	000060	G 中 金	9,842,081.46	0.64%
18	000858	G 五粮液	9,691,640.26	0.63%
19	600050	G 联 通	9,669,046.00	0.63%
20	000930	G 丰 原	9,204,837.82	0.60%

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
1	600050	G 联 通	89,798,952.88	5.86%
2	600036	G 招 行	81,963,674.10	5.35%
3	600900	G 长 电	77,496,938.79	5.06%
4	600019	G 宝 钢	64,248,784.36	4.19%
5	600028	中国石化	51,909,160.72	3.39%
6	600016	G 民 生	49,774,931.98	3.25%
7	600309	G 万 华	46,425,539.89	3.03%
8	600519	G 茅 台	37,484,474.48	2.45%
9	600000	G 浦 发	35,188,575.32	2.30%
10	600009	G 沪机场	34,108,089.45	2.23%
11	600005	G 武 钢	27,434,318.47	1.79%
12	600660	G 福 耀	26,518,314.67	1.73%
13	000063	G 中 兴	26,326,632.89	1.72%
14	600583	G 海 工	25,234,119.02	1.65%
15	000002	G 万科 A	24,512,578.31	1.60%
16	600096	G 云天化	22,208,476.51	1.45%
17	600018	G 上 港	19,227,189.44	1.26%
18	600426	G 恒 升	18,787,315.25	1.23%
19	600196	G 复 星	17,547,823.25	1.15%
20	600033	福建高速	17,200,482.97	1.12%

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：	750,253,137.57
卖出股票的收入总额：	1,762,793,655.45

(五)、 债券投资组合

1、 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	金融债	29,658,961.96	3.13%
	合计	29,658,961.96	3.13%

2、 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	060404	06 农发 04	300,000	29,658,961.96	3.13%

(六)、 权证投资组合

1、 基金投资前五名权证明细

本基金本报告期末没有持有权证投资。

(七)、 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。

(八)、 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）的市场收盘价计算，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
1	深交所结算保证金	842,891.14

2	应收股利	317,607.30
3	应收利息	80,001.59
4	应收申购款	3,263,411.57
5	应收证券清算款	2,048,076.20
	合计	6,551,987.80

4、处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没有持有可转换债券投资。

5、本报告期在股权分置改革中获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	权证数量	成本总额	获得途径
1	580997	招行 CMP1	6,014,351	0.00	股权分置改革被动持有
2	580996	沪场 JTP1	2,103,539	0.00	股权分置改革被动持有
3	580002	包钢 JTB1	698,906	0.00	股权分置改革被动持有
4	580995	包钢 JTP1	698,906	0.00	股权分置改革被动持有
5	030002	五粮 YGC1	528,629	0.00	股权分置改革被动持有
6	038004	五粮 YGP1	555,739	0.00	股权分置改革被动持有
7	580003	邯钢 JTB1	941,074	0.00	股权分置改革被动持有
8	580994	原水 CTP1	393,451	0.00	股权分置改革被动持有
9	580004	首创 JTB1	169,257	0.00	股权分置改革被动持有
10	580005	万华 HXB1	286,489	0.00	股权分置改革被动持有
11	580993	万华 HXP1	429,734	0.00	股权分置改革被动持有
12	038005	深能 JTP1	540,000	0.00	股权分置改革被动持有
13	580006	雅戈 QCB1	100,000	0.00	股权分置改革被动持有
14	580992	雅戈 QCP1	700,000	0.00	股权分置改革被动持有
15	580991	海尔 JTP1	1,080,000	0.00	股权分置改革被动持有
16	580007	长电 CWB1	435,000	0.00	股权分置改革被动持有
17	038006	中集 ZYP1	525,000	0.00	股权分置改革被动持有
18	580990	茅台 JCP1	640,000	0.00	股权分置改革被动持有
19	038008	钾肥 JTP1	171,052	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

(一)、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	19,120	-
平均每户持有基金份额	38,154.38	-
机构投资者持有的基金份额	382,860,928.33	52.48%
个人投资者持有的基金份额	346,650,748.59	47.52%

九、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	3,094,001,262.00
期初基金份额总额	1,729,244,455.42
加：本期申购基金份额总额	694,240,925.31
减：本期赎回基金份额总额	1,693,973,703.81
期末基金份额总额	729,511,676.92

十、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议：

本基金管理人于 2006 年 1 月 14 日发布《华安基金管理有限公司关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》：2006 年 1 月 9 日，经中国证券监督管理委员会《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监基金字[2006]8 号文）核准，同意本次基金份额持有人大会表决通过的关于将基金跟踪标的变更为 MSCI 中国 A 股指数的事项并将基金份额持有人大会决定事项予以公告。

(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：

1. 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 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。

2. 本基金托管人在本报告期内没有发生重大人事变动。

(三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼：无。

(四)、基金投资策略的改变：

本基金指数成份股构成及其权重指标基础由上证 180 指数调整为 MSCI 中国 A 股指数。

(五)、 基金收益分配事项：

	权益登记日、除 息日	红利划出日、红 利再投资日	每10份基金份额收 益分配金额
本报告期第1次分红	2006 年 6 月 13 日	2006 年 6 月 14 日	0.50 元

(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：未改聘会计师事务所。

(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：

无。

2. 交易成交量及佣金情况：

(1). 股票交易情况：

券商名称	席位 数	成交量	占总成交 总量比例	佣金	占总佣金 总量比例
国泰君安证券股份有限公司	1	85,917,600.87	3.42%	70,452.53	3.48%
宏源证券股份有限公司	1	142,921,162.30	5.69%	117,194.46	5.78%
中信建投证券股份有限公司	1	245,971,065.36	9.79%	201,695.61	9.95%
申银万国证券股份有限公司	1	43,719,585.56	1.74%	35,849.97	1.77%
银河证券有限责任公司	1	260,991,661.84	10.39%	214,010.38	10.56%
招商证券股份有限公司	1	369,387,731.92	14.70%	289,048.59	14.27%
中信证券股份有限公司	1	137,192,836.92	5.46%	112,497.69	5.55%
广发证券股份有限公司	1	539,210,122.34	21.46%	421,935.79	20.82%
国金证券有限责任公司	1	687,111,963.13	27.35%	563,429.59	27.81%
合 计		2,512,423,730.24	100.00%	2,026,114.61	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
国泰君安证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
宏源证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
华夏证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
申银万国证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
银河证券有限责任公司	0.00	0.00	0.00	0.00
招商证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
中信证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00

广发证券股份有限公司	0.00	0.00	0.00	0.00
国金证券有限责任公司	0.00	0.00	0.00	0.00
合 计	0.00	0.00	0.00	0.00

(九)、其他重大事项

1. 基金合同修改：

《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会对《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金跟踪标的变更为 MSCI 中国 A 股指数的议案》表决通过后生效。完整的《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》的修改稿《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》公布于本基金管理管理的网站(www.huaan.com.cn)。

2、变更基金份额发售机构：

序号	变更基金份额发售机构	披露日期
1	中国工商银行关于增加基金定投业务基金产品的公告	2006-04-14
2	华安基金管理有限公司关于新增国海证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	2006-03-07
3	华安基金管理有限公司关于在交通银行开通基金转换业务的公告	2006-01-14
4	华安基金管理有限公司关于变更代销机构的公告	2006-01-12

3、其他重要事项

序号	其他重要事项	披露日期
1	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
2	华安基金管理有限公司关于开通“华安-浦发银基通”基金电子直销业务的公告	2006-06-20
3	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
4	华安基金管理有限公司关于本公司旗下开放式基金春节长假期间暂停交易的提示性公告	2006-01-23

上述作为临时公告披露的重大事项均刊登于《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上。

十一、备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准本基金设立的文件；
- 5、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；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 9、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