

# 华安宝利配置证券投资基金

## 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：交通银行股份有限公司  
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  |
| 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、   | 其他有关资料 .....          | 4  |
| 三、   | 主要财务指标和基金净值表现 .....   | 5  |
| 1、   | 主要财务指标 .....          | 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 .....       | 7  |
| 3、   | 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 .....          | 10 |
| 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 ..... | 18 |
| (五)、 | 债券投资组合 .....          | 19 |
| (六)、 | 前五名债券明细 .....         | 20 |
| (七)、 | 权证投资组合 .....          | 20 |
| (八)、 | 资产支持证券投资组合 .....      | 20 |
| (九)、 | 投资组合报告附注 .....        | 20 |
| 八、   | 基金份额持有人户数和持有人结构 ..... | 21 |
| 九、   | 开放式基金份额变动 .....       | 22 |
| 十、   | 重大事件 .....            | 22 |
| 十一、  | 备查文件目录 .....          | 24 |

## 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。

基金托管人交通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

### 1、基金概况

|           |                  |
|-----------|------------------|
| 基金名称:     | 华安宝利配置证券投资基金     |
| 基金简称:     | 华安宝利             |
| 交易代码:     | 040004           |
| 深交所行情代码:  | 160404           |
| 基金运作方式:   | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日:  | 2004 年 8 月 24 日  |
| 期末基金份额总额: | 811,987,607.42 份 |
| 基金存续期:    | 不定期              |

### 2、基金的投资

**投资目标:** 本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。

**投资策略:** 基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。

**业绩比较基准:**  $35\% \times \text{天相转债指数收益率} + 30\% \times \text{天相 280 指数收益率} + 30\% \times \text{天相国债全价指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$

**风险收益特征：**

本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险，政策风险，经济周期风险，信用风险，再投资风险，上市公司经营风险，新产品创新带来的风险，购买力风险，流动性风险，现金管理风险，技术风险，管理风险，巨额赎回风险等。

**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<br>新上海国际大厦 38 楼<br>(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@huaan.com.cn                          |
| 客户服务热线：  | 021-68604666，40088-50099                       |

**4、基金托管人**

|          |                                    |
|----------|------------------------------------|
| 基金托管人：   | 交通银行股份有限公司（简称“交通银行”）               |
| 注册及办公地址： | 上海市浦东新区银城中路 188 号<br>(邮政编码：200120) |
| 法定代表人：   | 蒋超良                                |
| 信息披露负责人： | 张咏东                                |
| 联系电话：    | 021—68888917                       |
| 传真：      | 021—58408836                       |
| 电子邮箱：    | zhangyd@bankcomm.com               |

**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： | <a href="http://www.huaan.com.cn">http://www.huaan.com.cn</a> |
| 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、其他有关资料**

|         |                         |
|---------|-------------------------|
| 会计师事务所： | 普华永道中天会计师事务所有限公司        |
| 办公地址：   | 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼 |
| 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

#### 1、主要财务指标

| 财务指标         | 2006 年 1-6 月     |
|--------------|------------------|
| 基金本期净收益：     | 266,663,236.32   |
| 基金加权份额本期净收益： | 0.3222           |
| 期末可供分配基金收益   | 181,028,806.78   |
| 期末可供分配基金份额收益 | 0.2229           |
| 期末基金资产净值：    | 1,320,639,237.61 |
| 期末基金份额净值：    | 1.626            |
| 基金加权平均净值收益率  | 24.24%           |
| 本期基金份额净值增长率  | 61.02%           |
| 基金份额累计净值增长率  | 81.92%           |

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

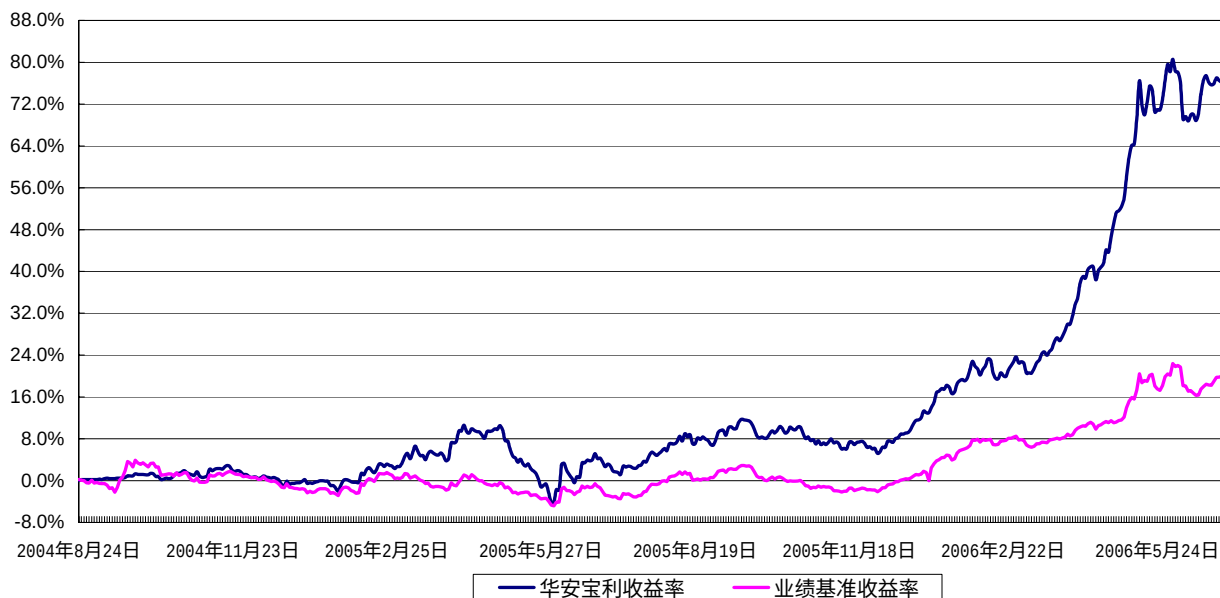
##### A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

| 阶段             | 净值<br>增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④   |
|----------------|----------------|---------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月          | 2.10%          | 1.35%         | 0.79%              | 0.85%                 | 1.31%  | 0.50% |
| 过去三个月          | 38.29%         | 1.43%         | 11.75%             | 0.81%                 | 26.54% | 0.62% |
| 过去六个月          | 61.02%         | 1.16%         | 20.83%             | 0.65%                 | 40.19% | 0.51% |
| 过去一年           | 75.78%         | 0.93%         | 25.79%             | 0.54%                 | 49.99% | 0.39% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 81.92%         | 0.86%         | 21.15%             | 0.55%                 | 60.77% | 0.31% |

##### 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与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华安宝利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2004/8/24--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

袁蓓女士：经济学学士，6年证券从业经历。曾在中国平安保险（集团）股份有限公司投资管理中心工作。2003年1月加入华安基金管理有限公司，在基金投资部从事证券投资和研究工作。现任华安宝利配置基金的基金经理。

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、华安宝利配置基金的基金经理、安信证券投资基金的基金经理。

## **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《华安宝利配置证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置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。

## **3. 基金经理工作报告**

### **(1) 本基金业绩表现**

截止 2006 年 6 月 30 日，本基金单位净值为 1.626 元，累计单位净值 1.766 元，2006 年上半年单位净值上升 61.02%，同期衡量业绩的比较基准上升 20.83%，超越比较基准 40.19%。本基金于 2006 年 3 月和 6 月分别再度对持有人按每十份派发了 0.40 元和 0.50 元现金红利。

### **(2) 2006 年上半年宏观经济和证券市场回顾**

2006 年宏观经济仍维持较高的增长水平，物价指数缓慢回升，信贷和投资增速过快以及单位 GDP 能耗的增长，促使中央政府从各个层面调控经济发展结构。在市场改革和国内外经济向好等主要因素的影响下，股票市场和转债市场均出现了持续上涨的行情，估值水平从低估区域逐渐走入了合理区域；在央行收缩流动性等宏观调控和物价指数回升等基本面因素的影响下，债券市场出现了一定幅度的振荡并开始释放利率风险。

### **(3) 基金运作情况回顾**

宝利配置基金在 2006 年上半年投资运作中仍以立足长远为出发，基于对国内外经济发展的判断和市场改革给股票市场带来的中长期机遇，从相对估值比较的角度，继续维持偏股型的配置策略，进一步小幅提高了股票组合的仓位，减少了债券组合的配置；对于转债的投资，基于短期内市场容量进一步缩小、流动性不足等缺陷，在低于基准配置比重的基础上进一步小幅降低了仓位，品种选择上强调公司基本面并适度考虑流动性风险；在普通债券投资方面，基于对央行收缩流动性的预期和物价指数见底的判断，维持了组合较低的久期和比重，提高组合的安全性；在股票组合结构上，以可持续的成长性和相对估值为主线进行了积极的结构调整。

### **(4) 市场展望和投资策略**

宝利配置基金仍看好制度改革给股票市场带来的中长期机遇和经济长期高速发展对市场的趋势，同时也将积极应对价值回归合理区间后面临短期振荡的可能性，立足于各目标市场间和市场内的相对估值比较，结合国际市场估值水平和国内外宏观经济，动态的调整资产配置比例和优化组合结构。

## 五、 托管人报告

2006 年上半年，托管人在华安宝利基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2006 年上半年，华安基金管理公司在华安宝利基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

2006 年上半年，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利基金的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真实、准确、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             |
|------------|------|-------------------------|-------------------------|
| <b>资产：</b> |      |                         |                         |
| 银行存款       |      | 90,436,117.10           | 14,011,925.49           |
| 清算备付金      |      | 15,522,109.49           | 2,482,464.13            |
| 交易保证金      |      | 644,671.96              | 631,465.52              |
| 应收证券清算款    |      | 2,095,739.76            | 0.00                    |
| 应收股利       |      | 804,600.00              | 0.00                    |
| 应收利息       | 4(1) | 3,065,598.44            | 2,197,336.10            |
| 应收申购款      |      | 8,945,767.58            | 21,389,021.09           |
| 其他应收款      |      | 10,699,620.00           | 0.00                    |
| 股票投资市值     |      | 912,319,743.83          | 644,179,790.22          |
| 其中：股票投资成本  |      | 600,254,945.05          | 587,427,211.75          |
| 债券投资市值     |      | 283,227,258.38          | 401,104,589.84          |
| 其中：债券投资成本  |      | 265,979,900.26          | 399,494,133.93          |
| 权证投资       |      | 5,934,970.00            | 0.00                    |
| 其中：权证投资成本  |      | 5,451,422.46            | 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       |      | <b>1,333,696,196.54</b> | <b>1,085,996,592.39</b> |
| <b>负债：</b> |      |                         |                         |
| 应付证券清算款    |      | 325,915.35              | 8,717,535.16            |
| 应付赎回款      |      | 9,558,136.36            | 10,932,235.93           |



|         |      |                      |                      |
|---------|------|----------------------|----------------------|
| 应付赎回费   |      | 2,223.27             | 3,497.86             |
| 应付管理人报酬 |      | 1,314,032.68         | 1,008,929.12         |
| 应付托管费   |      | 273,756.79           | 210,193.58           |
| 应付佣金    | 4(3) | 866,501.97           | 488,739.91           |
| 应付利息    |      | 0.00                 | 0.00                 |
| 其他应付款   | 4(4) | 557,708.00           | 500,000.00           |
| 卖出回购证券款 |      | 0.00                 | 0.00                 |
| 预提费用    | 4(5) | 158,684.51           | 59,000.00            |
| 负债合计    |      | <b>13,056,958.93</b> | <b>21,920,131.56</b> |

**所有者权益：**

|            |      |                         |                         |
|------------|------|-------------------------|-------------------------|
| 实收基金       | 4(6) | 811,987,607.42          | 986,910,091.28          |
| 未实现利得      | 4(7) | 327,622,823.41          | 86,387,252.19           |
| 未分配收益      |      | 181,028,806.78          | -9,220,882.64           |
| 持有人权益合计    |      | <b>1,320,639,237.61</b> | <b>1,064,076,460.83</b> |
| 负债和所有者权益合计 |      | <b>1,333,696,196.54</b> | <b>1,085,996,592.39</b> |

**(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     |
|------------|-------|-----------------------|---------------------|
| <b>收入：</b> |       |                       |                     |
| 股票差价收入     | 4(8)  | 231,062,918.54        | -6,607,317.51       |
| 债券差价收入     | 4(9)  | 4,535,584.77          | 3,574,869.66        |
| 权证差价收入     |       | 25,971,586.82         | 0.00                |
| 债券利息收入     |       | 2,935,064.02          | 3,051,553.28        |
| 存款利息收入     |       | 274,936.56            | 277,765.18          |
| 股利收入       |       | 8,562,248.96          | 5,095,856.09        |
| 买入返售证券收入   |       | 23,671.23             | 83,699.74           |
| 其他收入       | 4(10) | 1,652,264.18          | 452,577.94          |
| 收入合计       |       | <b>275,018,275.08</b> | <b>5,929,004.38</b> |
| <b>费用：</b> |       |                       |                     |
| 基金管理人报酬    | 3(3)  | 6,515,310.64          | 3,189,764.97        |
| 基金托管费      | 3(3)  | 1,357,356.28          | 664,534.37          |
| 卖出回购证券支出   |       | 276,688.89            | 113,715.26          |
| 其他费用       | 4(11) | 205,682.95            | 175,326.04          |
| 其中：信息披露费   |       | 128,931.73            | 128,931.73          |
| 审计费用       |       | 29,752.78             | 24,795.19           |
| 费用合计       |       | <b>8,355,038.76</b>   | <b>4,143,340.64</b> |

|              |                       |                      |
|--------------|-----------------------|----------------------|
| 基金净收益        | <b>266,663,236.32</b> | <b>1,785,663.74</b>  |
| 加：未实现估值增值变动数 | 271,432,670.06        | -3,356,946.71        |
| 基金经营业绩       | <b>538,095,906.38</b> | <b>-1,571,282.97</b> |

### (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          |    | 266,663,236.32        | 1,785,663.74         |
| 加：期初未分配收益        |    | -9,220,882.64         | 5,402,032.00         |
| 加：本期申购基金单位的损益平准金 |    | 66,507,182.87         | 2,577,083.63         |
| 减：本期赎回基金单位的损益平准金 |    | 68,312,908.95         | 2,184,389.88         |
| 可供分配基金净收益        |    | 255,636,627.60        | 7,580,389.49         |
| 减：本期已分配基金净收益     |    | 74,607,820.82         | 10,992,616.81        |
| 期末基金未分配净收益       |    | <b>181,028,806.78</b> | <b>-3,412,227.32</b> |

### (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         |       | 1,064,076,460.83        | 597,137,202.33        |
| 二、本期经营活动：        |       |                         |                       |
| 基金净收益            |       | 266,663,236.32          | 1,785,663.74          |
| 未实现估值增值变动数       |       | 271,432,670.06          | -3,356,946.71         |
| 经营活动产生的基金净值变动数   |       | 538,095,906.38          | -1,571,282.97         |
| 三、本期基金单位交易：      |       |                         |                       |
| 基金申购款            |       | 1,227,085,746.82        | 407,190,024.61        |
| 基金赎回款            |       | -1,434,011,055.60       | -355,910,087.94       |
| 基金单位交易产生的基金净值变动数 |       | -206,925,308.78         | 51,279,936.67         |
| 四、本期向持有人分配收益     | 4(12) | 74,607,820.82           | 10,992,616.81         |
| 五、期末基金净值         |       | <b>1,320,639,237.61</b> | <b>635,853,239.22</b> |

### (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 2004 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          |
| 交通银行股份有限公司     | 基金托管人、基金代销机构               | 提取托管费<br>银行间交易 | 基金合同<br>成交确认书 |
| 上海国际信托投资有限公司   | 基金管理人股东                    |                |               |
| 上海电气(集团)总公司    | 基金管理人股东                    |                |               |
| 上海广电(集团)有限公司   | 基金管理人股东                    |                |               |
| 上海沸点投资发展有限公司   | 基金管理人股东                    |                |               |
| 上海工业投资(集团)有限公司 | 基金管理人股东                    |                |               |

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本基金在本报告期(2006 年 1-6 月)和 上年度的上半年(2005 年 1-6 月)与交通银行股份有限公司通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

|          | 2006 年 1-6 月   | 2005 年 1-6 月 |
|----------|----------------|--------------|
| 卖出债券结算金额 | 193,166,654.79 | 0.00         |

(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 1.2%的年费率计提,计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

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 6,515,310.64 元。(上年度的上半年：3,189,764.97 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 1,357,356.28 元。(上年度的上半年：664,534.37 元)

(4). 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交通银行保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 90,436,117.10 元(2005 年 6 月 30 日：26,246,095.33 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 174,451.40 元(2005 年上半年度：214,997.22 元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于 2006 年 6 月 30 日的相关余额 15,522,109.49 元计入“结算备付金”科目(2005 年 6 月 30 日：8,363,066.67 元)。

(5). 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 | 50,000,000 | 5.07% | 0.00 | 0.00 | 50,000,000 | 6.16% | 0.00 |

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 | 50,000,000 | 8.39% | 0.00 | 0.00 | 50,000,000 | 7.99% | 0.00* |

\*注：为基金发行认购期内买入。

(6). 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：

本报告期末与 2005 年上半年报告期末均无。

#### 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   | 28,043.44       |
| 清算备付金利息  | 10,658.01       |
| 债券利息     | 3,026,851.36    |
| 买入返售证券利息 | 0.00            |
| 交易保证金利息  | 45.63           |
| 合计       | 3,065,598.44    |

(2). 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 | 312,064,798.78  |
| 债券估值增值余额 | 17,247,358.12   |
| 权证估值增值余额 | 483,547.54      |
| 合计       | 329,795,704.44  |

(3). 应付佣金明细：

| 明细项目         | 2006 年 6 月 30 日 |
|--------------|-----------------|
| 渤海证券有限责任公司   | 44,917.80       |
| 海通证券股份有限公司   | 157,938.57      |
| 中信建投证券有限责任公司 | 122,784.90      |
| 申银万国证券股份有限公司 | 260,914.37      |



|            |            |
|------------|------------|
| 兴业证券股份有限公司 | 279,946.33 |
| 合计         | 866,501.97 |

|               |                 |
|---------------|-----------------|
| (4). 其他应付款明细： | 2006 年 6 月 30 日 |
| 应付券商席位保证金     | 500,000.00      |
| 其他应付款其他       | 57,708.00       |
| 合计            | 557,708.00      |

|              |                 |
|--------------|-----------------|
| (5). 预提费用明细： |                 |
| 明细项目         | 2006 年 6 月 30 日 |
| 信息披露费        | 128,931.73      |
| 审计费用         | 29,752.78       |
| 合计           | 158,684.51      |

|                |                  |
|----------------|------------------|
| (6). 实收基金变动明细： |                  |
| 明细项目           | 2006 年 1-6 月     |
| 期初数            | 986,910,091.28   |
| 加：本期因申购增加数     | 931,353,045.12   |
| 减：本期因赎回减少数     | 1,106,275,528.98 |
| 期末数            | 811,987,607.42   |

|                |                |
|----------------|----------------|
| (7). 未实现利得明细：  |                |
| 明细项目           | 2006 年 1-6 月   |
| 期初未实现利得：       | 86,387,252.19  |
| 其中：投资估值增值数：    | 58,363,034.38  |
| 未实现利得平准金：      | 28,024,217.81  |
| 本期投资估值增值发生数：   | 271,432,670.06 |
| 本期申购的未实现利得平准金： | 229,225,518.83 |
| 本期赎回的未实现利得平准金： | 259,422,617.67 |
| 期末未实现利得：       | 327,622,823.41 |
| 其中：投资估值增值数：    | 329,795,704.44 |
| 未实现利得平准金：      | -2,172,881.03  |

|            |                  |
|------------|------------------|
| (8). 卖出股票： |                  |
| 明细项目       | 2006 年 1-6 月     |
| 卖出股票成交总额   | 1,153,687,800.23 |
| 减：佣金       | 967,176.87       |
| 成本总额       | 921,657,704.82   |
| 股票差价收入     | 231,062,918.54   |



(9). 卖出债券：

| 明细项目     | 2006 年 1-6 月     |
|----------|------------------|
| 卖出债券成交总额 | 3,974,128,469.47 |
| 减：成本总额   | 3,948,256,827.14 |
| 应收利息总额   | 21,336,057.56    |
| 债券差价收入   | 4,535,584.77     |

(10). 其他收入：

| 明细项目       | 2006 年 1-6 月 |
|------------|--------------|
| 开放式基金赎回费收入 | 1,652,264.18 |
| 合计         | 1,652,264.18 |

(11). 其他费用：

| 明细项目  | 2006 年 1-6 月 |
|-------|--------------|
| 信息披露费 | 128,931.73   |
| 审计费   | 29,752.78    |
| 银行手续费 | 16,928.44    |
| 帐户维护费 | 28,070.00    |
| 其他    | 2000.00      |
| 合计    | 205,682.95   |

(12). 基金收益分配：

|                | 分红公告日    | 收益分配金额        |
|----------------|----------|---------------|
| 本期第1次分红        | 2006-3-8 | 32,354,278.18 |
| 本期第2次分红        | 2006-6-2 | 42,253,542.64 |
| 本期累计收益<br>分配金额 |          | 74,607,820.82 |

(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：

| 明细项目                   | 2006 年 1-6 月 |
|------------------------|--------------|
| 股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额 | 3,580,223.05 |

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：

本基金流通受限、不能自由转让的资产有获配的新股和配股。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        | 估值方法 | 转让受限原因 | 受限期限      | 总成本           | 总市值           |
|------|-----------|------|--------|-----------|---------------|---------------|
| 大同煤业 | 453,466   | 按市价  | 未流通    | 2006-9-23 | 3,065,430.16  | 4,634,422.52  |
| 中国银行 | 1,163,000 | 按成本  | 未流通    | 2006-7-5  | 3,582,040.00  | 3,582,040.00  |
| 中国银行 | 1,414,711 | 按成本  | 未流通    | 2006-10-5 | 4,357,309.88  | 4,357,309.88  |
| 中国银行 | 1,414,711 | 按成本  | 未流通    | 2007-1-5  | 4,357,309.88  | 4,357,309.88  |
| 中工国际 | 116,373   | 按市价  | 未流通    | 2006-9-19 | 861,160.20    | 2,038,854.96  |
|      |           |      |        |           | 16,223,250.12 | 18,969,937.24 |

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      | 期末估值单价 | 复牌日期      | 复牌开盘单价 | 数量        | 期末成本总额        | 期末估值总额        |
|--------|------|-----------|--------|-----------|--------|-----------|---------------|---------------|
| 600720 | 祁连山  | 2006-6-16 | 3.30   | 2006-7-20 | 2.66   | 1,299,775 | 4,389,093.69  | 4,289,257.50  |
| 600811 | 东方集团 | 2006-6-26 | 7.10   | 2006-7-6  | 6.73   | 3,000,000 | 22,223,844.52 | 21,300,000.00 |
|        |      |           |        |           |        |           | 26,612,938.21 | 25,589,257.50 |

(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(元)            | 占总资产比例  |
|----|------------|------------------|---------|
| 1  | 股票         | 912,319,743.83   | 68.41%  |
| 2  | 债券         | 283,227,258.38   | 21.24%  |
| 3  | 权证         | 5,934,970.00     | 0.45%   |
| 4  | 银行存款和清算备付金 | 105,958,226.59   | 7.94%   |
| 5  | 其它资产       | 26,255,997.74    | 1.97%   |
|    | 合计         | 1,333,696,196.54 | 100.00% |

### (二)、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         | 71,484,422.52  | 5.41%   |
| C  | 制造业         | 493,001,488.73 | 37.33%  |
| C0 | 食品、饮料       | 52,828,087.75  | 4.00%   |
| C1 | 纺织、服装、皮毛    | 5,605,713.00   | 0.42%   |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 125,260,000.00 | 9.48%   |
| C5 | 电子          | 28,821,943.75  | 2.18%   |
| C6 | 金属、非金属      | 93,995,605.78  | 7.12%   |





|    |                |                |        |
|----|----------------|----------------|--------|
| C7 | 机械、设备、仪表       | 107,477,716.11 | 8.14%  |
| C8 | 医药、生物制品        | 79,012,422.34  | 5.98%  |
| D  | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 9,583,587.00   | 0.73%  |
| F  | 交通运输、仓储业       | 77,280,000.00  | 5.85%  |
| G  | 信息技术业          | 20,380,047.40  | 1.54%  |
| H  | 批发和零售贸易        | 51,449,254.46  | 3.90%  |
| I  | 金融、保险业         | 13,066,888.76  | 0.99%  |
| J  | 房地产业           | 56,990,000.00  | 4.32%  |
| K  | 社会服务业          | 25,058,854.96  | 1.90%  |
| L  | 传播与文化产业        | 43,925,200.00  | 3.33%  |
| M  | 综合类            | 50,100,000.00  | 3.79%  |
| 合计 |                | 912,319,743.83 | 69.08% |

### (三)、 股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 数量        | 市值            | 占净值比例 |
|----|--------|-------|-----------|---------------|-------|
| 1  | 600309 | G 万 华 | 5,000,000 | 72,500,000.00 | 5.49% |
| 2  | 600761 | G 合 力 | 4,250,000 | 62,560,000.00 | 4.74% |
| 3  | 600009 | G 沪机场 | 4,000,000 | 57,640,000.00 | 4.36% |
| 4  | 600456 | G 宝 钛 | 1,200,000 | 57,228,000.00 | 4.33% |
| 5  | 000402 | G 金融街 | 6,950,000 | 56,990,000.00 | 4.32% |
| 6  | 600276 | G 恒 瑞 | 1,875,685 | 44,359,950.25 | 3.36% |
| 7  | 600037 | G 歌 华 | 2,980,000 | 43,925,200.00 | 3.33% |
| 8  | 000792 | G 钾 肥 | 2,000,000 | 40,600,000.00 | 3.07% |
| 9  | 600583 | G 海 工 | 1,500,000 | 34,350,000.00 | 2.60% |
| 10 | 600268 | G 南 自 | 2,201,150 | 33,567,537.50 | 2.54% |
| 11 | 600123 | G 兰 花 | 2,500,000 | 32,500,000.00 | 2.46% |
| 12 | 000538 | G 云白药 | 1,000,000 | 28,950,000.00 | 2.19% |
| 13 | 600858 | G 银 座 | 1,800,000 | 28,800,000.00 | 2.18% |
| 14 | 600519 | G 茅 台 | 600,000   | 28,464,000.00 | 2.16% |
| 15 | 600694 | 大商股份  | 650,000   | 26,877,500.00 | 2.04% |
| 16 | 000898 | G 鞍 钢 | 4,000,000 | 24,480,000.00 | 1.85% |
| 17 | 000069 | G 华侨城 | 2,000,000 | 23,020,000.00 | 1.74% |
| 18 | 600811 | 东方集团  | 3,000,000 | 21,300,000.00 | 1.61% |
| 19 | 000063 | G 中 兴 | 712,340   | 20,380,047.40 | 1.54% |
| 20 | 000061 | G 农产品 | 2,098,935 | 20,023,839.90 | 1.52% |
| 21 | 600269 | G 赣 粤 | 2,000,000 | 19,640,000.00 | 1.49% |
| 22 | 002025 | 航天电器  | 509,375   | 13,004,343.75 | 0.98% |
| 23 | 000729 | G 燕 啤 | 1,481,905 | 12,670,287.75 | 0.96% |
| 24 | 601988 | 中国银行  | 3,992,422 | 12,296,659.76 | 0.93% |
| 25 | 000826 | G 合 加 | 2,000,000 | 12,160,000.00 | 0.92% |
| 26 | 600261 | G 浙阳光 | 720,000   | 9,777,600.00  | 0.74% |
| 27 | 600795 | 国电电力  | 1,181,700 | 9,583,587.00  | 0.73% |



|    |        |       |           |              |       |
|----|--------|-------|-----------|--------------|-------|
| 28 | 600806 | 交大科技  | 1,250,505 | 9,003,636.00 | 0.68% |
| 29 | 600809 | G 汾 酒 | 500,000   | 8,685,000.00 | 0.66% |
| 30 | 002008 | 大族激光  | 400,000   | 6,040,000.00 | 0.46% |
| 31 | 000661 | 长春高新  | 1,005,727 | 5,702,472.09 | 0.43% |
| 32 | 600677 | G 航 通 | 622,857   | 5,605,713.00 | 0.42% |
| 33 | 000878 | G 云 铜 | 500,000   | 4,940,000.00 | 0.37% |
| 34 | 601001 | 大同煤业  | 453,466   | 4,634,422.52 | 0.35% |
| 35 | 600153 | G 建 发 | 902,364   | 4,547,914.56 | 0.34% |
| 36 | 600720 | 祁 连 山 | 1,299,775 | 4,289,257.50 | 0.32% |
| 37 | 600801 | G 华 新 | 500,548   | 3,058,348.28 | 0.23% |
| 38 | 000869 | G 张 裕 | 80,000    | 3,008,800.00 | 0.23% |
| 39 | 000768 | G 西 飞 | 276,389   | 2,346,542.61 | 0.18% |
| 40 | 002051 | 中工国际  | 116,373   | 2,038,854.96 | 0.15% |
| 41 | 600036 | G 招 行 | 99,900    | 770,229.00   | 0.06% |

#### (四)、报告期内股票投资组合的重大变动

##### 1、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<br>资产净值的<br>比例 |
|----|--------|-------|---------------|----------------------|
| 1  | 600036 | G 招 行 | 72,182,195.33 | 6.78%                |
| 2  | 600009 | G 沪机场 | 53,144,519.53 | 4.99%                |
| 3  | 600037 | G 歌 华 | 49,737,055.54 | 4.67%                |
| 4  | 000069 | G 华侨城 | 43,629,752.46 | 4.10%                |
| 5  | 600268 | G 南 自 | 31,053,432.78 | 2.92%                |
| 6  | 600028 | 中国石化  | 30,223,923.24 | 2.84%                |
| 7  | 600761 | G 合 力 | 30,114,807.60 | 2.83%                |
| 8  | 000898 | G 鞍 钢 | 29,120,090.30 | 2.74%                |
| 9  | 600811 | 东方集团  | 28,775,035.22 | 2.70%                |
| 10 | 600276 | G 恒 瑞 | 23,578,457.57 | 2.22%                |
| 11 | 000063 | G 中 兴 | 23,301,803.53 | 2.19%                |
| 12 | 600123 | G 兰 花 | 22,778,016.66 | 2.14%                |
| 13 | 000089 | G 深机场 | 21,092,728.76 | 1.98%                |
| 14 | 600694 | 大商股份  | 19,958,991.53 | 1.88%                |
| 15 | 600348 | G 国 阳 | 17,504,033.63 | 1.64%                |
| 16 | 600456 | G 宝 钛 | 17,229,668.31 | 1.62%                |
| 17 | 600309 | G 万 华 | 16,683,459.27 | 1.57%                |
| 18 | 000061 | G 农产品 | 16,183,518.37 | 1.52%                |
| 19 | 600010 | G 包 钢 | 14,441,089.92 | 1.36%                |

|    |        |       |               |       |
|----|--------|-------|---------------|-------|
| 20 | 600000 | G 浦 发 | 13,422,879.91 | 1.26% |
|----|--------|-------|---------------|-------|

| 序号 | 股票代码   | 股票名称  | 本期累计卖出金额      | 占期初基金<br>资产净值的<br>比例 |
|----|--------|-------|---------------|----------------------|
| 1  | 600036 | G 招 行 | 85,621,842.92 | 8.05%                |
| 2  | 000069 | G 华侨城 | 59,886,335.65 | 5.63%                |
| 3  | 600028 | 中国石化  | 58,853,268.64 | 5.53%                |
| 4  | 600456 | G 宝 钛 | 43,085,946.39 | 4.05%                |
| 5  | 600519 | G 茅 台 | 42,444,459.70 | 3.99%                |
| 6  | 600309 | G 万 华 | 27,348,860.82 | 2.57%                |
| 7  | 600196 | G 复 星 | 26,442,099.35 | 2.48%                |
| 8  | 600312 | G 平 高 | 25,639,274.41 | 2.41%                |
| 9  | 600010 | G 包 钢 | 25,058,322.76 | 2.35%                |
| 10 | 000089 | G 深机场 | 24,576,003.79 | 2.31%                |
| 11 | 600000 | G 浦 发 | 24,146,375.81 | 2.27%                |
| 12 | 002041 | 登海种业  | 22,638,621.80 | 2.13%                |
| 13 | 600438 | G 通 威 | 22,287,298.86 | 2.09%                |
| 14 | 002025 | 航天电器  | 21,880,144.33 | 2.06%                |
| 15 | 600261 | G 浙阳光 | 21,696,127.47 | 2.04%                |
| 16 | 000538 | G 云白药 | 21,164,211.22 | 1.99%                |
| 17 | 600827 | 友谊股份  | 20,736,728.15 | 1.95%                |
| 18 | 600761 | G 合 力 | 20,562,628.32 | 1.93%                |
| 19 | 000792 | G 钾 肥 | 20,012,151.31 | 1.88%                |
| 20 | 600153 | G 建 发 | 19,508,225.63 | 1.83%                |

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： | 938,065,661.17   |
| 卖出股票的收入总额： | 1,153,687,800.23 |

注：买入股票的成本总额未扣减股权分置获得的现金对价 3,580,223.05 元。

**(五)、 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  | 0.00           | 0.00%   |
| 2  | 金融债券  | 150,997,206.78 | 11.43%  |
| 3  | 企业债券  | 7,769,112.00   | 0.59%   |
| 4  | 央行票据  | 0.00           | 0.00%   |
| 5  | 可转换债券 | 124,460,939.60 | 9.42%   |
|    | 合计    | 283,227,258.38 | 21.44%  |

## (六)、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  | 040217 | 04 国开 17 | 1,000,000 | 100,950,206.78 | 7.64%   |
| 2  | 040212 | 04 国开 12 | 400,000   | 40,036,000.00  | 3.03%   |
| 3  | 125936 | 华西转债     | 179,211   | 25,926,455.37  | 1.96%   |
| 4  | 125822 | 海化转债     | 189,781   | 21,659,705.53  | 1.64%   |
| 5  | 110874 | 创业转债     | 180,000   | 20,374,200.00  | 1.54%   |

## (七)、权证投资组合

### 1、基金投资前五名权证明细

| 序号 | 权证代码   | 权证名称    | 数量      | 市值(元)        | 占资产净值比例 |
|----|--------|---------|---------|--------------|---------|
| 1  | 580005 | 万华 HXB1 | 450,000 | 5,439,150.00 | 0.41%   |
| 2  | 580006 | 雅戈 QCB1 | 130,000 | 495,820.00   | 0.04%   |

## (八)、资产支持证券投资基金组合

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。在银行间债券市场挂牌交易的债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑市场成交价、报价、收益率曲线、成本价等因素确定的反映公允价值的价格估值。

### 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(元)      |
|----|----------|------------|
| 1  | 深交所交易保证金 | 531,973.54 |
| 2  | 权证交易保证金  | 112,698.42 |



|   |         |               |
|---|---------|---------------|
| 3 | 应收利息    | 3,065,598.44  |
| 4 | 买入返售证券  | 0.00          |
| 5 | 应收证券清算款 | 2,095,739.76  |
| 6 | 应收申购款   | 8,945,767.58  |
| 7 | 应收股利    | 804,600.00    |
| 8 | 其他应收款   | 10,699,620.00 |
|   | 合计      | 26,255,997.74 |

#### 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 |
|----|--------|------|---------|---------------|---------|
| 1  | 125936 | 华西转债 | 179,211 | 25,926,455.37 | 1.96%   |
| 2  | 125822 | 海化转债 | 189,781 | 21,659,705.53 | 1.64%   |
| 3  | 110874 | 创业转债 | 180,000 | 20,374,200.00 | 1.54%   |
| 4  | 100726 | 华电转债 | 162,920 | 20,171,125.20 | 1.53%   |
| 5  | 125959 | 首钢转债 | 115,010 | 12,643,049.30 | 0.96%   |
| 6  | 100236 | 桂冠转债 | 73,250  | 7,856,062.50  | 0.59%   |
| 7  | 125488 | 晨鸣转债 | 56,070  | 6,052,756.50  | 0.46%   |
| 8  | 110317 | 营港转债 | 42,130  | 5,046,331.40  | 0.38%   |
| 9  | 100795 | 国电转债 | 38,220  | 4,731,253.80  | 0.36%   |

#### 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 | 3,603,923 | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 2  | 580002 | 包钢 JTB1 | 1,363,863 | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 3  | 580995 | 包钢 JTP1 | 1,363,863 | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 4  | 580003 | 邯钢 JTB1 | 571,010   | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 5  | 580005 | 万华 HXB1 | 660,000   | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 6  | 580993 | 万华 HXP1 | 990,000   | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 7  | 580006 | 雅戈 QCB1 | 130,000   | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 8  | 580992 | 雅戈 QCP1 | 910,000   | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 9  | 580990 | 茅台 JCP1 | 1,280,893 | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 10 | 038008 | 钾肥 JTP1 | 799,800   | 0.00         | 股权分置改革被动持有 |
| 11 | 580005 | 万华 HXB1 | 450,000   | 5,451,422.46 | 二级市场买入     |

## 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    | 3110 户         | -       |
| 平均每户持有基金份额   | 261,089.26     | -       |
| 机构投资者持有的基金份额 | 699,586,358.33 | 86.16%  |
| 个人投资者持有的基金份额 | 112,401,249.09 | 13.84%  |

## 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 | 1,130,480,770.08 |
| 期初基金份额总额       | 986,910,091.28   |
| 加：本期申购基金份额总额   | 931,353,045.12   |
| 减：本期赎回基金份额总额   | 1,106,275,528.98 |
| 期末基金份额总额       | 811,987,607.42   |

## 十、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。

1、本基金管理人在本报告期内重大人事变动如下：

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重大人事变动如下：

2006 年 1 月 25 日，交通银行股份有限公司在《证券时报》、《金融时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于阮红基金托管行业高管任职资格的公告》。

(三)、 本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)、 基金投资策略的改变：无。

(五)、 基金收益分配事项：

|           | 权益登记日、除<br>息日 | 红利划出日、红<br>利再投资日 | 每10份基金份额收<br>益分配金额 |
|-----------|---------------|------------------|--------------------|
| 本报告期第1次分红 | 2006-3-21     | 2006-3-22        | 0.40 元             |
| 本报告期第2次分红 | 2006-6-20     | 2006-6-21        | 0.50 元             |

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况：本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

(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         | 租用席位数量 | 成交量              | 占总成交量比例 | 佣金           | 占总佣金总量比例 |
|--------------|--------|------------------|---------|--------------|----------|
| 渤海证券有限责任公司   | 1      | 201,527,487.25   | 10.16%  | 165,251.78   | 10.33%   |
| 海通证券股份有限公司   | 1      | 354,450,505.65   | 17.87%  | 277,359.89   | 17.33%   |
| 中信建投证券有限责任公司 | 1      | 340,552,698.90   | 17.17%  | 266,484.76   | 16.65%   |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1      | 520,724,769.96   | 26.25%  | 426,992.15   | 26.68%   |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | 566,150,808.13   | 28.54%  | 464,140.62   | 29.00%   |
| 合 计          | 5      | 1,983,406,269.89 | 100.00% | 1,600,229.20 | 100.00%  |

(2). 债券、回购及权证交易情况：

| 券商名称         | 债券成交量          | 占总成交量总量比例 | 回购成交量 | 占总成交量总量比例 | 权证成交量         | 占总成交量总量比例 |
|--------------|----------------|-----------|-------|-----------|---------------|-----------|
| 渤海证券有限责任公司   | 14,640,636.50  | 11.59%    | 0.00  | 0.00%     | 1,978,553.76  | 6.30%     |
| 海通证券股份有限公司   | 14,657,347.00  | 11.60%    | 0.00  | 0.00%     | 2,566,427.77  | 8.17%     |
| 中信建投证券有限责任公司 | 25,077,837.81  | 19.85%    | 0.00  | 0.00%     | 0.00          | 0.00%     |
| 申银万国股份有限公司   | 26,484,533.60  | 20.96%    | 0.00  | 0.00%     | 8,831,678.96  | 28.10%    |
| 兴业证券股份有限公司   | 45,478,578.80  | 36.00%    | 0.00  | 0.00%     | 18,047,997.51 | 57.43%    |
| 合 计          | 126,338,933.71 | 100.00%   | 0.00  | 0.00%     | 31,424,658.00 | 100.00%   |

(九)、其他事项：

1. 变更基金份额发售机构

|   | 公告事项                                   | 披露日期         |
|---|----------------------------------------|--------------|
| 1 | 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] |
| 2 | 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] |
| 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] |

2.其他公告事项

| 公告事项 | 披露日期 |
|------|------|
|------|------|



|                                     |              |
|-------------------------------------|--------------|
| 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] |
| 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] |
| 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华安宝利配置证券投资基金第四次分红公告     | [2006-06-02] |
| 华安基金管理有限公司关于华安宝利配置证券投资基金第三次分红公告     | [2006-03-08] |

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。

3. 2006 年 7 月 18 日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于住所变更的公告》。交通银行股份有限公司住所由“上海市仙霞路 18 号”变更为“上海市浦东新区银城中路 188 号”。

## 十一、备查文件目录

- 1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宝利配置证券投资基金设立的文件；
- 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