

安久证券投资基金 2006 年年度报告

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：二〇〇七年三月三十一日

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）其他有关资料.....	5
三、	主要财务指标和基金净值表现.....	5
	（一）主要财务指标.....	5
	（二）净值表现.....	5
	（三）基金收益分配情况.....	7
四、	管理人报告.....	7
	（一）基金管理人以及基金经理简介.....	7
	（二）基金运作合规性声明.....	8
	（三）基金经理工作报告.....	8
	（四）内部监察报告.....	9
五、	托管人报告.....	9
六、	审计报告.....	10
七、	财务会计报告.....	10
	（一）资产负债表.....	10
	（二）经营业绩表.....	11
	（三）收益分配表.....	12
	（四）净值变动表.....	13
	（五）会计报表附注.....	13
八、	投资组合报告.....	22
	（一）基金资产组合.....	22
	（二）股票投资组合.....	22
	（三）基金投资股票明细.....	23
	（四）报告期内股票投资组合的重大变动.....	24
	（五）债券投资组合.....	26
	（六）基金投资前五名债券明细.....	26
	（七）权证投资组合.....	26
	（八）资产支持证券投资组合.....	26
	（九）投资组合报告附注.....	26
九、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	27
	（一）基金份额持有人户数和持有人结构.....	27
	（二）前十名持有人的名称.....	27
十、	重大事件.....	28
十一、	备查文件目录.....	32

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 2007 年 3 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、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。

本年度报告的财务报表部分已经审计。

二、基金产品概况

(一) 基金概况

基金名称:	安久证券投资基金
基金简称:	基金安久
交易代码:	184709
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1992 年 8 月 31 日(原四川国信投资基金成立日期) 2000 年 7 月 4 日华安基金管理有限公司开始管理基金安久
期末基金份额总额:	5 亿份
基金存续期:	15 年(自 1992 年 8 月 31 日至 2007 年 8 月 30 日)
基金上市地点:	深圳证券交易所
基金上市日期:	2001 年 8 月 31 日

(二) 基金的投资

投资目标:	本基金为积极成长型基金,本基金投资于积极应用新技术的上市公司。
投资策略:	本基金将通过努力提高自身综合决策能力来减少风险。同时也通过分散投资来减少风险。 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，至少 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单一主业或多主业有良好成长性的公司股票，该类公司的特征是：（1）预期利润总额增长速度超过行业平均水平或同期 GDP 增长速度；（2）新技术应用对公司的主营业务贡献明显。

业绩比较基准：无
风险收益特征：无

（三） 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 2 楼、37 楼、38 楼
（邮政编码：200120）
法定代表人：王成明
总经理：俞妙根
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：021-68604666，40088-50099

（四） 基金托管人

基金托管人：交通银行股份有限公司
注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号
（邮政编码：200120）
办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号
（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

（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
管理人互联网地址：<http://www.huanan.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

(六) 其他有关资料

会计师事务所：上海立信长江会计师事务所有限公司
办公地址：上海市南京东路 61 号四楼
登记注册机构：中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
办公地点：深圳市深南中路 1093 号中信大厦 18 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

财务指标	2006 年度	2005 年度	2004 年度
基金本期净收益	207,563,599.56	-46,249,351.90	25,176,809.13
加权平均基金份额本期净收益	0.4151	-0.0925	0.0504
期末可供分配基金收益	114,426,334.29	-93,137,265.27	-64,777,031.85
期末可供分配基金份额收益	0.2289	-0.1863	-0.1296
期末基金资产净值	1,007,939,273.11	433,321,374.26	435,222,968.15
期末基金份额净值	2.0159	0.8666	0.8704
基金加权平均净值收益率	31.85%	-10.99%	5.39%
本期基金份额净值增长率	132.62%	-0.44%	-6.19%
基金份额累计净值增长率	87.43%	-19.43%	-19.07%

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。

(二) 净值表现

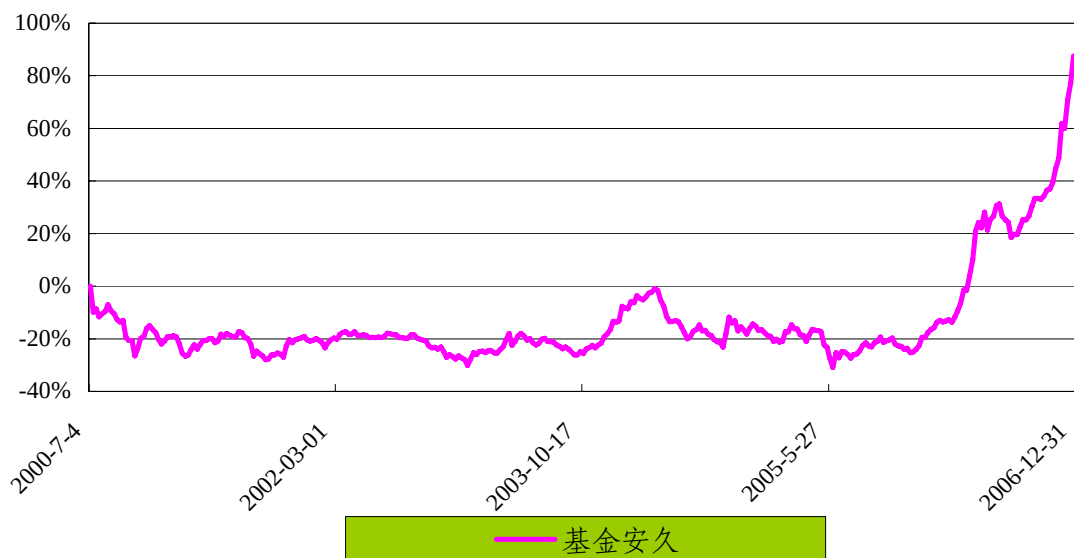
A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值 增长率 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
三个月	40.50%	3.00%	-	-	-	-
六个月	43.55%	2.87%	-	-	-	-
一年	132.62%	2.95%	-	-	-	-
三年	117.28%	2.79%	-	-	-	-
五年	134.08%	2.40%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	87.43%	2.47%	-	-	-	-

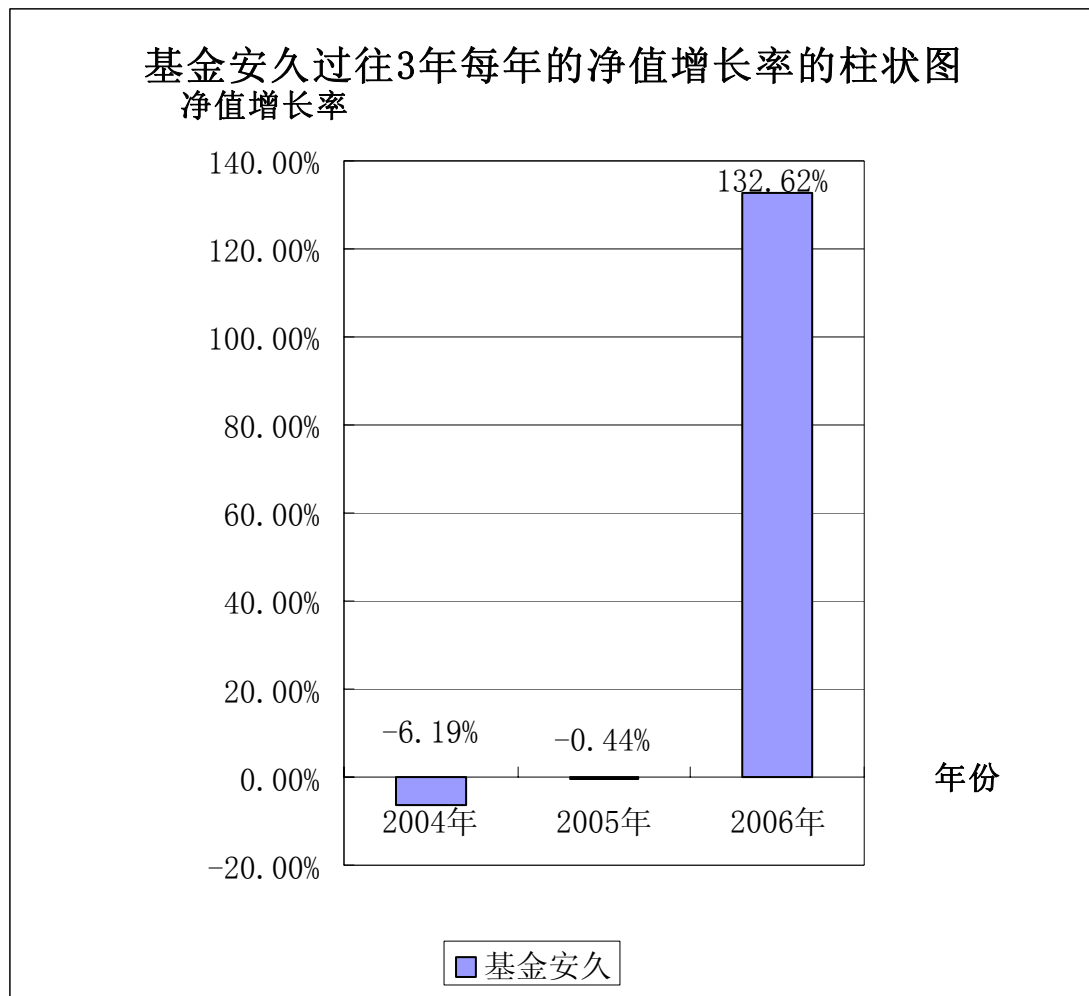
备注：本基金合同中并没有规定业绩比较基准。

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金安久份额累计净值增长率历史走势图
2000/7/4—2006/12/31



C、图示基金过往三年每年的净值增长率



(三) 基金收益分配情况

本基金过往三年未分红。

四、 管理人报告

(一) 基金管理人以及基金经理简介

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 12 月 31 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、华安宏利、华安国际配置 7 只开放式基金，管理人民币资产

265.61 亿元，美元资产 1.98 亿美元。

鲍泓先生，经济学硕士，13 年证券、基金从业经历。1994 年加入天同证券公司，先后担任投资银行总部项目经理、资产管理总部研究员、经理助理等工作。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，从事行业与策略研究工作。

（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《安久证券投资基金基金合同》、《安久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

（1） 行情回顾

2006 年 A 股市场呈现出波澜壮阔的牛市行情，上证综合指数涨幅达到 130.43%。全年市场有几个突出特点。一是宏观经济保持了高位的持续增长，同时上市公司盈利状况明显好转，可比公司的净利润同比增长率从一季度的下降、上半年的 5.85% 迅速提高到前三季度的 21.56%。特别是数量众多的中下游行业由于成本压力缓解业绩得到逐步改善，基本面超预期是支持市场持续走强的重要因素。二是制度变迁表现出深远的影响力，股权分置改革不仅带来了对价的财富效应，更重要的是重塑了市场化的价格形成机制，恢复了股票市场正常运转的自我平衡功能及投资本色。而随着 A 股市场效率的提高，大型 IPO 重新启动，一度漏出在境外的累积市值庞大的优质企业也陆续回归到 A 股市场全流通，上市公司结构更为合理，服务类企业比重大大上升。这将密切资本市场与宏观经济关系，有效提升 A 股市场的整体投资价值与定价权，投资者资产错配风险也相应大大下降。三是全流通后市场价格代表了更广泛的估值群体的看法，市值真正代表财富。这使企业的经营潜能大大激发，同时伴随整体上市、资产注入等形式的资源流入，上市公司投资价值得以提升。四是市场出现了较明显的结构分化，分享经济增长与人口红利的资源类、消费服务类企业，以及受益于装备升级并开始表现出一定国际竞争力的先进制造类企业都有出色表现，同时一批具备长期增长潜力并且内部治理结构良好的个股也开始享有更高的估值溢价。

（2） 操作回顾

安久基金 2006 年净值增长为 132.62%，好于综合指数表现。上半年从关注结构性机会、积极增持稀缺资源、分享经济增长成果的思路出发，对食品饮料、零售、医药、化工、机械以及有色等行业进行了重点的配置。同时，继续注重自下而上的选股思路，保持了一些具备长期核心竞争力的优质公司的投资力度。下半年操作力度有所降低，主要是降低了有色行业配置，适当增持了银行、钢铁、交通运输等行业股票。从全年实际收益看，食品饮料、化工、银行、金属、机械、房地产、医药、零售等行业表现较好。全年操作中存在的问题是对优质新股的关注不够，同时自下而上的个股挖掘能力仍有所欠缺。

（3） 展望

经过 2006 年大幅上涨，A 股市场整体估值水平与全球各主要市场相比已相对合理，牛市的价值回归过程已基本完成。但 A 股市场作为新兴加转轨市场，在宏观经济增长稳定性增强以及制度变革取得实质性突破背景下，不论在资产质量上，还是在经营潜能挖掘上，以及市场资源配置效率上都有着较大的改善余地，存在较多的内涵及外延式增长带来的投资机会。此外，要素价格改革对经济产生的深远影响将使消费服务和先进制造业成为长期的投资主题。但 2007 年市场也将对基金操作也带来一定的挑战，一是如何积极稳妥地参与价值创造带来的上市公司外延式增长机会，二是作为需求方的机构投资者队伍迅速壮大，而 IPO 行为没有完全市场化、及大量非流通股尚未进入实际流通，造成优质股票供给的阶段性短缺，可投资标的相对匮乏可能会加大净值波动的风险。三是在市场整体估值水平上升背景下，自下而上的个股选择能力功底也将更受考验。

（四） 内部监察报告

本报告期内，监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

- （1）组织员工进行法律法规的学习，强化员工合规经营和风险控制意识；
- （2）根据法律法规和监管规定的要求，推动公司和相关部门修订完善公司内控制度；
- （3）完善投资交易系统控制功能，提高合规监察效率；
- （4）开展基金运作稽核检查工作，通过定期检查、不定期抽查等工作方法，加强公司运作合规性控管。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

五、 托管人报告

2006 年，交通银行在安久证券投资基金的托管过程中，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、基金托管协议，依法安全保管了基金的资产，勤勉尽责地履行了基金托管人的义务，不存在损害基金持有人利益的行为。

2006 年，按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议，本托管人对基金管理人——华安基金管理有限公司在基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值、基金份额净值和费用计算上进行了认真复核，未发现基金管理人有关损害基金持有人的利益行为。

2006 年，由基金管理人——华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关安久证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、 审计报告

信长会师报字（2007）第 10612 号

安久证券投资基金全体基金持有人：

我们审计了后附的安久证券投资基金（以下简称“安久基金”）财务报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表，2006 年度的经营业绩表、基金收益分配表、基金净值变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和《金融企业会计制度》的规定编制上述财务报表是安久基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：（1）设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；（2）选择和运用恰当的会计政策；（3）作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，安久基金财务报表已经按照《金融企业会计制度》和证券投资基金相关法规的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了安久基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营业绩及基金净值变动情况。

上海立信长江会计师事务所有限公司

中国注册会计师

吕秋萍 李刚

中国上海市

二〇〇七年一月二十九日

七、 财务会计报告

（一） 资产负债表

二零零六年十二月三十一日

单位：人民币元

项	目	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产：				

银行存款		29,953,369.94	2,070,694.15
清算备付金		8,648,777.22	4,631,266.98
交易保证金		859,609.61	1,131,465.52
应收证券清算款		5,343,691.99	5,088,361.21
应收股利		0.00	0.00
应收利息	7(1)	1,032,999.96	530,072.47
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		766,462,377.29	331,053,622.25
其中：股票投资成本		382,062,738.96	304,785,745.22
债券投资市值		205,050,120.20	90,653,244.00
其中：债券投资成本		204,823,500.69	90,462,481.50
权证投资市值		27,336,816.00	0.00
其中：权证投资成本		18,450,135.02	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>1,044,687,762.21</u>	<u>435,158,726.58</u>

负债：

应付证券清算款		33,929,841.86	0.00
应付赎回款		0.00	0.00
应付管理人报酬		1,170,742.54	521,202.32
应付托管费		195,123.74	86,867.08
应付佣金	7(3)	572,780.96	349,282.92
其他应付款	7(4)	750,000.00	750,000.00
预提费用	7(5)	130,000.00	130,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
负债合计		<u>36,748,489.10</u>	<u>1,837,352.32</u>

所有者权益：

实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		393,512,938.82	26,458,639.53
未分配收益		114,426,334.29	-93,137,265.27
持有人权益合计		<u>1,007,939,273.11</u>	<u>433,321,374.26</u>
负债和所有者权益合计		<u>1,044,687,762.21</u>	<u>435,158,726.58</u>

(二) 经营业绩表

自二零零六年一月一日至二零零六年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2006年度	2005年度
收入：			
股票差价收入	7(6)	197,117,572.61	-47,667,488.33
债券差价收入	7(7)	-567,911.16	758,573.42
权证差价收入	7(8)	11,962,661.12	553,546.21
债券利息收入		3,611,370.12	2,686,007.69
存款利息收入		387,147.20	266,881.22
股利收入		7,606,534.75	4,929,828.30
买入返售证券收入		0.00	899.00
其他收入	7(9)	0.00	43,616.30
收入合计		220,117,374.64	-38,428,136.19
费用：			
基金管理人报酬		9,609,918.12	6,330,531.40
基金托管费		1,601,653.02	1,055,088.71
卖出回购证券支出		956,646.29	63,321.31
其他费用	7(10)	385,557.65	372,274.29
其中：上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		240,000.00	240,000.00
审计费用		50,000.00	50,000.00
费用合计		12,553,775.08	7,821,215.71
基金净收益		207,563,599.56	-46,249,351.90
加：未实现估值增值变动数		367,054,299.29	44,347,758.01
基金经营业绩		574,617,898.85	-1,901,593.89

(三) 收益分配表

自二零零六年一月一日至二零零六年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		207,563,599.56	-46,249,351.90
加：期初未分配收益		-93,137,265.27	-46,887,913.37
可供分配基金净收益		114,426,334.29	-93,137,265.27
减：本期已分配基金净收益		0.00	0.00
期末基金未分配净收益		114,426,334.29	-93,137,265.27

(四) 净值变动表

自二零零六年一月一日至二零零六年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		433,321,374.26	435,222,968.15
二、本期经营活动：			
基金净收益		207,563,599.56	-46,249,351.90
未实现估值增值变动数		367,054,299.29	44,347,758.01
经营活动产生的基金净值变动数		574,617,898.85	-1,901,593.89
三、本期向持有人分配收益		0.00	0.00
四、期末基金净值		1,007,939,273.11	433,321,374.26

(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2号《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。

本基金为2007年内即将到期的封闭式基金。本基金2006年度会计报表以持续经营假设为基础编制。

1. 基金的基本情况

历史沿革：安久证券投资基金（以下简称“基金”）系根据中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]28号文《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》，经2000年6月四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过，由四川国信投资基金清理规范而成。经原四川国信投资基金临时持有人大会（通讯表决）决议通过并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2000]56号文《关于同意四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》批准，基金于2002年5月21日完成扩募，基金总份额由200,000,020份基金份额扩募至500,000,000份基金份额，扩募后基金存续期延长5年，至2007年8月30日止。

募集申请的核准机构：中国证券监督管理委员会

核准文号：证监基金字[2000]第28号

核准文件名称：关于四川国信投资基金清理规范方案的批复

基金运作方式：契约型封闭式

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

基金合同生效日：2000年7月4日

基金合同生效日的基金份额：200,000,020

2. 基本会计假设

本年度会计报表的编制遵守基本会计假设。

3. 主要会计政策、会计估计及其变更

1) 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定
《金融企业会计制度》及《证券投资基金会计核算办法》。

2) 会计年度

本基金的会计年度为公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

4) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

5) 基金资产的估值原则

①上市流通的股票和国债，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）估值；上市流通的可转换债券和企业债券，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（平均价）扣除债券起息日或上次除息日至估值日的利息后的净价估值。估值日无交易的，以最近交易日的市价估值。

②未上市的股票应区分以下情况处理：

i) 配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值；

ii) 首次公开发行的股票，按成本估值。

iii) 自 2006 年 11 月 13 日起，基金新投资非公开发行股票应区分以下情况处理：

(a) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

(b) 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，应按下列公式确定估值日该非公开发行股票的价值：

$$FV = C + (P - C) \times \frac{D1 - Dr}{D1}$$

其中：FV 为估值日该非公开发行股票的价值；C 为该非公开发行股票的初始取得成本；P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；D1 为该非公开发行股票锁定期所含的交易天数；Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期

结束所含的交易天数（不含估值日当天）。

③在银行间债券市场交易的债券以及未上市的债券按成本估值。

④从获赠确认日起至卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市价（平均价）估值；未上市交易的权证投资按公允价值估值。配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按市价高于配股价的差额估值；如果市价低于配股价，按零估值。

⑤如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理公司应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

⑥如有新增事项，按国家最新规定估值。

6) 证券交易的成本计价方法：

①买入股票时，于成交日按应支付的全部价款（包括成交价格和相关费用）计入股票投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本；收到股权分置改革进程中由流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

②买入上市债券时，于成交日按应支付的全部价款扣除债券起息日或上次除息日至购买日的利息后记入债券投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

③买入非上市债券时，于实际支付价款日按支付的全部价款扣除债券起息日或上次除息日至购买日的利息后记入债券投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

④获赠权证在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

⑤买入权证时，于成交日按应支付的全部价款（包括成交价格和相关费用）计入权证投资成本，出售时按移动加权平均法结转成本。

7) 待摊费用和预提费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用核算已经发生的、大于基金净值十万分之一的应分摊计入本期和以后各期的费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等。待摊费用在实际发生时入账，在受益期内平均摊销。

预提费用核算预计将发生的、大于基金净值十万分之一的应预提计入本期的费用，如注册登记费、上市年费、信息披露费、审计费用和律师费用等。预提费用在预计发生时入账。

8) 收入的确认和计量

①证券买卖差价收入：

i) 股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本

和相关费用的差额入账。

ii) 债券差价收入：卖出上市债券，应于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；卖出非上市债券，于实际收到价款时确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

iii) 权证差价收入：于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

②股利收入：在被投资股票股权除息日确认，并按上市公司宣告分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账。

③债券利息收入：债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提，并按债券票面价值与票面利率计提的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认入账。

④买入返售证券收入：在证券持有期内采用直线法逐日计提，按计提的金额确认收入。

⑤存款利息收入：按本金与适用的利率逐日计提确认，计提对象为银行存款、清算备付金和权证交易保证金。

⑥其他收入：在实际收到时确认。

9) 费用的确认和计量

①管理人报酬和基金托管费：按照基金合同和招募说明书规定的方法和标准计提，并按计提的金额入账。

②卖出回购证券支出：在该证券持有期内采用直线法逐日计提，并按计提的金额入账。

③利息支出：在借款期内逐日计提，并按借款本金与适用的利率计提的金额入账。

④其他费用：发生额大于基金净值十万分之一，采用待摊或预提的方法，待摊或预提计入基金损益；发生额小于基金净值十万分之一，于发生时直接计入基金损益。

10) 基金的收益分配政策

①每份基金份额享有同等分配权；

②基金收益分配采用现金方式或法律法规允许的其他方式；

③基金当年收益应先弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

④基金投资当年亏损，则不进行收益分配；

⑤在符合有关基金分红的条件下，基金收益每年至少分配一次，年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 90%，其具体分配数额及比例由基金管理人拟定；

⑥法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

11) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计

政策和会计估计

无。

12) 会计政策、会计估计变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由

无。

13) 重大会计差错的内容和更正金额

无。

4. 税项

根据财政部、国家税务总局财税字（2002）128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字（2004）78 文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税（2005）11 号《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税（2005）102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税（2005）103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

①以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

②基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税。

③基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日起，对个人投资者从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定计征个人所得税，基金投资者参照前述规定。

④基金买卖股票按照 1% 的税率征收印花税。从 2005 年 1 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，对买卖、继承、赠与所书立的 A 股、B 股股权转让书据，由立据双方当事人分别按 1% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。

⑤基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

5. 资产负债表日后事项

无。

6. 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、 持有本基金	基金合同
交通银行股份有限公司	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		
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		

(2). 通过关联方席位进行的交易

- ① 本报告期通过关联人席位的股票成交量：无。
上年度通过关联人席位的股票成交量：无。
- ② 本报告期通过关联人席位的债券、回购和权证成交量：无。
上年度通过关联人席位的债券、回购和权证成交量：无。
- 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：无。
上年度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 9,609,918.12 元。（上年度：6,330,531.40 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 1,601,653.02 元。（上年度：

1, 055, 088. 71 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交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 29, 953, 369. 94 元（2005 年：2, 070, 694. 15）。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 197, 578. 35 元。（2005 年：94, 837. 50 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 12 月 31 日的相关余额 8, 648, 777. 22 元计入“清算备付金”科目（2005 年：4, 631, 266. 98 元）。

(4). 基金管理公司投资本基金的情况：

2006 年度基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	年末数		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	9, 582, 100. 00	1. 92%	0. 00	0. 00	9, 582, 100. 00	1. 92%	-

2005 年度基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	年末数		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	5, 000, 000. 00	1. 00%	4, 582, 100. 00	0. 00	9, 582, 100. 00	1. 92%	-

(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：

本报告期末与 2005 年末均无。

7. 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 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
银行存款利息	15, 795. 88	569. 48
清算备付金利息	6, 652. 95	3, 798. 03
权证保证金利息	49. 30	59. 10
债券利息	1, 010, 501. 83	525, 645. 86
买入返售证券利息	0. 00	0. 00
合计	1, 032, 999. 96	530, 072. 47

(2). 投资估值增值明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
股票估值增值余额	384, 399, 638. 33	26, 267, 877. 03



债券估值增值余额	226,619.51	190,762.50
权证估值增值余额	8,886,680.98	0.00
合计	393,512,938.82	26,458,639.53

(3). 应付佣金明细:	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
明细项目		
东方证券股份有限公司	152,833.54	6,454.02
申银万国证券股份有限公司	69,926.89	21,807.27
上海证券有限责任公司	0.00	4,366.39
平安证券有限责任公司	128,613.69	128,725.87
光大证券股份有限公司	92,036.98	34,830.76
方正证券有限责任公司	3,639.44	3,639.44
国泰君安证券股份有限公司	38,911.72	121,043.44
联合证券有限责任公司	86,818.70	28,415.73
合计	572,780.96	349,282.92

(4). 其他应付款明细:	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
明细项目		
券商垫付交易保证金	750,000.00	750,000.00
合计	750,000.00	750,000.00

(5). 预提费用明细:	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
明细项目		
信息披露费	80,000.00	80,000.00
审计费用	50,000.00	50,000.00
合计	130,000.00	130,000.00

(6). 卖出股票:		
明细项目	2006 年	2005 年
卖出股票成交总额	849,842,270.64	938,705,345.49
减: 佣金	709,499.79	787,141.69
成本总额	652,015,198.24	985,585,692.13
股票差价收入	197,117,572.61	-47,667,488.33

(7). 卖出债券:		
明细项目	2006 年	2005 年
卖出债券成交总额	122,236,069.32	91,497,149.05
减: 成本总额	120,693,096.16	88,852,377.63
应收利息总额	2,110,884.32	1,886,198.00

债券差价收入	-567,911.16	758,573.42
--------	-------------	------------

(8). 卖出权证:

明细项目	2006 年	2005 年
卖出权证成交总额	16,941,557.34	553,546.21
减: 佣金	0.00	0.00
成本总额	4,978,896.22	0.00
权证差价收入	11,962,661.12	553,546.21

(9). 其他收入:

明细项目	2006 年	2005 年
新股、配股申购手续费返还	0.00	43,616.30
合计	0.00	43,616.30

(10). 其他费用:

明细项目	2006 年	2005 年
审计费	50,000.00	50,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
交易所费用	8,744.33	655.36
账户维护费	19,470.00	18,830.00
银行间费用	7,199.00	2,788.93
其他费用	144.32	0.00
合计	385,557.65	372,274.29

(11). 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	2005 年
股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额	1,868,676.92	555,598.59

8. 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:

基金可使用以基金名义开设的股票账户, 比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股, 根据基金与上市公司所签订申购协议的规定, 在新股上市后的约定期限内不能自由转让; 基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股, 从新股获配日至

新股上市日之间不能自由转让。

股票名称	数量	总成本	总市值	年末估值 单价	转让受限原因	受限期限
广深铁路	591,780	2,225,092.80	4,243,062.60	7.17	网下新股未上市	至 2007 年 3 月 22 日
中国人寿	26,000	490,880.00	490,880.00	18.88	网上新股未上市	至 2007 年 1 月 9 日 自网上新股上市日起 锁定 3 个月
中国人寿	119,070	2,248,041.60	2,248,041.60	18.88	网下新股未上市	至 2007 年 2 月 1 日
大秦铁路	319,280	1,580,436.00	2,582,975.20	8.09	网下新股未上市	至 2007 年 3 月 22 日
山河智能	51,885	518,850.00	1,689,894.45	32.57	网下新股未上市	至 2007 年 2 月 28 日
鲁阳股份	38,917	428,087.00	1,048,813.15	26.95	网下新股未上市	至 2007 年 3 月 15 日
青岛金王	55,377	425,849.13	658,986.30	11.90	网下新股未上市	至 2007 年 1 月 25 日
雪 莱 特	32,558	223,347.88	611,764.82	18.79	网下新股未上市	至 2007 年 1 月 18 日
青岛软控	12,422	322,972.00	587,312.16	47.28	网下新股未上市	至 2007 年 2 月 26 日
海鸥卫浴	15,978	128,303.34	358,226.76	22.42	网下新股未上市	至 2007 年 3 月 21 日
大唐发电	32,000	213,760.00	329,600.00	10.30	网下新股未上市	至 2007 年 1 月 12 日
江苏宏宝	30,725	119,213.00	215,075.00	7.00	网下新股未上市	
合计		8,924,832.75	15,064,632.04			

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限的债券。

八、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	766,462,377.29	73.37%
2	债券	205,050,120.20	19.63%
3	权证	27,336,816.00	2.62%
4	银行存款和清算备付金	38,602,147.16	3.70%
5	其它资产	7,236,301.56	0.69%
	合计	1,044,687,762.21	100.00%

(二) 股票投资组合

行业分类	市值(元)	占资产净值比例
B 采掘业	58,481,449.62	5.80%
C 制造业	407,592,152.61	40.44%
C0 食品、饮料	89,945,964.26	8.92%
C1 纺织、服装、皮毛	546,865.03	0.05%
C3 造纸、印刷	14,886,420.08	1.48%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	56,101,951.80	5.57%
C5 电子	611,764.82	0.06%
C6 金属、非金属	64,908,925.59	6.44%
C7 机械、设备、仪表	107,333,962.41	10.65%
C8 医药、生物制品	72,597,312.32	7.20%
C99 其他制造业	658,986.30	0.07%

D	电力、煤气及水的生产和供应业	329,600.00	0.03%
F	交通运输、仓储业	26,359,037.80	2.62%
G	信息技术业	22,797,216.63	2.26%
H	批发和零售贸易	31,338,849.68	3.11%
I	金融、保险业	123,267,236.60	12.23%
J	房地产业	65,623,761.25	6.51%
K	社会服务业	5,216,565.44	0.52%
M	综合类	25,456,507.66	2.53%
合 计		766,462,377.29	76.04%

(三) 基金投资股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	600036	招商银行	5,100,000	82,773,000.00	8.21%
2	600761	安徽合力	2,818,090	63,209,758.70	6.27%
3	600519	贵州茅台	716,724	62,928,367.20	6.24%
4	600276	恒瑞医药	1,569,398	50,597,391.52	5.02%
5	000402	金 融 街	2,410,778	40,645,717.08	4.03%
6	600309	烟台万华	1,670,014	40,230,637.26	3.99%
7	600030	中信证券	1,384,500	37,755,315.00	3.75%
8	600583	海油工程	946,858	33,026,407.04	3.28%
9	000825	太钢不锈	2,522,789	32,241,243.42	3.20%
10	002024	苏宁电器	650,200	28,920,896.00	2.87%
11	600858	银座股份	1,256,491	25,456,507.66	2.53%
12	600028	中国石化	2,788,066	25,455,042.58	2.53%
13	000002	万 科 A	1,524,211	23,579,544.17	2.34%
14	600271	航天信息	651,163	22,797,216.63	2.26%
15	000869	张 裕 A	438,362	22,281,940.46	2.21%
16	002007	华兰生物	961,535	21,999,920.80	2.18%
17	600456	宝钛股份	698,987	21,654,617.26	2.15%
18	000157	中联重科	921,890	20,143,296.50	2.00%
19	600009	上海机场	1,020,000	19,533,000.00	1.94%
20	000792	盐湖钾肥	663,794	15,871,314.54	1.57%
21	600308	华泰股份	1,114,253	14,886,420.08	1.48%
22	600031	三一重工	403,300	13,014,491.00	1.29%
23	000039	中集集团	500,000	9,315,000.00	0.92%
24	600686	金龙汽车	373,390	6,213,209.60	0.62%
25	600007	中国国贸	507,448	5,216,565.44	0.52%
26	600600	青岛啤酒	340,940	4,735,656.60	0.47%
27	601333	广深铁路	591,780	4,243,062.60	0.42%
28	601628	中国人寿	145,070	2,738,921.60	0.27%
29	601006	大秦铁路	319,280	2,582,975.20	0.26%
30	000951	中国重汽	100,000	2,476,000.00	0.25%

31	600694	大商股份	81,909	2,417,953.68	0.24%
32	002097	山河智能	51,885	1,689,894.45	0.17%
33	000024	招商地产	50,000	1,398,500.00	0.14%
34	002088	鲁阳股份	38,917	1,048,813.15	0.10%
35	002094	青岛金王	55,377	658,986.30	0.07%
36	002076	雪 莱 特	32,558	611,764.82	0.06%
37	002073	青岛软控	12,422	587,312.16	0.06%
38	002029	七 匹 狼	28,291	546,865.03	0.05%
39	002084	海鸥卫浴	15,978	358,226.76	0.04%
40	601991	大唐发电	32,000	329,600.00	0.03%
41	002071	江苏宏宝	30,725	215,075.00	0.02%
42	002102	冠福家用	7,000	75,950.00	0.01%

(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	600036	招商银行	42,878,036.51	9.90%
2	600030	中信证券	34,732,106.75	8.02%
3	000933	神火股份	33,396,569.69	7.71%
4	600009	上海机场	31,564,437.34	7.28%
5	600276	恒瑞医药	29,154,299.32	6.73%
6	000869	张 裕 A	27,582,445.39	6.37%
7	000983	西山煤电	27,430,348.64	6.33%
8	000002	万 科 A	22,360,393.66	5.16%
9	000157	中联重科	21,422,468.12	4.94%
10	000825	太钢不锈	21,403,516.62	4.94%
11	600887	伊利股份	20,754,604.97	4.79%
12	600028	中国石化	20,292,244.43	4.68%
13	600761	安徽合力	19,915,003.18	4.60%
14	600271	航天信息	19,579,024.07	4.52%
15	002021	中捷股份	18,356,929.54	4.24%
16	600308	华泰股份	18,095,956.09	4.18%
17	600694	大商股份	16,836,082.19	3.89%
18	600519	贵州茅台	15,446,242.62	3.56%
19	600415	小商品城	14,564,820.50	3.36%
20	600456	宝钛股份	13,875,235.22	3.20%
21	002024	苏宁电器	13,696,156.30	3.16%
22	002007	华兰生物	11,442,992.48	2.64%
23	600858	银座股份	10,836,312.26	2.50%
24	000538	云南白药	10,448,815.54	2.41%
25	600123	兰花科创	9,007,788.41	2.08%

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	000538	云南白药	39,799,766.00	9.18%
2	000933	神火股份	31,944,949.29	7.37%
3	600456	宝钛股份	31,028,733.04	7.16%
4	000869	张裕A	29,859,806.73	6.89%
5	000983	西山煤电	29,584,027.19	6.83%
6	600309	烟台万华	28,957,324.11	6.68%
7	000792	盐湖钾肥	28,234,438.31	6.52%
8	002021	中捷股份	27,218,226.66	6.28%
9	600694	大商股份	25,599,319.81	5.91%
10	002025	航天电器	25,583,224.83	5.90%
11	600887	伊利股份	23,379,965.34	5.40%
12	000970	中科三环	22,495,963.91	5.19%
13	600009	上海机场	20,938,987.72	4.83%
14	000002	万科A	20,213,972.52	4.66%
15	600000	浦发银行	19,598,717.00	4.52%
16	600348	国阳新能	19,542,473.32	4.51%
17	600036	招商银行	19,279,674.86	4.45%
18	600261	浙江阳光	19,207,892.20	4.43%
19	600489	中金黄金	19,008,989.44	4.39%
20	600583	海油工程	18,184,922.67	4.20%
21	600028	中国石化	17,746,562.57	4.10%
22	600153	建发股份	15,682,604.01	3.62%
23	000402	金融街	14,628,425.65	3.38%
24	600008	首创股份	13,975,431.22	3.23%
25	600415	小商品城	13,756,761.61	3.17%
26	002041	登海种业	13,239,548.16	3.06%
27	600438	通威股份	11,858,817.02	2.74%
28	600361	华联综超	11,827,942.08	2.73%
29	600519	贵州茅台	10,627,556.32	2.45%
30	600123	兰花科创	9,921,023.88	2.29%
31	600600	青岛啤酒	9,889,704.15	2.28%
32	000911	南宁糖业	9,482,017.08	2.19%
33	000987	广州友谊	9,463,515.04	2.18%
34	000157	中联重科	9,123,939.71	2.11%

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*	731,160,868.90
卖出股票的收入总额	849,842,270.64

*: 买入股票的成本总额中未扣除因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价 1,868,676.92 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	国债投资	154,960,120.20	15.37%
2	金融债	50,090,000.00	4.97%
	合计	205,050,120.20	20.34%

(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	010115	21 国债(15)	624,850	62,872,407.00	6.24%
2	010010	20 国债(10)	339,750	34,240,005.00	3.40%
3	010214	02 国债(14)	324,820	32,657,402.80	3.24%
4	050415	05 农发 15	200,000	19,990,000.00	1.98%
5	060221	06 国开 21	200,000	19,980,000.00	1.98%

(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	权证数量(份)	市值(元)	占资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	778,000	11,298,116.00	1.12%
2	580005	万华 HXB1	400,000	8,923,200.00	0.89%
3	031001	侨城 HQC1	500,000	7,115,500.00	0.71%

(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	750,000.00



2	权证交易保证金	109,609.61
3	应收利息	1,032,999.96
4	应收证券清算款	5,343,691.99
	合计	7,236,301.56

4、处于转股期的可转换债券明细

本报告期末处于转股期的可转换债券情况：无。

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(份)	成本总额(元)	获得途径
1	580005	万华 HXB1	550,000	6,733,474.04	二级市场买入
2	580006	雅戈 QCB1	10,000	42,553.30	二级市场买入
3	580009	伊利 CWB1	26,000	367,380.13	二级市场买入
4	031001	侨城 HQC1	737,000	8,497,456.98	二级市场买入
5	030002	五粮 YGC1	778,000	7,788,166.79	二级市场买入
6	580005	万华 HXB1	274,244	0.00	股权分置改革被动持有
7	580990	茅台 JCP1	1,020,627	0.00	股权分置改革被动持有
8	580993	万华 HXP1	411,366	0.00	股权分置改革被动持有
9	580997	招行 CMP1	1,149,486	0.00	股权分置改革被动持有
10	038008	钾肥 JTP1	238,672	0.00	股权分置改革被动持有

6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下：

	基金份额
2006 年 1 月 1 日	9,582,100.00 份
买入	0.00 份
卖出	0.00 份
2006 年 12 月 31 日	9,582,100.00 份

九、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

基金份额持有人户数	6,000 户	
平均每户持有基金份额	83,333 份	
项目	份额(份)	占总份额的比例
机构投资者持有的基金份额	399,365,483	79.87%
个人投资者持有的基金份额	100,634,517	20.13%

(二) 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（集团）公司	49,009,420	9.80%
2	中国人寿保险股份有限公司	48,508,014	9.70%
3	中国太平洋保险（集团）股份有限公司	29,911,124	5.98%
4	招商证券—招行—招商证券基金宝集合资产管理计划	29,414,500	5.88%
5	UBS AG	20,643,425	4.13%
6	泰康人寿保险股份有限公司	19,010,617	3.80%
7	全国社保基金六零三组合	16,175,955	3.24%
8	中国人民财产保险股份有限公司	14,918,707	2.98%
9	全国社保基金一零九组合	12,832,089	2.57%
10	国泰君安—花旗—DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	12,422,200	2.48%

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、本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 2006 年 2 月 15 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，鉴于第二届董事会任期已经届满，经本基金管理人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。

(2). 2006 年 5 月 27 日，本基金管理人发布关于变更公司董事长的公告，经本基金管理人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。

(3). 2006 年 8 月 19 日，本基金管理人发布关于由俞妙根先生代行董事长职务的公告，经本基金管理人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，由俞妙根先生代为履行公司董事长的职务。

(4). 2006 年 10 月 17 日，本基金管理人发布如下临时公告，接上级部门通知，公司总经理韩方河同志因涉嫌个人违纪，正在协助调查。对于上述事件，公司特澄清如下：一、上述调查仅涉及韩方河同志个人，与本公司及本公司旗下基金无关。二、公司在董事会的领导和大力支持下，目前公司的日常工作由常务副总经理邵杰军同志负责。本公司目前运作一切正常。

(5). 2006 年 11 月 7 日，本基金管理人发布如下临时公告，经股东会选举，徐建国先生、万才华先生任公司董事，王成明先生、韩方河先生不再担任公司董事；谢伟民先生、柳振铎先生任公司监事，韩国璋先生不再担任公司监事。经董事会选举，徐建国先生拟任公司董事长，俞妙根先生任公司副董事长，俞妙根先生不再担任代董事长；经华安基金管理有限公司监事会选举，谢伟民任公司监事长，陈涵不再担任监事长。经董事会审议，拟聘任俞妙根先生任公司总经理，韩方河先生不再担任公司总经理。上述董事、监事人员的变更按规定需报中国证监会备案，董事长的选举、总经理的聘任按规定尚需报中国证监会核准，在中国证

监会核准程序没有完成之前，徐建国先生主持公司董事会工作，俞妙根先生主持公司日常工作。

(6). 2007 年 3 月 22 日，本基金管理人发布如下临时公告，根据《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》的规定，经华安基金管理有限公司股东会议决议，同意张军先生因个人原因辞去本公司董事职务。上述人员的变更已报中国证监会上海证监局备案。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

(1). 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人员任职资格的公告》。

(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：

1、本报告期基金收益分配事项：无。

(六)基金改聘为其审计的会计师事务所情况：

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：50,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2004 年 12 月 13 日起至今。

(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：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：无

退租席位：

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
方正证券有限责任公司	1	-
上海证券有限责任公司	-	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	占总成交量比例	佣金	占总佣金比例
东方证券股份有限公司	2	194,781,390.44	12.53%	158,379.52	12.76%
申银万国证券股份有限公司	1	235,737,004.26	15.16%	188,885.96	15.21%
平安证券有限责任公司	1	376,514,592.56	24.22%	305,296.51	24.59%
光大证券股份有限公司	1	335,381,653.04	21.57%	262,437.99	21.14%
国泰君安证券股份有限公司	1	137,478,627.68	8.84%	111,465.87	8.98%
联合证券有限责任公司	1	274,913,713.28	17.68%	215,122.68	17.33%

合	计	7	1, 554, 806, 981. 26	100. 00%	1, 241, 588. 53	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 总量比例	回购成交量	占总成交 总量比例	权证成交量	占总成交 总量比例
东方证券股份有限公司	23, 025, 916. 40	10. 54%	60, 000, 000. 00	3. 75%	7, 119, 598. 49	17. 64%
申银万国证券股份有限 公司	30, 102, 195. 70	13. 78%	755, 300, 000. 00	47. 19%	3, 560, 982. 15	8. 82%
平安证券有限责任公司	135, 673, 853. 60	62. 11%	405, 500, 000. 00	25. 33%	14, 110, 211. 91	34. 95%
光大证券股份有限公司	0. 00	0. 00%	0. 00	0. 00%	12, 404, 544. 07	30. 73%
国泰君安证券股份有限 公司	29, 633, 392. 30	13. 57%	379, 900, 000. 00	23. 73%	2, 402, 938. 75	5. 95%
联合证券有限责任公司	0. 00	0. 00%	0. 00	0. 00%	771, 534. 58	1. 91%
合 计	218, 435, 358. 00	100. 00%	1, 600, 700, 000. 00	100. 00%	40, 369, 809. 95	100. 00%

3、券商专用席位选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构, 选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用, 选择标准为:

(1) 资历雄厚, 信誉良好;

(2) 财务状况良好, 经营行为规范;

(3) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足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, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务;

(5) 证券研究或市场研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面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。

4、券商专用席位选择程序:

(1) 对席位候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部等部门组织相关人员依据上述席位选择标准和《券商服务评价办法》, 对候选席位的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增席位申请审核表》

研究发展部等部门汇总对各候选席位券商的综合评估结果, 择优选出拟新增席位, 填写《新增席位申请审核表》, 对拟新增席位的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选席位名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部等部门提交的《新增席位申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易席位使用协议》，并通知基金托管人。

(九) 其他重要事项：

其他重要事项	披露日期
1) 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，公司自 2006 年 6 月 20 日起正式开通全国统一客户服务号码 40088-50099（长途话费由本公司支付），客户通过固定电话、小灵通和手机均可拨打。本公司原客户服务号码 021-68604666 仍可继续使用。	2006 年 6 月 20 日
2) 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，可以投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券。	2006 年 6 月 28 日
3) 华安基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告，对收益分配条款和基金份额持有人大会表决条款作出修改。	2006 年 12 月 21 日
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。	
4) 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”。	2006 年 7 月 18 日



十一、备查文件目录

- 1、《安久证券投资基金基金合同》；
- 2、《安久证券投资基金招募说明书》；
- 3、《安久证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、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
2007 年 3 月 31 日