

华安宏利股票型证券投资基金

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：中国建设银行股份有限公司

签发日期：二〇〇七年三月三十一日

一、	重要提示	3
二、	基金产品概况	3
1、	基金概况	3
2、	基金的投资	3
3、	基金管理人	4
4、	基金托管人	4
5、	信息披露	4
6、	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
3、	过往三年基金收益分配情况	7
四、	管理人报告	7
1、	基金管理人和基金经理简介	7
2、	基金运作合规性声明	7
3、	基金经理工作报告	8
4、	内部监察报告	8
五、	托管人报告	9
六、	审计报告	9
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	12
(五)、	会计报表附注	13
八、	投资组合报告	23
(一)、	报告期末基金资产组合	23
(二)、	报告期末股票投资组合	23
(三)、	报告期末股票明细	24
(四)、	报告期内股票投资组合的重大变动	25
(五)、	报告期末债券投资组合	26
(六)、	报告期末前五名债券明细	26
(七)、	报告期末权证投资组合	27
(八)、	资产支持证券投资组合	27
(九)、	投资组合报告附注	27
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	28
十、	开放式基金份额变动	28
十一、	重大事件	28
十二、	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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,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

1、基金概况

基金名称:	华安宏利股票型证券投资基金
基金简称:	华安宏利
交易代码:	040005
深交所行情代码:	160406
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2006 年 9 月 6 日
期末基金份额总额:	1,637,980,896.86 份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

投资目标: 通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益,以及分红所带来的红利收益,实现基金资产的稳定增值。

投资策略: 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持,使其更为科学和客观。

业绩比较基准: 基金整体业绩比较基准 = 中信标普 300 指数收益率 $\times$ 90% + 同业存款利率 $\times$ 10%

风险收益特征：

本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的稳定增值。

3、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
(邮政编码：200120)
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@huan.com.cn
客户服务热线：021-68604666, 40088-50099

4、基金托管人

基金托管人：中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）
注册地址：北京市西城区金融大街 25 号
办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
(邮政编码：100032)
法定代表人：郭树清
信息披露负责人：尹东
联系电话：010-67595104
传真：010-66275853
电子邮箱：yindong@ccb.cn

5、信息披露

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

6、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

(除特殊注明外，单位：人民币元)

1、主要财务指标

财务指标	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2006 年 12 月 31 日
基金本期净收益：	198,999,915.59
基金加权份额本期净收益：	0.1185
期末可供分配基金收益	193,620,677.62
期末可供分配基金份额收益	0.1182
期末基金资产净值：	2,289,236,064.30
期末基金份额净值：	1.3976
基金加权平均净值收益率	10.51%
本期基金份额净值增长率	39.76%
基金份额累计净值增长率	39.76%

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

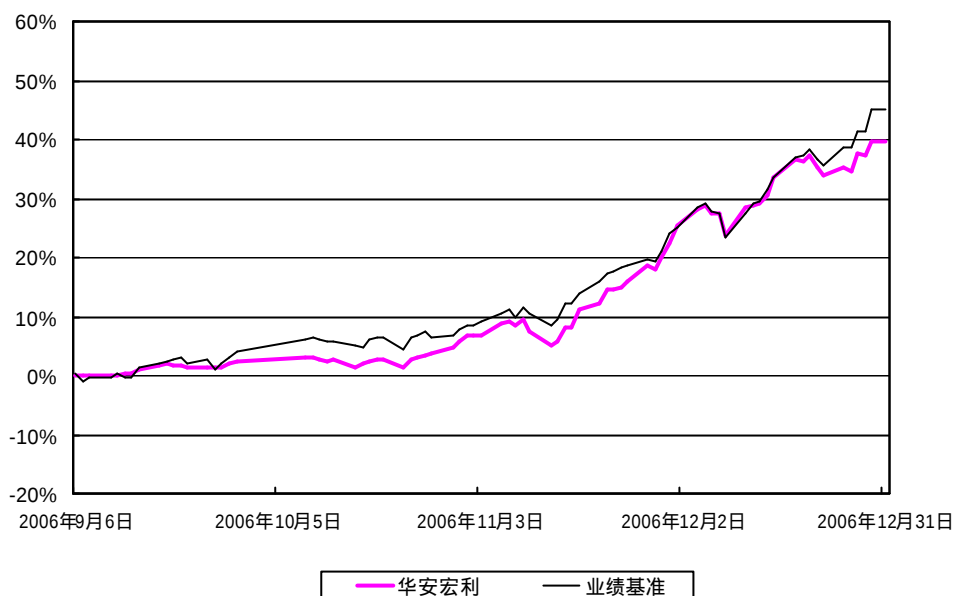
A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值 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	-	-
过去三个月 自基金合同 生效起至今	36.47%	1.25%	39.17%	1.27%	-2.70%	-0.02%
	39.76%	1.11%	45.23%	1.17%	-5.47%	-0.06%

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

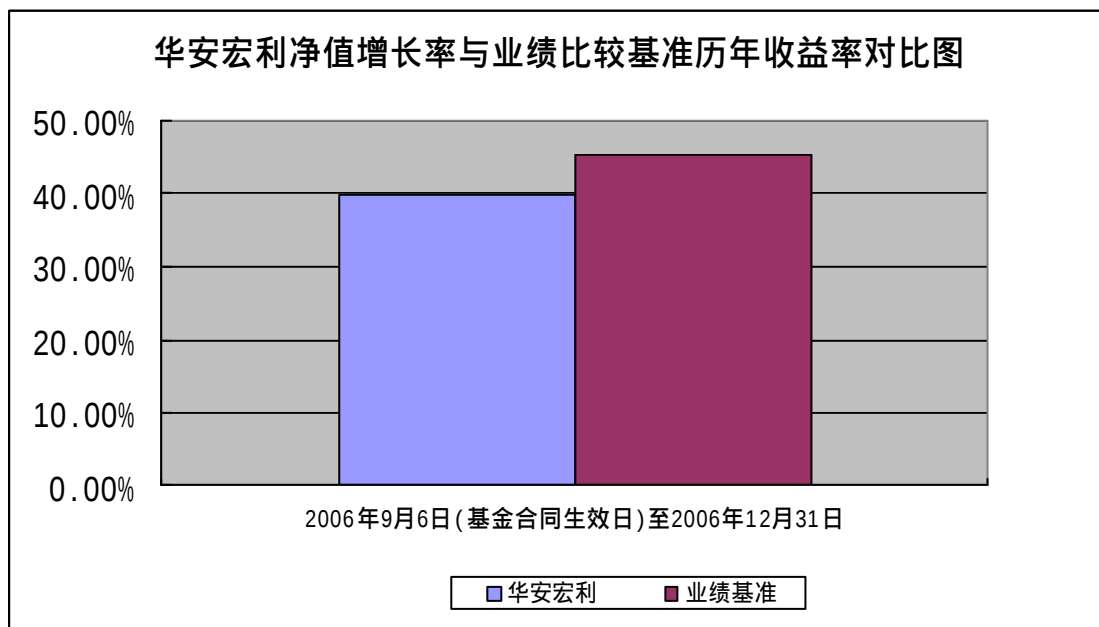
华安宏利份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图
2006/9/6 - 2006/12/31



注：1、本基金于 2006 年 9 月 6 日成立。截至本报告期末，本基金成立不满一年。
2、本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60% - 95%，按照招募说明书约定，在基金合同生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。截止 12 月 6 日，本基金已符合上述投资比例限制。

C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准的收益率对比图



3、过往三年基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日) 至 2006 年 12 月 31 日	无	
合计	无	

四、 管理人报告

1、基金管理人和基金经理简介

(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 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。

(2) 基金经理

尚志民先生:工商管理硕士,10 年证券、基金从业经验,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员、基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理。现任基金投资部副总监、基金安顺和华安宏利基金经理。

陈俏宇女士:工商管理硕士,中国注册会计师非执业会员,11 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003 年 10 月加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员和专户理财部投资经理,现任基金安顺和华安宏利基金经理助理。

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《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》、《华安宏利股票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。

3、基金经理工作报告

作为华安基金管理公司旗下首只纯股票型基金,华安宏利成立于 A 股市场的转折之年。基于对市场的乐观判断,宏利在封闭期结束,规模相对稳定后快速完成建仓,并基本保持了高仓位。组合主要配置于具有相对较高安全边际、较好流动性的大市值股票,尤其是其中具有资产整合预期的公司,以及部分具有核心竞争力和清晰盈利模式的成长性公司。自 2006 年 9 月 6 日成立至年末,基金单位净值涨幅达 39.76%。

展望 2007 年,尽管我们将在行业配置与个股选择中采取更为严谨的态度,但对市场的信心并未因 A 股整体估值水平的提升而有所动摇。

我们将继续重视大市值股票的长期战略投资价值,在中国经济由大国向强国转变的过程中,我们相信部分大市值公司因其行业地位所确立的竞争优势将进一步巩固,并可能受益于政策主导与推动的影响,获得内生与外延并存的发展机会。另一方面,我们也会从估值的阶段性变化角度出发,对部分大市值股票进行动态配置与调整,提高组合的资金效率。此外,我们对安全边际的另一种诠释体现于对成长性公司的重视,尤其是新经济背景下的新兴行业,比如我们提出并将继续深化的新兴物流行业的投资。所谓的大物流行业不仅限于传统意义上的交运行业,而是延伸到涉及商品链、信息链、资金链等更为广泛的各环节,在企业战略逐步转向横向一体化,在全球产业转移及国内企业逐步融入全球采购体系过程中,有助于帮助企业构筑竞争优势的专业化供应链管理企业,而这其中更有先行者具备发展成为综合行业解决方案提供商的潜力。

借年报的机会,我们再次表达对支持本基金的投资者的谢意。承托着投资者可贵的信任,我们克服了一些不利因素,获得目前的投资绩效。同时我们也希望在基金投资者教育方面能尽一些绵薄之力,通过适当的沟通,倡导理性的基金投资行为,维护投资者对共同基金的认同,构建华安宏利基金与投资者之间的和谐关系,勤勉尽责地履行管理人的专业和社会职责。

4、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

中国建设银行股份有限公司根据《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和《华安宏利股票型证券投资基金托管协议》，托管华安宏利股票型证券投资基金（以下简称华安宏利基金）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在华安宏利基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人 - 华安基金管理有限公司在华安宏利基金投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由华安宏利基金管理人 - 华安基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

六、 审计报告

普华永道中天审字(2007)第 20211 号

华安宏利股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安宏利股票型证券投资基金(以下简称“华安宏利基金”)会计报表，包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表、2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间的经营业绩表和基金净值变动表以及会计报表附注。

一、 管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是华安宏利基金的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、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计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会计报表发表审计意见。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会计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，以获取有关会计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会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计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，以及评价会计报表的总体列报。

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，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华安宏利基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天会计师事务所有限公司
中国 上海市

注册会计师 汪 棣
注册会计师 陈 宇
2007 年 3 月 23 日

七、 财务会计报告

(除特殊注明外，单位：人民币元)

(一)、 资产负债表

		二零零六年十二月三十一日	
项	目	附注	2006年12月31日
资产：			
银行存款			16,281,701.93
清算备付金			6,931,569.23
交易保证金			464,076.34
应收证券清算款			18,494,198.12
应收利息		8(1)	151,504.29
应收申购款			15,916,124.77
其他应收款			0.00
股票投资市值			2,073,872,155.33
其中：股票投资成本			1,638,124,588.37

债券投资市值	126,274,180.00
其中：债券投资成本	126,312,148.84
权证投资	61,695,937.50
其中：权证投资成本	36,566,730.17
买入返售证券	0.00
待摊费用	0.00
其他资产	0.00
资产合计	<u>2,320,081,447.51</u>

负债：

应付证券清算款	0.00
应付赎回款	23,796,341.28
应付赎回费	89,684.84
应付管理人报酬	2,841,115.32
应付托管费	473,519.22
应付佣金	8(3) 3,064,722.55
其他应付款	8(4) 500,000.00
预提费用	8(5) 80,000.00
负债合计	<u>30,845,383.21</u>

所有者权益：

实收基金	8(6)	1,637,980,896.86
未实现利得	8(7)	457,634,489.82
未分配收益		<u>193,620,677.62</u>
持有人权益合计		<u>2,289,236,064.30</u>
负债和所有者权益合计		<u>2,320,081,447.51</u>
基金份额净值		<u>1.3976</u>

(二)、经营业绩表

自二零零六年九月六日（基金合同生效日）至二零零六年十二月三十一日止期间

项 目	附注	2006年9月6日 (基金合同生效日) 至2006年12月31日
收入：		
股票差价收入	8(8)	206,051,200.46
债券差价收入	8(9)	2,816.47
权证差价收入	8(10)	10,700.36
债券利息收入		191,570.31
存款利息收入		1,445,012.39
股利收入		864,879.62
买入返售证券收入		0.00
其他收入	8(11)	1,099,392.56

收入合计		209,665,572.17
费用：		
基金管理人报酬	7(3)	8,977,350.73
基金托管费	7(3)	1,496,225.16
卖出回购证券支出		11,713.97
其他费用	8(12)	180,366.72
其中：信息披露费		90,000.00
审计费用		80,000.00
费用合计		10,665,656.58
基金净收益		198,999,915.59
加：未实现估值增值变动数		460,838,805.45
基金经营业绩		659,838,721.04

(三)、收益分配表

自二零零六年九月六日(基金合同生效日)至二零零六年十二月三十一日止期间

项 目	附注	2006年9月6日 (基金合同生效日) 至2006年12月31日
本期基金净收益		198,999,915.59
加：期初未分配收益		0.00
加：本期申购基金份额的损益平准金		27,489,161.60
减：本期赎回基金份额的损益平准金		32,868,399.57
可供分配基金净收益		193,620,677.62
减：本期已分配基金净收益		0.00
期末基金未分配净收益		193,620,677.62

(四)、净值变动表

自二零零六年九月六日(基金合同生效日)至二零零六年十二月三十一日止期间

项 目	附注	2006年9月6日 (基金合同生效日) 至2006年12月31日
一、期初基金净值		1,684,224,358.17
二、本期经营活动：		
基金净收益		198,999,915.59
未实现估值增值变动数		460,838,805.45
经营活动产生的基金净值变动数		659,838,721.04

三、本期基金单位交易：

基金申购款	750,179,127.45
基金赎回款	-805,006,142.36
基金单位交易产生的基金净值变动数	-54,827,014.91

四、本期向持有人分配收益 0.00

五、期末基金净值 2,289,236,064.30

(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》进行编制及披露。

1. 基金的基本情况

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[2006]第143号

批准核准文件名称：《关于同意华安宏利股票型证券投资基金募集的批复》

基金运作方式：契约型开放式

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

基金备案情况：本基金已于2006年9月6日收到中国证券监督管理委员会基金部函[2006]218号“关于华安宏利股票型证券投资基金备案确认的函”。

基金合同生效日：2006年9月6日

基金合同生效日的基金份额：1,684,224,358.17份

基金募集期间：2006年8月4日至2006年9月1日

募集资金总额：1,683,963,683.51元

募集资金的银行存款利息（折算为投资者的基金份额）：260,674.66元

募集期间相关费用明细及节余：本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司承担，与本基金无关。

验资机构名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

2. 基本会计假设

本会计报表的编制均遵守基本会计假设。

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。

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基



金会计核算办法》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

2) 会计年度。

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期会计报表的实际编制期间为 2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日。

3) 记账本位币。

本基金的记帐本位币为人民币。

4) 记账基础和计价原则。

本基金的记帐基础为权责发生制。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。

(i)股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii)债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

(iii)权证投资

从获赠确认日或买入成交确认日起到卖出成交日或行权日止，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场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

(iv)实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(v)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，基金管理人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) 证券投资基金成本计价方法。

(i)股票投资



买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(ii) 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(iii) 权证投资

获赠权证(包括配股权证)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；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

7) 待摊费用的摊销方法和摊销期限。

待摊费用核算已经发生的、影响基金单位净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用。在实际受益期间(一年内)按直线法摊销，并以实际支出减去累计摊销后的净额列示。

预提费用核算预计将发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应预提计入本期的费用，如信息披露费、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/(损失)的确认和计量。

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算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。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的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于除息日确认。

9) 费用的确认和计量。

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

10) 实收基金。

实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

11) 未实现利得/(损失)。

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

12) 损益平准金。

损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

13) 基金的收益分配政策。

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。本基金收益每年最多分配四次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。基金当期收益先弥补以前年度亏损后，方可进

行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从持有人权益转出。

14) 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。

15) 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。

4. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78 号《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，暂免征营业税和企业所得税。
- 3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4) 基金买卖股票按照 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税。
- 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：

基金管理人于 2007 年 1 月 8 日宣告 2007 年度第一次分红，向截至 2007 年 1 月 15 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体基金份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.80 元。

6. 重大会计差错的内容和更正金额：

无。

7. 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 (“华安基金”)	基金管理人 基金注册登记机构	提取管理费	基金合同



	基金销售机构	
中国建设银行股份有限公司	基金托管人	提取托管费 基金合同
(“建设银行”)	基金代销机构	
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	

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). 与关联方进行的交易

本报告期通过关联人席位的股票成交量：无。

本报告期通过关联人席位的债券、回购和权证成交量：无。

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。

(3). 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 1.5% 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 8,977,350.73 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 0.25% 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 1,496,225.16 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中国建设银行保管，并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 16,281,701.93 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 1,414,010.38 元。



(5). 基金各关联方投资本基金的情况

基金管理公司投资本基金的情况：

本报告期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	0.00	0.00%	0.00	0.00	0.00	0.00%	0.00

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：

本报告期末无。

8. 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
银行存款利息	18,607.00
清算备付金利息	3,119.20
债券利息	129,778.09
买入返售证券利息	0.00
交易保证金利息	0.00
合计	151,504.29

(2). 投资估值增值明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日
股票估值增值余额	435,747,566.96
债券估值增值余额	-37,968.84
权证估值增值余额	25,129,207.33
合计	460,838,805.45

(3). 应付佣金明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日
兴业证券股份有限公司	587,832.72
国泰君安证券股份有限公司	195,919.86
申银万国证券股份有限公司	611,177.89
招商证券股份有限公司	820,388.57
长江证券有限责任公司	620,376.66
中信建投证券有限责任公司	229,026.85
合计	3,064,722.55

(4). 其他应付款明细：

2006 年 12 月 31 日

明细项目

应付券商席位保证金	500,000.00
合计	500,000.00

(5). 预提费用明细： 2006 年 12 月 31 日

明细项目

审计费用	80,000.00
合计	80,000.00

(6). 实收基金变动明细：

2006 年 9 月 6 日

(基金合同生效日)

明细项目

至 2006 年 12 月 31 日

期初数	1,684,224,358.17
加：本期因申购增加数	628,163,229.79
减：本期因赎回减少数	674,406,691.10
期末数	1,637,980,896.86

a) 本基金自 2006 年 8 月 4 日至 2006 年 9 月 1 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 1,683,963,683.51 元。根据《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 260,674.66 元在本基金成立后，折算为 260,674.66 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

b) 根据《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 10 月 25 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2006 年 10 月 26 日起开始办理。

(7). 未实现利得明细：

2006 年 9 月 6 日

(基金合同生效日)

明细项目

至 2006 年 12 月 31 日

期初未实现利得：	0.00
其中：投资估值增值数：	0.00
未实现利得平准金：	0.00
加：本期投资估值增值发生数：	460,838,805.45
加：本期申购的未实现利得平准金：	94,526,736.06
减：本期赎回的未实现利得平准金：	97,731,051.69
期末未实现利得：	457,634,489.82
其中：投资估值增值数：	460,838,805.45

未实现利得平准金：

-3,204,315.63

(8). 卖出股票：

	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,600,917,213.16
减：应付佣金	1,343,802.48
卖出股票成本总额	1,393,522,210.22
股票差价收入	206,051,200.46

(9). 卖出债券：

	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
卖出债券成交总额	8,597,877.65
减：卖出债券成本总额	8,564,864.01
应收利息总额	30,197.17
债券差价收入	2,816.47

(10). 卖出权证：

	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	83,914.64
减：卖出权证成本总额	73,214.28
权证差价收入	10,700.36

(11). 其他收入：

	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
开放式基金赎回费收入(a)	1,006,257.99
基金合同生效前认购资金利息收入	93,134.57

(a)本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金资产。

(12). 其他费用：

	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
信息披露费	90,000.00
审计费用	80,000.00
银行费用	9,466.72
交易所费用	900.00

(13). 收益分配：

	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
收益分配金额	0.00

(14). 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 9 月 6 日 (基金合同生效日)
明细项目	至 2006 年 12 月 31 日
股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额	0.00

9. 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 12 月 31 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(股)	期末成本 总额	期末估值 总额
方案沟通协商阶段停牌：								
600786	S 东锅	2006/12/20	28.90	2007/02/13	30.35	2,289,967	61,846,711.42	66,180,046.30
方案实施阶段停牌：								
600582	S 天地	2006/12/14	24.94	2007/01/15	30.00	999,000	22,004,470.31	24,915,060.00
合计							83,851,181.73	91,095,106.30

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。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下：



股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
002088	鲁阳股份	2006/11/21	2007/02/28	11.00	26.98	38,917	428,087.00	1,049,980.66
002076	雪莱特	2006/10/12	2007/01/25	6.86	18.77	32,558	223,347.88	611,113.66
合 计							651,434.88	1,661,094.32

本基金持有以下因公布重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在所公布的事项的重大影响消除后,并经交易所批准后复牌。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额
600875	东方电机	2006/12/20	27.10	2007/02/05	29.81	2,499,978	51,514,870.72	67,749,403.80

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券列示如下:

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止无流通受限债券。

八、投资组合报告

(一)、报告期末基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	2,073,872,155.33	89.39%
2	债券	126,274,180.00	5.44%
3	权证	61,695,937.50	2.66%
4	银行存款和清算备付金	23,213,271.16	1.00%
5	其它资产	35,025,903.52	1.51%
	合计	2,320,081,447.51	100.00%

(二)、报告期末股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	41,790,000.00	1.83%
B	采掘业	165,338,334.00	7.22%
C	制造业	1,009,346,968.80	44.09%
C0	食品、饮料	86,530,078.40	3.78%
C1	纺织、服装、皮毛	8,982,963.00	0.39%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	174,903,440.90	7.64%
C5	电子	34,439,924.36	1.50%
C6	金属、非金属	304,462,077.80	13.30%
C7	机械、设备、仪表	331,012,744.34	14.46%
C8	医药、生物制品	24,563,540.00	1.07%
C99	其他	44,452,200.00	1.94%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	128,167,990.56	5.60%
F	交通运输、仓储业	430,110,512.98	18.79%



G	信息技术业	251,622,848.99	10.99%
H	批发和零售贸易	3,685,500.00	0.16%
J	房地产业	43,810,000.00	1.91%
合计		2,073,872,155.33	90.59%

(三)、报告期末股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	000039	中集集团	9,699,949	182,747,039.16	7.98%
2	600009	上海机场	6,499,898	122,913,071.18	5.37%
3	600271	航天信息	3,288,000	115,112,880.00	5.03%
4	600428	中远航运	10,580,000	115,004,600.00	5.02%
5	600900	长江电力	11,122,288	108,664,753.76	4.75%
6	600497	驰宏锌锗	1,794,525	101,498,334.00	4.43%
7	600410	华胜天成	3,199,900	79,549,514.00	3.47%
8	000619	海螺型材	9,888,800	74,462,664.00	3.25%
9	600456	宝钛股份	2,280,000	70,680,000.00	3.09%
10	600875	东方电机	2,499,978	67,749,403.80	2.96%
11	600786	S 东锅	2,289,967	66,180,046.30	2.89%
12	600028	中国石化	7,000,000	63,840,000.00	2.79%
13	600269	赣粤高速	6,880,000	58,411,200.00	2.55%
14	000022	深赤湾 A	3,080,848	56,410,326.88	2.46%
15	000778	新兴铸管	8,857,302	48,626,587.98	2.12%
16	600426	华鲁恒升	4,189,918	48,393,552.90	2.11%
17	600050	中国联通	10,000,000	46,700,000.00	2.04%
18	600525	长园新材	1,599,000	44,452,200.00	1.94%
19	600475	华光股份	4,280,080	44,084,824.00	1.93%
20	600309	烟台万华	1,808,800	43,827,224.00	1.91%
21	000402	金融街	2,600,000	43,810,000.00	1.91%
22	600059	古越龙山	2,590,000	42,320,600.00	1.85%
23	000157	中联重科	1,880,000	41,792,400.00	1.83%
24	000829	赣南果业	1,990,000	41,790,000.00	1.83%
25	600887	伊利股份	1,500,000	39,750,000.00	1.74%
26	600787	中储股份	5,180,000	32,375,000.00	1.41%
27	002056	横店东磁	1,506,809	30,136,180.00	1.32%
28	600582	S 天地	999,000	24,915,060.00	1.09%
29	002007	华兰生物	1,067,980	24,563,540.00	1.07%
30	600561	江西长运	3,699,995	23,494,968.25	1.03%
31	600125	铁龙物流	2,599,921	21,501,346.67	0.94%
32	600379	S 宝光	1,870,823	20,335,846.01	0.89%
33	600323	南海发展	2,299,910	19,503,236.80	0.85%
34	000530	大冷股份	3,284,839	18,625,037.13	0.81%
35	600685	广船国际	1,035,623	18,330,527.10	0.80%
36	002009	天奇股份	1,600,000	16,704,000.00	0.73%
37	600268	国电南自	1,180,000	12,295,600.00	0.54%

38	600588	用友软件	339,413	10,260,454.99	0.45%
39	002029	七匹狼	453,685	8,982,963.00	0.39%
40	600636	三爱富	1,000,000	8,220,000.00	0.36%
41	600305	恒顺醋业	398,880	4,459,478.40	0.19%
42	600563	法拉电子	299,970	3,692,630.70	0.16%
43	600697	欧亚集团	350,000	3,685,500.00	0.16%
44	002084	海鸥卫浴	61,000	1,358,470.00	0.06%
45	002088	鲁阳股份	38,917	1,049,980.66	0.05%
46	002076	雪莱特	32,558	611,113.66	0.03%

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% (报告期内基金合同生效的采用期末基金资产净值的 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(元)	占期末基金资产 净值的比例
1	600050	中国联通	196,360,656.97	8.58%
2	600028	中国石化	156,731,247.68	6.85%
3	000039	中集集团	147,154,412.57	6.43%
4	600900	长江电力	139,930,999.63	6.11%
5	600497	驰宏锌锗	118,835,280.70	5.19%
6	600456	宝钛股份	109,738,784.55	4.79%
7	000402	金融街	109,501,689.64	4.78%
8	600009	上海机场	103,507,221.57	4.52%
9	600271	航天信息	100,888,668.05	4.41%
10	000089	深圳机场	98,806,107.07	4.32%
11	600428	中远航运	87,104,099.40	3.80%
12	601398	工商银行	85,692,860.39	3.74%
13	600410	华胜天成	84,197,424.39	3.68%
14	600309	烟台万华	81,277,552.48	3.55%
15	000619	海螺型材	79,366,932.20	3.47%
16	600269	赣粤高速	73,695,356.42	3.22%
17	600636	三爱富	68,921,388.30	3.01%
18	000157	中联重科	64,254,812.04	2.81%
19	600786	S 东锅	61,846,711.42	2.70%
20	600642	申能股份	60,010,292.60	2.62%
21	000022	深赤湾 A	56,075,774.76	2.45%
22	600475	华光股份	53,177,965.10	2.32%
23	600875	东方电机	52,315,758.09	2.29%
24	000778	新兴铸管	47,951,404.35	2.09%
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期末基金资产 净值的比例
1	600050	中国联通	194,676,174.37	8.50%
2	600028	中国石化	143,898,826.07	6.29%
3	000089	深圳机场	120,110,738.85	5.25%



4	000402	金 融 街	108,055,534.85	4.72%
5	601398	工商银行	86,605,054.44	3.78%
6	600900	长江电力	71,623,154.87	3.13%
7	600309	烟台万华	66,376,606.62	2.90%
8	600642	申能股份	62,773,745.46	2.74%
9	600456	宝钛股份	62,656,451.43	2.74%
10	600636	三爱富	61,961,446.31	2.71%
11	000157	中联重科	53,353,269.26	2.33%
12	600886	国投电力	42,934,658.48	1.88%
13	000538	云南白药	40,002,259.93	1.75%
14	600497	驰宏锌锗	39,725,846.89	1.74%
15	600761	安徽合力	36,920,396.11	1.61%
16	600269	赣粤高速	34,043,148.12	1.49%
17	600087	南京水运	32,702,973.10	1.43%
18	600268	国电南自	30,830,767.69	1.35%
19	000792	盐湖钾肥	29,270,521.05	1.28%
20	000039	中集集团	27,785,795.38	1.21%

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 [*] ：	3,031,646,798.59
卖出股票的收入总额：	1,600,917,213.16

^{*}注：买入股票的成本总额未扣减股权分置获得的现金对价 0.00 元。

(五)、报告期末债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	17,086,700.00	0.75%
2	金融债券	109,187,480.00	4.77%
3	企业债券	0.00	0.00%
4	央行票据	0.00	0.00%
5	可转换债券	0.00	0.00%
	合计	126,274,180.00	5.52%

(六)、报告期末前五名债券明细

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	050218	05 国开 18	800,000	79,203,440.00	3.46%
2	060302	06 进出 02	300,000	29,984,040.00	1.31%
3	010010	20 国债	170,000	17,086,700.00	0.75%

(七)、报告期末权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	市值(元)	占资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	2,427,955	35,205,347.50	1.54%
2	580005	万华 HXB1	1,190,000	26,490,590.00	1.16%

(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(元)
1	深交所交易结算保证金	464,076.34
2	上海权证担保金	0.00
3	深圳权证担保金	0.00
4	应收证券清算款	18,494,198.12
5	应收股利	0.00
6	应收利息	151,504.29
7	应收基金申购款	15,916,124.77
	合计	35,025,903.52

4、处于转股期的可转换债券明细

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

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(元)	获得途径
----	------	------	-------	---------	------



1	580005	万华 HXB1	1,195,650	15,493,567.72	主动投资
2	030002	五粮 YGC1	2,427,955	21,146,376.73	主动投资

九、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	32,784	
平均每户持有基金份额	49,962.81	
机构投资者持有的基金份额	531,201,168.65	32.43%
个人投资者持有的基金份额	1,106,779,728.21	67.57%

十、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	1,684,224,358.17
期初基金份额总额	1,684,224,358.17
加：本期申购基金份额总额	628,163,229.79
减：本期赎回基金份额总额	674,406,691.10
期末基金份额总额	1,637,980,896.86

十一、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 14 日, 本基金管理人发布关于基金经理调整的公告, 经华安基金管理公司董事会审议批准, 增聘陈俏宇女士为安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理, 尚志民先生仍继续担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。以上聘任的基金经理均无被监管机构予以行政处分或行政监管情况。

(7). 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如下:

2006 年 7 月 27 日, 中国建设银行股份有限公司董事会召开会议, 通过了委任张建国先生担任中国建设银行行长的议案; 2006 年 10 月 20 日, 中国建设银行股份有限公司举行 2006 年第一次临时股东大会, 委任张建国先生为建行执行董事, 同时出任副董事长。2006 年 7 月, 常振明先生辞任建行副董事长、执行董事及行长的职务。

(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: 无。

(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。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况如下: 80,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限: 自基金合同生效日起至今。

(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: 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(元)	占总成交量比例	佣金(元)	占总佣金比例
------	--------	--------	---------	-------	--------

兴业证券股份有限公司	1	1,203,544,408.37	26.23%	986,901.01	26.59%
国泰君安证券股份有限公司	1	421,362,896.47	9.18%	329,717.79	8.88%
申银万国股份有限公司	1	927,269,726.07	20.21%	725,593.75	19.55%
招商证券股份有限公司	1	1,000,474,493.39	21.80%	820,388.57	22.10%
长江证券有限责任公司	1	756,596,695.84	16.49%	620,376.66	16.71%
中信建投证券有限责任公司	1	279,684,387.24	6.09%	229,026.85	6.17%
合 计	6	4,588,932,607.38	100.00%	3,712,004.63	100.00%

(2). 债券、回购及权证交易情况：

券商名称	债券成交量（元）	占总成交 总量比例	回购成交量 （元）	占总成交 总量比例	权证成交量（元）	占总成交 总量比例
兴业证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	14,326,570.26	39.02%
国泰君安证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	21,144,262.28	57.58%
招商证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	1,249,717.88	3.40%
长江证券有限责任公司	3,027,664.30	8.84%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信建投证券有限责任公司	31,228,690.00	91.16%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合 计	34,256,354.30	100.00%	0.00	0.00%	36,720,550.42	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) 其他事项：

1. 基金成立及分红事项：

公告事项	披露日期
1) 华安基金管理有限公司关于华安宏利股票型证券投资基金基金合同生效公告。	2006 年 9 月 7 日
2) 华安基金管理有限公司关于华安宏利股票型证券投资基金开通基金转换业务的公告。	2006 年 10 月 21 日
3) 华安基金管理有限公司关于华安宏利股票型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告。	2006 年 10 月 21 日
4) 华安基金管理有限公司关于华安宏利股票型证券投资基金第一次分红公告, 每 10 份基金份额派发现金红利 0.80 元。	2007 年 1 月 8 日

2. 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旗下华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金在交通银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告。	2006 年 11 月 1 日
2) 华安基金管理有限公司关于华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金在中信建投证券有限责任公司开展网上申购费率优惠活动的公告。	2007 年 1 月 9 日
3) 华安基金管理有限公司关于新增渤海证券有限责任公司为华安宏利股票型证券投资基金代销机构的公告。	2007 年 3 月 16 日

前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上披露。

3. 2006 年 12 月 28 日, 中国建设银行股份有限公司根据工作需要, 将“基金托管部”更名为“投资托管服务部”。



十二、备查文件目录

- 1、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宏利股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宏利股票型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
2007 年 3 月 31 日