



华安 MSCI 中国 A 股指数增强型 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：中国工商银行股份有限公司

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.....	5
	（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）、 基金管理人及基金经理简介.....	7
	（二） 基金运作合规性声明.....	7
	（三） 基金经理工作报告.....	8
	（四） 基金内部监察报告.....	10
五、	托管人报告.....	10
六、	审计报告.....	11
七、	财务会计报告.....	12
	（一） 资产负债表.....	12
	（二） 经营业绩表.....	13
	（三） 收益分配表.....	14
	（四） 净值变动表.....	14
	（五） 会计报表附注.....	14
八、	投资组合报告.....	23
	（一） 基金资产组合.....	23
	（二） 股票投资组合.....	24
	（三） 股票明细.....	24
	（四） 报告期内股票投资组合的重大变动.....	30
	（五） 债券投资组合.....	31
	（六） 前五名债券明细.....	31
	（七） 权证投资组合.....	31
	（八） 前五名权证明细.....	32
	（九） 投资组合报告附注.....	32
九、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	33
十、	开放式基金份额变动.....	33
十一、	重大事件.....	34
十二、	备查文件目录.....	39

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。

基金托管人中国工商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、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

二、基金产品概况

(一)、基金概况

基金名称:	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
基金简称:	华安中国 A 股
交易代码:	040002
深交所行情代码	160402
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2002 年 11 月 8 日
期末基金份额总额:	520,760,979.21 份
基金存续期:	不定期

(二)、基金的投资

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

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

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



使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。

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

业绩比较基准：

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

风险收益特征：

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

(三)、 基金管理人

基金管理人：	华安基金管理有限公司
注册地址：	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼
办公地址：	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 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：	40088-50099、021-68604666

(四)、 基金托管人

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

(五)、信息披露

信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址：<http://www.huaan.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：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

(单位：人民币元)

提示：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一)、主要财务指标

财务指标	2006 年度	2005 年度	2004 年度
基金本期净收益	416,895,175.52 元	22,753,380.83 元	34,272,305.09 元
基金份额本期净收益	0.4589 元	0.0111 元	0.0239 元
期末可供分配基金收益	262,311,066.23 元	-197,484,404.31 元	-195,018,632.32 元
期末可供分配基金份额收益	0.5037 元	-0.1142 元	-0.1092 元
期末基金资产净值	979,872,398.98 元	1,531,760,051.11 元	1,591,321,034.13 元
期末基金份额净值	1.882 元	0.886 元	0.891 元
基金加权平均净值收益率	39.36%	1.28%	2.46%
本期基金份额净值增长率	121.21%	-0.56%	-8.90%
基金份额累计净值增长率	119.55%	-0.75%	-0.19%

(二)、净值表现

A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

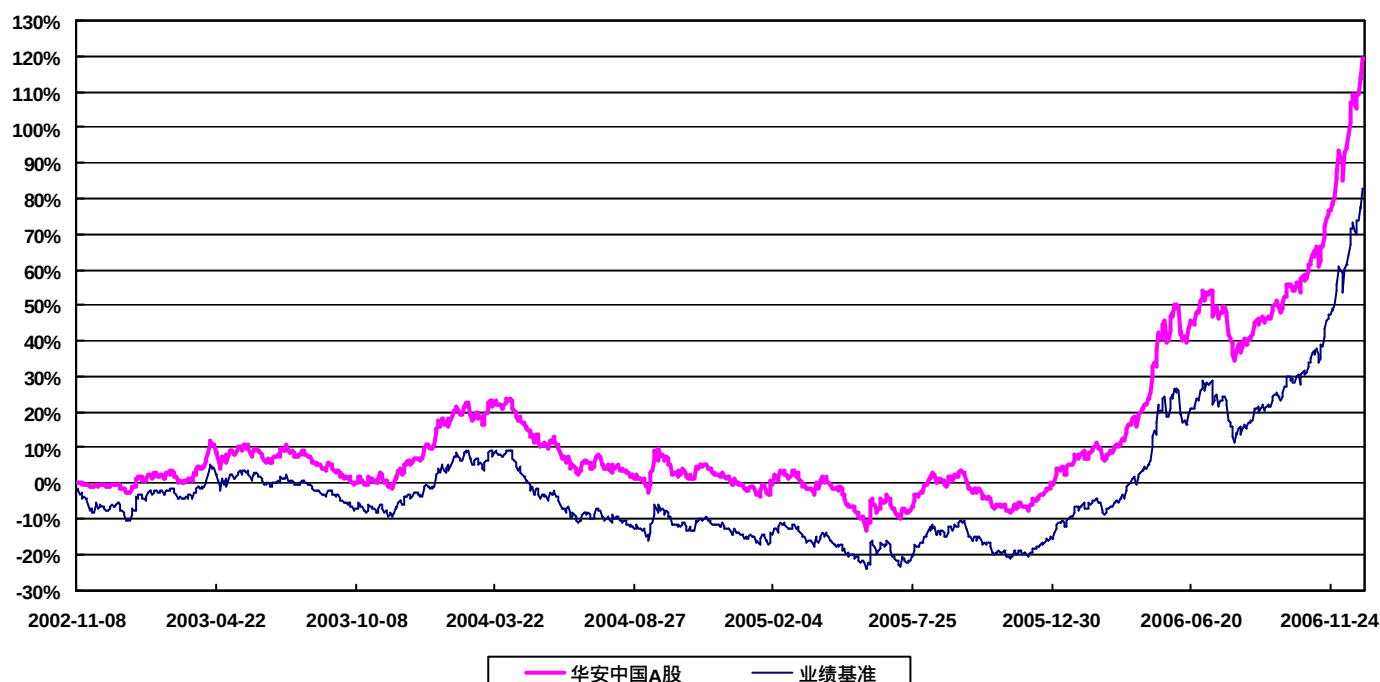
阶段	净值 增长率	净值增长率 标准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较基 准收益率标 准差	-	-
三个月	43.88%	1.33%	43.30%	1.34%	0.58%	-0.01%
六个月	44.77%	1.32%	44.05%	1.33%	0.72%	-0.01%
一年	121.21%	1.29%	116.27%	1.32%	4.94%	-0.03%
三年	100.39%	1.15%	85.30%	1.17%	15.09%	-0.02%
自基金合同	119.55%	1.06%	82.86%	1.10%	36.69%	-0.04%

生效起至今

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

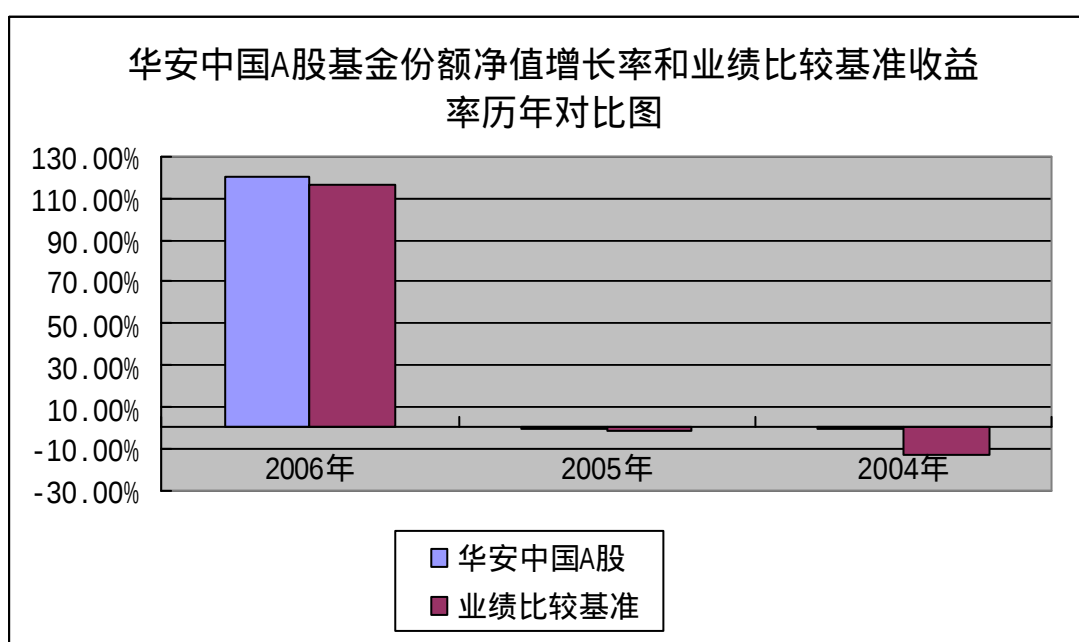
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华安MSCI中国A股份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图
2002/11/8--2006/12/31



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



(三)、基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2006 年度	0.500 元	
2005 年度	未分配	
2004 年度	0.500 元	

四、管理人报告

(一)、基金管理人及基金经理简介

1. 基金管理人

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

截至 2006 年 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。

(1) 基金经理

刘光华 先生：MBA，8 年银行、基金从业经历。曾在中国农业银行上海市分行国际业务部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、基金投资部基金经理助理。现任华安 MSCI 中国 A 股指数基金经理、上证 180ETF 基金经理。

(二)、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金合同》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，

不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

（三）、基金经理工作报告

2006 年回顾

过去的一年是我国 A 股市场大发展的一年。06 年，上证 180 指数上涨 120.62%，MSCI 中国 A 股指数上涨 123.28%，本基金的比较基准增长 116.27%，基金净值一年增长 121.21%，全年基金净值表现超越比较基准 4.94 个百分点。06 年 12 月底，华安 MSCI 基金的跟踪偏离度为 0.1243%。6 月份，本基金实施了现金分红，每份额分配 0.05 元。

06 年的 A 股市场行情可谓波澜壮阔，主要指数均出现了翻番的上涨，两市有 42 只个股年度涨幅超过了 300%。如果说，上半年的上涨，有部分贡献来自于股改支付对价；则从 8 月份开始的下半年行情，是一种更彻底的牛市表现。

分析本轮牛市，有两点是贯穿其中的主线。其一是人民币持续升值。虽然 06 年全年，人民币对美元的升值幅度只有 3%；但自 05 年 7 月以来，这种升值的趋势基本没有改变。而且，在美元对人民币汇率叠创新低的过程中，境内外机构对于本币继续升值的预期有增无减。本币升值一方面会增加人民币资产对境外投资者的吸引力，如 QFII 额度供不应求即是例证；另一方面，由升值预期所引发的资金流入在增加国家外汇储备的同时，也导致了国内的流动性过剩。其二是宏观经济和企业盈利强劲增长。06 年我国 GDP 增速达到了 10.7%，为连续第四年实现了两位数的较快增长，且增速呈上升的态势。稳定增长的宏观经济为微观层面的企业活动提供了良好的运行环境，06 年全国规模以上工业企业实现利润同比增长高达 31%。A 股上市公司自二季度开始，扭转了净利润总额同比负增长的不利形势，且在三季度，盈利继续保持较快增长。

06 年本基金变更了跟踪的标的指数。1 月中旬，我们发布公告，经持有人大会审议通过，标的指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。其后，我们进行了组合的调整，主要是减持了沪市的成份股，同时新增了在深市的成份股配置。至 2 月底，组合调整基本完成。下面的 2 个表分别列出了本基金变更标的指数前后的表现、及 06 年度与以前年度表现的比较。

附表：

变更标的指数前后基金的表现

	2006/1/1-2006/1/13	2006/1/16-2006/12/31
标的指数	5.64%	110.77%
比较基准	5.36%	105.28%
本基金净值	4.85%	110.97%
本基金超越比较基准	-0.51%	5.69%

本基金年度表现

	03 年	04 年	05 年	06 年
标的指数	10.95%	-16.50%	-8.27%	122.65%
比较基准	8.17%	-13.41%	-1.80%	116.27%
本基金净值	11.46%	-8.90%	-0.56%	121.21%
本基金超越比较基准	3.29%	4.51%	1.24%	4.94%

(1) 2005/6/7 之前，比较基准为：75%*上证 180 指数收益率+25%*中信国债指数收益率

(2) 2005/6/8 至 2006/1/13，比较基准为：95%*上证 180 指数收益率+5%*金融同业存款利率

(3) 2006/1/16 开始，比较基准为：95%*MSCI 中国 A 股指数收益率+5%*金融同业存款利率

在 06 年我们连续第四年超越比较基准，当年超越的幅度为 4.94 个百分点，是基金成立以来超额收益最大的一年。这主要是得益于变更标的指数后，成份股的覆盖面更广，基金经理运用适度增强的策略，在成份股内部进行权重再分配时的可选范围增大；同时，06 年的大幅上涨行情也给增强操作提供了空间。

2007 年展望

经历了 06 年的上涨，一个不争的事实是，A 股市场整体的静态估值水平已不便宜。从动态的角度看，导致市场整体盈利状况改善的因素包括：1) 已有上市公司通过自身经营实现盈利的增长。2) 新的 IPO，如海外上市的大型蓝筹公司回归 A 股将大幅改变 A 股的盈利结构及估值水平。3) 已有上市公司因资产注入、集团整体上市、或者公司主业发生重组等而出现盈利跳跃式增长。

我们判断，在人民币升值预期依然强烈、宏观经济继续保持较快发展速度



的背景下，我国资本市场未来的发展空间是很大的。储蓄资金通过基金向资本市场流动的通道已经形成，在这样的形势下，对优质上市公司的需求将变得更为迫切。估计在 07 年，海外上市蓝筹公司回归 A 股的数量和规模都将创记录。

本基金作为增强型指数基金，在 06 年给持有人带来了较好的绝对收益和相对收益。我们相信在 07 年，MSCI 中国 A 股指数成份股的构成将继续得到改善，而随着以蓝筹公司为主体的成份股结构的完善，指数化投资的基础将更扎实，给基金持有人的回报也将更持续。

（四）、基金内部监察报告

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年度，本基金托管人在对华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2006年度，华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的管理人 - 华安基金管理有限公司在华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在2006年度所编制和披露的华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金年度中财务指标、净值表现、收益分配等情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

六、 审计报告

普华永道中天审字(2007)第20207号

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金(原名为华安上证180指数增强型证券投资基金)全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金(原名为华安上证180指数增强型证券投资基金,以下简称“华安MSCI中国A股指数基金”)2006年12月31日的资产负债表以及2006年度的经营业绩表和基金净值变动表。

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MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金合同》及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MSCI中国A股指数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国家颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金合同》及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MSCI中国A股指数基金2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动。

普华永道中天 注册会计师 汪 棣
会计师事务所有限公司

中国·上海市 注册会计师 陈 宇
2007 年 2 月 28 日

七、 财务会计报告

(一)、 资产负债表

项 目	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产：			
银行存款		31,465,578.91	100,068,029.25
清算备付金		1,540,769.69	1,177,468.18
交易保证金		500,000.00	250,000.00
应收证券清算款		9,598,145.96	941,937.69
应收利息	(1)	825,957.13	39,097.59
应收申购款		4,496,097.80	733,235.21
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		908,489,488.84	1,437,589,520.84
其中：股票投资成本		540,784,096.72	1,497,628,178.11
债券投资市值		30,024,000.00	0.00
其中：债券投资成本		30,024,000.00	0.00
权证投资市值		0.00	0.00
其中：权证投资成本		0.00	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		986,940,038.33	1,540,799,288.76
负债：			
应付证券清算款		0.00	257,683.28
应付赎回款		4,208,475.04	6,026,588.91

应付管理人报酬		796,649.86	1,435,385.31
应付托管费		159,329.96	287,077.06
应付佣金	(3)	1,303,184.49	682,503.09
其他应付款	(4)	500,000.00	250,000.00
预提费用	(5)	100,000.00	100,000.00
负债合计		<u>7,067,639.35</u>	<u>9,039,237.65</u>

所有者权益：

实收基金	(6)	520,760,979.21	1,729,244,455.42
未实现利得	(7)	196,800,353.54	-214,937,733.70
未分配收益		262,311,066.23	17,453,329.39
持有人权益合计		<u>979,872,398.98</u>	<u>1,531,760,051.11</u>
负债和所有者权益合计		<u>986,940,038.33</u>	<u>1,540,799,288.76</u>

(二)、 经营业绩表

项 目	附注	2006年度	2005年度
收入：			
股票差价收入	(8)	382,435,439.41	-25,264,549.43
债券差价收入	(9)	165,222.99	10,272,145.64
权证差价收入	(10)	26,876,189.64	14,126,617.52
债券利息收入		322,083.30	5,750,004.48
存款利息收入		658,797.30	1,139,429.58
股利收入		19,932,472.97	39,034,773.59
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	(11)	2,559.00	11,954.43
收入合计		<u>430,392,764.61</u>	<u>45,070,375.81</u>
费用：			
基金管理人报酬		10,666,849.16	17,774,931.83
基金托管费		2,133,369.87	3,554,986.34
卖出回购证券支出		273,161.99	505,671.60
其他费用	(12)	424,208.07	481,405.21
其中：信息披露费		300,000.00	340,000.00
审计费用		100,000.00	100,000.00
费用合计		<u>13,497,589.09</u>	<u>22,316,994.98</u>
基金净收益		<u>416,895,175.52</u>	<u>22,753,380.83</u>
加：未实现估值增值变动数		427,744,049.39	23,257,989.37
基金经营业绩		<u>844,639,224.91</u>	<u>46,011,370.20</u>

(三)、 收益分配表

项 目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		416,895,175.52	22,753,380.83
加：期初未分配收益		17,453,329.39	-742,002.92
加：本期申购基金单位的损益平准金		88,834,876.86	16,506,266.20
减：本期赎回基金单位的损益平准金		224,252,687.99	21,064,314.72
可供分配基金净收益		298,930,693.78	17,453,329.39
减：本期已分配基金净收益	(13)	36,619,627.55	0.00
期末基金未分配净收益		262,311,066.23	17,453,329.39

(四)、 净值变动表

项 目	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		1,531,760,051.11	1,591,321,034.13
二、本期经营活动：			
基金净收益		416,895,175.52	22,753,380.83
未实现估值增值变动数		427,744,049.39	23,257,989.37
经营活动产生的基金净值变动数		844,639,224.91	46,011,370.20
三、本期基金单位交易：			
基金申购款		985,459,940.89	2,719,547,584.52
基金赎回款		-2,345,367,190.38	-2,825,119,937.74
基金单位交易产生的基金净值变动数		-1,359,907,249.49	-105,572,353.22
四、本期向持有人分配收益	(13)	-36,619,627.55	0.00
五、期末基金净值		979,872,398.98	1,531,760,051.11

(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。

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[2002]第70号

核准文件名称：关于同意华安上证180指数增强型证券投资基金设立的批复

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：中国工商银行股份有限公司

基金备案情况：本基金在成立后已向中国证券监督管理委员会进行了备案

基金合同生效日：2002年11月8日

基金合同生效日的基金份额：3,094,001,262份

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

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 MSCI 中国 A 股指数增强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

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。

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进行估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价计算所得的净价估值。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。

从获赠确认日起到卖出日或行权日止，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场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资按公允价值估值。

因持有股票而享有的配股权，从配股除权日起到配股确认日止，按估值日在



证券交易所挂牌的该股票的市场交易收盘价高于配股价的差额估值,计入“配股权证”科目。若市场交易收盘价低于配股价,则估值为零。

实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(6) 证券投资基金成本计价方法

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。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价时冲减股票投资成本。

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。

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。

买入央行票据和零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。

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。

分离交易可转债投资

认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,按权证公允价值占分离交易可转债及取得权证的全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本,并相应调整债券投资成本。

(7) 待摊费用、预付费用的摊销方法和摊销期限。

待摊费用核算已经发生的、影响基金份额净值小数点后第五位,应分摊计入本期和以后各期的费用,如信息披露费、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、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) 收入的确认和计量

股票差价收入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于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入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，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。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

（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 1.0% 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 0.2% 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。每份基金份额面值为 1.00 元。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）基金的收益分配原则

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，但投资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。

红利分配时所发生的银行转账或其他手续费应由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费时，基金注



册与过户登记人可将投资者的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，四舍五入，保留至 0.01 份。

基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益不分配。

基金当期收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金当年亏损，则不进行收益分配。

基金收益分配后，每基金份额净值不能低于面值。

(14) 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 号文《财政部 国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税[2005]102 号文《财政部 国家税务总局关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《财政部 国家税务总局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：

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。

基金买卖股票、债券的差价收入，暂免征收营业税。

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(2003 年：在年底前暂免征收企业所得税)。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，自 2005 年 6 月 13 日起由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% (此前按 100%) 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。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。

基金买卖股票于 2005 年 1 月 24 日前按照 0.2% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2005 年 1 月 24 日起减按 0.1% 的税率缴纳。

4. 重大会计差错的内容和更正金额

无。

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	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构	提取管理费	基金合同
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构	提取托管费 银行间债券 买卖	基金合同 银行间成 交合同
上海国际信托投资有限公司 上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东 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). 通过关联方席位进行的交易

本报告期本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券和回购交易。

上年度本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券和回购交易。

(3). 本报告期与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

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

本基金与关联人 2005 年末进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(4). 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 1.0% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% \div \text{当年天数}$$

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 10,666,849.16 元。(上年度：17,774,931.83 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 0.20% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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 2,133,369.87 元。(上年度：3,554,986.34 元)

(5). 本基金各关联方投资本基金的情况：

本基金的管理公司本期末未持有本基金份额，本报告期内持有本基金份额没有发生变化。

本基金的基金管理公司主要股东及其控制的机构 2006 年度和 2005 年度均无投资本基金的情况。

(6). 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，自 2005 年 3 月 17 日起按银行活期利率计算，此前按银行同业利率计算。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 31,465,578.91 元 (2005 年：100,068,029.25 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 637,929.65 元 (2005 年：1,094,622.10 元)。

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	14,277.53	38,567.69
债券利息	810,986.30	0.00
清算备付金利息	693.30	529.90
合计	825,957.13	39,097.59

(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	367,705,392.12	-60,038,657.27
债券估值增值余额	0.00	0.00
合计	367,705,392.12	-60,038,657.27

(3). 应付佣金明细：

明细项目	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
宏源证券股份有限公司	111,441.94	60,340.99
中信证券股份有限公司	59,785.68	0.00
招商证券股份有限公司	114,542.52	33,838.60
申银万国证券股份有限公司	37,267.13	0.00
中国银河证券股份有限公司	154,975.77	7,430.71
国泰君安证券股份有限公司	0.00	0.00
国金证券有限责任公司	699,626.18	403,698.12
广发证券股份有限公司	125,545.27	177,194.67
中信建投证券有限责任公司	0.00	0.00
合计	1,303,184.49	682,503.09

(4). 其他应付款明细：

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
席位保证金	500,000.00	250,000.00

合计	500,000.00	250,000.00
----	------------	------------

(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	0.00	0.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
合计	100,000.00	100,000.00

(6). 实收基金变动明细：	2006 年	2005 年
明细项目		
期初数	1,729,244,455.42	1,786,339,666.45
加：本期因申购增加数	907,551,849.24	3,127,574,654.88
减：本期因赎回减少数	2,116,035,325.45	3,184,669,865.91
期末数	520,760,979.21	1,729,244,455.42

(7). 未实现利得明细：	2006 年	2005 年
明细项目		
期初未实现利得：	-214,937,733.70	-194,276,629.40
其中：投资估值增值数：	-60,038,657.27	-83,296,646.64
未实现利得平准金：	-154,899,076.43	-110,979,982.76
本期投资估值增值发生数：	427,744,049.39	23,257,989.37
本期申购的未实现利得平准金：	-10,926,785.21	-424,533,336.56
减：本期赎回的未实现利得平准金：	5,079,176.94	-380,614,242.89
期末未实现利得：	196,800,353.54	-214,937,733.70
其中：投资估值增值数：	367,705,392.12	-60,038,657.27
未实现利得平准金：	-170,905,038.58	-154,899,076.43

(8). 卖出股票：	2006 年	2005 年
明细项目		
卖出股票成交总额	2,755,751,099.46	2,247,724,239.88
减：佣金	2,318,136.09	1,888,643.02
成本总额	2,370,997,523.96	2,271,100,146.29
股票差价收入	382,435,439.41	-25,264,549.43

(9). 卖出债券：	2006 年	2005 年
明细项目		



卖出及到期兑付债券结算金额	61,986,806.50	1,115,693,517.06
减：卖出及到期兑付债券成本总额	61,452,044.33	1,088,947,235.91
应收利息总额	369,539.18	16,474,135.51
债券差价收入	165,222.99	10,272,145.64

(10). 卖出权证：

明细项目	2006 年	2005 年
卖出权证成交金额	27,195,944.23	14,126,617.52
减：卖出权证成本总额	319,754.59	0.00
权证差价收入	26,876,189.64	14,126,617.52

(11). 其他收入：

明细项目	2006 年	2005 年
新股、配股手续费返还	2,559.00	11,954.43
债券认购手续费返还	0.00	0.00
认购债券资金利息返还	0.00	0.00
合计	2,559.00	11,954.43

(12). 其他费用：

明细项目	2006 年	2005 年
信息披露费	300,000.00	340,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
债券托管账户维护费	19,530.00	34,976.90
交易所回购交易费用	0.00	2,428.31
其他	4,678.07	4,000.00
合计	424,208.07	481,405.21

(13). 基金收益分配：

	分红公告日	权益登记日	除息日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配金额
本期分红	2006-6-2	2006-6-13	2006-6-13	0.50 元	36,619,627.55
本期累计收益分配金额					36,619,627.55

(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	2005 年
明细项目		
股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额	7,076,645.24	9,974,258.96

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：

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	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
方案沟通协商阶段停牌：								
000423	S 阿 胶	06/12/04	13.69	未知	未知	205,100	1,104,602.56	2,807,819.00
600786	S 东 锅	06/12/20	28.90	07/02/13	30.35	60,000	1,076,760.39	1,734,000.00
000731	S 川美丰	06/12/11	12.15	07/01/15	12.76	100,000	856,710.02	1,215,000.00
000554	S 泰石油	06/12/06	5.81	07/02/12	6.10	177,162	694,094.29	1,029,311.22
方案实施阶段停牌：								
000661	S 长高新	06/12/19	5.80	07/01/19	6.70	497,508	2,802,066.38	2,885,546.40
000549	S 湘火炬	06/12/19	8.90	未知	未知	250,000	825,040.14	2,225,000.00
合计							7,359,273.78	11,896,676.62

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止持有以下获配的新股，不能自由转让。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。

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	期末成本总额	期末估值总额
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	30,000	566,400.00	566,400.00

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

八、投资组合报告

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额	占基金总资产比例
1	股票	908,489,488.84	92.05%
2	债券	30,024,000.00	3.04%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款和清算备付金合计	33,006,348.60	3.34%
5	其他资产	15,420,200.89	1.56%
	合计	986,940,038.33	100.00%

(二)、 股票投资组合

1、 指数投资按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	1,779,000.00	0.18%
B 采掘业	49,068,643.75	5.00%
C 制造业	370,542,604.62	37.82%
C0 食品、饮料	68,367,923.26	6.98%
C1 纺织、服装、皮毛	8,596,588.90	0.88%
C3 造纸、印刷	5,627,186.40	0.57%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	38,909,548.58	3.97%
C5 电子	8,966,122.03	0.92%
C6 金属、非金属	132,661,741.25	13.54%
C7 机械、设备、仪表	84,958,086.35	8.67%
C8 医药、生物制品	20,682,827.50	2.11%
C99 其他制造业	1,772,580.35	0.18%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	48,066,629.06	4.91%
E 建筑业	3,574,644.38	0.36%
F 交通运输、仓储业	59,244,663.45	6.05%
G 信息技术业	60,293,235.57	6.15%
H 批发和零售贸易	35,945,898.89	3.67%
I 金融、保险业	160,541,200.00	16.38%
J 房地产业	55,934,400.96	5.71%
K 社会服务业	17,124,622.82	1.75%
L 传播与文化产业	8,224,700.00	0.84%
M 综合类	28,982,298.94	2.96%
合计	899,322,542.44	91.78%

2、 积极投资按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占资产净值比例
C 制造业	2,885,546.40	0.29%
C8 医药、生物制品	2,885,546.40	0.29%
F 交通运输、仓储业	5,715,000.00	0.58%
I 金融、保险业	566,400.00	0.07%
合计	9,166,946.40	0.94%

(三)、 股票明细

1. 指数型投资

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	4,150,000	67,894,000.00	6.93%
2	600016	民生银行	2,950,000	30,090,000.00	3.07%
3	000002	万 科 A	1,900,000	29,336,000.00	2.99%
4	600050	中国联通	5,200,000	24,284,000.00	2.48%
5	600019	宝钢股份	2,500,000	21,650,000.00	2.21%
6	600000	浦发银行	900,000	19,179,000.00	1.96%
7	600900	长江电力	1,950,000	19,051,500.00	1.94%
8	600519	贵州茅台	200,000	17,566,000.00	1.79%
9	600028	中国石化	1,900,000	17,328,000.00	1.77%
10	000858	五 粮 液	720,000	16,452,000.00	1.68%
11	600009	上海机场	750,000	14,182,500.00	1.45%
12	600030	中信证券	450,000	12,321,000.00	1.26%
13	600005	武钢股份	1,900,000	12,084,000.00	1.23%
14	000039	中集集团	550,000	10,362,000.00	1.06%
15	601988	中国银行	1,850,000	10,045,500.00	1.03%
16	000792	盐湖钾肥	410,000	9,659,600.00	0.99%
17	000001	S 深发展 A	650,000	9,405,500.00	0.96%
18	000895	S 双 汇	300,000	9,351,000.00	0.95%
19	000898	鞍钢股份	900,000	9,180,000.00	0.94%
20	000069	华侨城 A	411,400	9,054,914.00	0.92%
21	000063	中兴通讯	219,500	8,582,450.00	0.88%
22	600320	振华港机	700,000	8,232,000.00	0.84%
23	600015	华夏银行	1,100,000	8,129,000.00	0.83%
24	002024	苏宁电器	170,000	7,718,000.00	0.79%
25	000402	金 融 街	450,000	7,582,500.00	0.77%
26	000825	太钢不锈	572,859	7,481,538.54	0.76%
27	600104	上海汽车	900,000	7,353,000.00	0.75%
28	600694	大商股份	250,000	7,347,500.00	0.75%
29	600309	烟台万华	300,000	7,269,000.00	0.74%
30	600383	金地集团	390,000	7,207,200.00	0.74%
31	600037	歌华有线	280,000	6,960,800.00	0.71%
32	600583	海油工程	200,000	6,934,000.00	0.71%
33	600887	伊利股份	250,000	6,625,000.00	0.68%
34	600428	中远航运	600,000	6,522,000.00	0.67%
35	600271	航天信息	180,000	6,301,800.00	0.64%
36	000793	华闻传媒	677,700	6,112,854.00	0.62%
37	000878	云南铜业	550,000	6,011,500.00	0.61%
38	000568	泸州老窖	228,444	5,788,770.96	0.59%
39	600832	东方明珠	459,538	5,252,519.34	0.54%
40	000839	中信国安	230,000	5,246,300.00	0.54%
41	600881	亚泰集团	700,000	4,753,000.00	0.49%
42	600177	雅戈尔	520,645	4,592,088.90	0.47%
43	600585	海螺水泥	150,000	4,500,000.00	0.46%

44	000401	冀东水泥	900,000	4,491,000.00	0.46%
45	000983	西山煤电	500,000	4,475,000.00	0.46%
46	600026	中海发展	430,000	4,450,500.00	0.45%
47	600761	安徽合力	200,000	4,450,000.00	0.45%
48	600660	福耀玻璃	300,000	4,431,000.00	0.45%
49	000060	中金岭南	250,000	4,332,500.00	0.44%
50	600600	青岛啤酒	300,000	4,167,000.00	0.43%
51	600011	华能国际	638,140	4,116,003.00	0.42%
52	600276	恒瑞医药	126,118	4,068,566.68	0.42%
53	601006	大秦铁路	500,000	4,050,000.00	0.41%
54	600123	兰花科创	200,000	3,966,000.00	0.40%
55	000778	新兴铸管	700,000	3,843,000.00	0.39%
56	600839	四川长虹	900,000	3,798,000.00	0.39%
57	000528	柳 工	221,800	3,792,780.00	0.39%
58	000157	中联重科	170,000	3,779,100.00	0.39%
59	600642	申能股份	506,038	3,699,137.78	0.38%
60	600690	青岛海尔	400,000	3,688,000.00	0.38%
61	600631	百联股份	381,387	3,626,990.37	0.37%
62	600795	国电电力	582,300	3,592,791.00	0.37%
63	600717	天津港	400,000	3,564,000.00	0.36%
64	600879	火箭股份	230,000	3,539,700.00	0.36%
65	600269	赣粤高速	415,000	3,523,350.00	0.36%
66	600308	华泰股份	256,004	3,489,334.52	0.36%
67	000625	长安汽车	390,000	3,478,800.00	0.36%
68	600089	特变电工	230,000	3,438,500.00	0.35%
69	600001	邯郸钢铁	785,860	3,426,349.60	0.35%
70	600497	驰宏锌锗	60,000	3,393,600.00	0.35%
71	000933	神火股份	300,000	3,363,000.00	0.34%
72	000709	唐钢股份	600,000	3,360,000.00	0.34%
73	000623	吉林敖东	100,000	3,310,000.00	0.34%
74	000651	格力电器	275,000	3,264,250.00	0.33%
75	000088	盐 田 港	350,000	3,209,500.00	0.33%
76	000089	深圳机场	500,000	3,200,000.00	0.33%
77	000680	山推股份	390,000	3,190,200.00	0.33%
78	600010	包钢股份	1,000,000	3,120,000.00	0.32%
79	000912	泸 天 化	390,000	3,100,500.00	0.32%
80	600415	小商品城	40,000	3,100,000.00	0.32%
81	600350	山东高速	700,000	3,059,000.00	0.31%
82	600153	建发股份	370,000	3,030,300.00	0.31%
83	000538	云南白药	120,548	3,000,439.72	0.31%
84	000629	新 钢 钒	700,000	2,996,000.00	0.31%
85	600628	新世界	280,000	2,940,000.00	0.30%
86	000024	招商地产	102,067	2,896,661.46	0.30%

87	600008	首创股份	500,000	2,875,000.00	0.29%
88	000652	泰达股份	500,000	2,845,000.00	0.29%
89	000423	S 阿 胶	205,100	2,807,819.00	0.29%
90	600663	陆家嘴	200,000	2,776,000.00	0.28%
91	600895	张江高科	400,000	2,768,000.00	0.28%
92	600096	云天化	200,000	2,754,000.00	0.28%
93	000927	一汽夏利	500,000	2,695,000.00	0.28%
94	600797	浙大网新	415,220	2,694,777.80	0.28%
95	600500	中化国际	394,208	2,688,498.56	0.27%
96	600004	白云机场	350,000	2,639,000.00	0.27%
97	600098	广州控股	459,243	2,636,054.82	0.27%
98	600066	宇通客车	200,000	2,634,000.00	0.27%
99	600688	S 上石化	420,000	2,562,000.00	0.26%
100	000061	农 产 品	200,000	2,550,000.00	0.26%
101	000539	粤电力 A	450,000	2,533,500.00	0.26%
102	600601	方正科技	600,000	2,514,000.00	0.26%
103	000027	深能源 A	301,000	2,507,330.00	0.26%
104	000400	许继电气	270,000	2,500,200.00	0.26%
105	600808	马钢股份	550,000	2,475,000.00	0.25%
106	600183	生益科技	300,000	2,466,000.00	0.25%
107	600418	江淮汽车	500,000	2,460,000.00	0.25%
108	600029	S 南航	600,000	2,454,000.00	0.25%
109	600675	中华企业	226,654	2,443,330.12	0.25%
110	000729	燕京啤酒	250,000	2,442,500.00	0.25%
111	000562	宏源证券	200,000	2,432,000.00	0.25%
112	600859	王府井	100,000	2,430,000.00	0.25%
113	600022	济南钢铁	309,030	2,373,350.40	0.24%
114	000527	美的电器	200,000	2,370,000.00	0.24%
115	600596	新安股份	130,000	2,363,400.00	0.24%
116	600718	东软股份	100,000	2,359,000.00	0.24%
117	000807	云铝股份	220,000	2,345,200.00	0.24%
118	000768	西飞国际	200,000	2,340,000.00	0.24%
119	600811	东方集团	267,455	2,332,207.60	0.24%
120	600362	江西铜业	200,000	2,320,000.00	0.24%
121	000549	S 湘火炬	250,000	2,225,000.00	0.23%
122	000800	一汽轿车	550,000	2,216,500.00	0.23%
123	000717	韶钢松山	600,000	2,160,000.00	0.22%
124	000488	晨鸣纸业	407,987	2,137,851.88	0.22%
125	000410	沈阳机床	106,570	2,136,728.50	0.22%
126	600138	中青旅	166,722	2,135,708.82	0.22%
127	600886	国投电力	294,440	2,119,968.00	0.22%
128	000630	铜都铜业	300,000	2,028,000.00	0.21%
129	600033	福建高速	396,250	2,016,912.50	0.21%

130	600027	华电国际	655,723	1,999,955.15	0.20%
131	600649	原水股份	350,000	1,998,500.00	0.20%
132	600779	水井坊	150,000	1,966,500.00	0.20%
133	600296	S 兰铝	151,879	1,960,757.89	0.20%
134	000581	威孚高科	251,298	1,945,046.52	0.20%
135	600060	海信电器	300,995	1,941,417.75	0.20%
136	600085	同仁堂	112,786	1,937,663.48	0.20%
137	600198	大唐电信	150,000	1,924,500.00	0.20%
138	000932	华菱管线	450,000	1,903,500.00	0.19%
139	600547	山东黄金	60,000	1,894,800.00	0.19%
140	000031	中粮地产	200,000	1,844,000.00	0.19%
141	000970	中科三环	200,000	1,842,000.00	0.19%
142	600299	星新材料	100,000	1,828,000.00	0.19%
143	600270	外运发展	232,767	1,827,220.95	0.19%
144	000900	现代投资	183,000	1,822,680.00	0.19%
145	600508	上海能源	250,000	1,802,500.00	0.18%
146	600598	北大荒	300,000	1,779,000.00	0.18%
147	600188	兖州煤业	248,125	1,754,243.75	0.18%
148	600132	重庆啤酒	69,273	1,738,752.30	0.18%
149	600786	S 东锅	60,000	1,734,000.00	0.18%
150	000751	锌业股份	306,848	1,706,074.88	0.17%
151	600020	中原高速	360,000	1,692,000.00	0.17%
152	600205	S 山东铝	72,157	1,630,026.63	0.17%
153	600031	三一重工	50,000	1,611,500.00	0.16%
154	600006	东风汽车	500,000	1,610,000.00	0.16%
155	600569	安阳钢铁	558,879	1,559,272.41	0.16%
156	600100	同方股份	142,737	1,542,986.97	0.16%
157	600535	天士力	100,000	1,542,000.00	0.16%
158	000425	徐工科技	232,987	1,540,044.07	0.16%
159	600196	复星医药	250,000	1,537,500.00	0.16%
160	600616	第一食品	109,570	1,523,023.00	0.16%
161	600266	北京城建	132,554	1,520,394.38	0.16%
162	600307	酒钢宏兴	335,640	1,517,092.80	0.15%
163	600588	用友软件	50,000	1,511,500.00	0.15%
164	000937	金牛能源	250,000	1,490,000.00	0.15%
165	600348	国阳新能	100,000	1,487,000.00	0.15%
166	000012	南 玻 A	132,600	1,458,600.00	0.15%
167	000619	海螺型材	186,000	1,400,580.00	0.14%
168	600780	通宝能源	469,500	1,389,720.00	0.14%
169	600406	国电南瑞	59,000	1,348,150.00	0.14%
170	600635	大众公用	370,000	1,302,400.00	0.13%
171	600597	光明乳业	200,000	1,274,000.00	0.13%
172	600770	综艺股份	106,750	1,269,257.50	0.13%



173	000917	电广传媒	165,000	1,263,900.00	0.13%
174	600591	上海航空	350,000	1,246,000.00	0.13%
175	600863	内蒙华电	450,000	1,237,500.00	0.13%
176	600835	上海机电	129,623	1,226,233.58	0.13%
177	000731	S 川美丰	100,000	1,215,000.00	0.12%
178	000939	凯迪电力	148,269	1,184,669.31	0.12%
179	000969	安泰科技	108,560	1,181,132.80	0.12%
180	600997	开滦股份	150,000	1,180,500.00	0.12%
181	000726	鲁 泰 A	150,000	1,180,500.00	0.12%
182	000422	湖北宜化	250,000	1,167,500.00	0.12%
183	000559	万向钱潮	275,000	1,166,000.00	0.12%
184	600289	亿阳信通	75,248	1,098,620.80	0.11%
185	600884	杉杉股份	200,000	1,068,000.00	0.11%
186	600739	辽宁成大	59,578	1,062,275.74	0.11%
187	000009	S 深宝安 A	250,000	1,057,500.00	0.11%
188	000541	佛山照明	110,976	1,046,503.68	0.11%
189	600643	S 爱建	120,000	1,045,200.00	0.11%
190	000503	海虹控股	121,713	1,034,560.50	0.11%
191	000758	中色股份	125,000	1,031,250.00	0.11%
192	000554	S 泰石油	177,162	1,029,311.22	0.11%
193	600068	葛洲坝	300,000	1,023,000.00	0.10%
194	000707	双环科技	262,000	1,021,800.00	0.10%
195	600160	巨化股份	195,874	1,012,668.58	0.10%
196	600823	世茂股份	201,938	1,011,709.38	0.10%
197	000869	张 裕 A	20,000	996,400.00	0.10%
198	000822	山东海化	200,000	968,000.00	0.10%
199	600747	大显股份	420,000	966,000.00	0.10%
200	000659	珠海中富	300,000	936,000.00	0.10%
201	000036	华联控股	200,000	928,000.00	0.09%
202	600581	八一钢铁	209,576	922,134.40	0.09%
203	000518	四环生物	390,000	900,900.00	0.09%
204	600219	南山铝业	100,000	899,000.00	0.09%
205	000682	东方电子	315,000	885,150.00	0.09%
206	600521	华海药业	65,201	882,821.54	0.09%
207	600171	上海贝岭	156,906	844,154.28	0.09%
208	600256	广汇股份	150,000	837,000.00	0.09%
209	600231	凌钢股份	164,087	836,843.70	0.09%
210	600740	山西焦化	100,000	831,000.00	0.08%
211	600169	太原重工	100,000	829,000.00	0.08%
212	600220	江苏阳光	200,000	828,000.00	0.08%
213	000698	沈阳化工	150,000	820,500.00	0.08%
214	600282	南钢股份	200,000	774,000.00	0.08%
215	600602	广电电子	248,500	770,350.00	0.08%

216	600812	华北制药	292,066	695,117.08	0.07%
217	000959	首钢股份	200,000	682,000.00	0.07%
218	000636	风华高科	180,000	646,200.00	0.07%
219	600210	紫江企业	224,885	591,447.55	0.06%
合计				899,322,542.44	91.78%

2. 积极投资

序号	股票代码	股票名称	股票数量	市值	占资产净值比例
1	600561	江西长运	900,000	5,715,000.00	0.58%
2	000661	S 长高新	497,508	2,885,546.40	0.29%
3	601628	中国人寿	30,000	566,400.00	0.07%
合计				9,166,946.40	0.94%

(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	占期初基金资产净值的比例
1	600036	招商银行	76,253,849.82	4.98%
2	600028	中国石化	44,795,303.22	2.92%
3	000063	中兴通讯	40,797,573.50	2.66%
4	000002	万 科 A	40,678,516.14	2.66%
5	000933	神火股份	31,348,309.64	2.05%
6	000858	五 粮 液	26,162,582.07	1.71%
7	600472	包头铝业	25,568,186.54	1.67%
8	600016	民生银行	24,380,945.20	1.59%
9	000157	中联重科	22,656,803.76	1.48%
10	000039	中集集团	22,562,738.06	1.47%
11	601988	中国银行	22,213,550.99	1.45%
12	600009	上海机场	20,614,004.72	1.35%
13	600050	中国联通	19,722,660.07	1.29%
14	600426	华鲁恒升	19,674,076.98	1.28%
15	000402	金 融 街	18,702,770.17	1.22%
16	600881	亚泰集团	17,528,335.58	1.14%
17	600000	浦发银行	17,232,839.53	1.13%
18	000401	冀东水泥	16,809,232.25	1.10%
19	002007	华兰生物	15,889,998.58	1.04%
20	002025	航天电器	15,781,168.73	1.03%

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	600036	招商银行	142,547,591.62	9.31%
2	600050	中国联通	108,608,959.42	7.09%
3	600028	中国石化	95,531,120.35	6.24%
4	600900	长江电力	84,075,454.81	5.49%
5	600019	宝钢股份	77,067,723.96	5.03%
6	600016	民生银行	73,048,179.80	4.77%
7	600309	烟台万华	58,359,539.45	3.81%
8	600009	上海机场	54,469,282.96	3.56%
9	600000	浦发银行	50,514,644.27	3.30%
10	600519	贵州茅台	45,241,910.02	2.95%
11	600005	武钢股份	41,434,298.10	2.71%
12	000157	中联重科	40,409,103.96	2.64%
13	000002	万 科 A	37,318,249.47	2.44%
14	000933	神火股份	36,783,523.32	2.40%
15	600018	上港集团	34,611,425.10	2.26%
16	000063	中兴通讯	34,173,271.14	2.23%
17	600660	福耀玻璃	31,466,169.21	2.05%
18	000402	金 融 街	30,573,460.68	2.00%
19	000858	五 粮 液	29,237,974.57	1.91%
20	600887	伊利股份	27,968,175.45	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：1,421,230,087.81*

卖出股票的收入总额：2,755,751,099.46

*注：买入股票的成本总额未扣减股权分置获得现金对价 7,076,645.24 元。

(五)、 债券投资组合

序号	债券品种	市值	占资产净值比例
1	金融债	30,024,000.00	3.06%
	合计	30,024,000.00	3.06%

(六)、 前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量	市值	占资产净值比例
1	040201	04 国开 01	300,000	30,024,000.00	3.06%

(七)、 权证投资组合

本基金本报告期末没有持有权证投资。

(八)、前五名权证明细

本基金本报告期末没有持有权证投资。

(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，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

序号	其他资产	金额
1	深交所结算保证金	500,000.00
2	应收股利	0.00
3	应收利息	825,957.13
4	应收申购款	4,496,097.80
5	应收证券清算款	9,598,145.96
	合计	15,420,200.89

4、处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没有持有可转换债券投资。

5、本报告期在股权分置改革中获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	权证数量	成本总额	获得途径
1	580997	招行 CMP1	6,014,351	0.00	股权分置改革被动持有
2	580996	沪场 JTP1	2,103,539	0.00	股权分置改革被动持有
3	580002	包钢 JTB1	698,906	0.00	股权分置改革被动持有
4	580995	包钢 JTP1	698,906	0.00	股权分置改革被动持有
5	030002	五粮 YGC1	528,629	0.00	股权分置改革被动持有
6	038004	五粮 YGP1	555,739	0.00	股权分置改革被动持有
7	580003	邯钢 JTB1	941,074	0.00	股权分置改革被动持有
8	580994	原水 CTP1	393,451	0.00	股权分置改革被动持有
9	580004	首创 JTB1	169,257	0.00	股权分置改革被动持有
10	580005	万华 HXB1	286,489	0.00	股权分置改革被动持有
11	580993	万华 HXP1	429,734	0.00	股权分置改革被动持有

12	038005	深能 JTP1	540,000	0.00	股权分置改革被动持有
13	580006	雅戈 QCB1	100,000	0.00	股权分置改革被动持有
14	580992	雅戈 QCP1	700,000	0.00	股权分置改革被动持有
15	580991	海尔 JTP1	1,080,000	0.00	股权分置改革被动持有
16	580007	长电 CWB1	435,000	0.00	股权分置改革被动持有
17	038006	中集 ZYP1	525,000	0.00	股权分置改革被动持有
18	580990	茅台 JCP1	640,000	0.00	股权分置改革被动持有
19	038008	钾肥 JTP1	171,052	0.00	股权分置改革被动持有
20	580008	国电 JTB1	250,000	0.00	股权分置改革被动持有
21	580009	伊利 CWB1	75,000	0.00	股权分置改革被动持有
22	580010	马钢 CWB1	322,000	225,722.00 *	投资可分离债获赠
23	031002	钢钒 GFC1	31,250	24,586.93 *	投资可分离债获赠
24	580011	中化 CWB1	47,700	69,445.66 *	投资可分离债获赠

*注:根据证监会基金部发布的<<关于2006年度证券投资基金年度报告编制及披露相关问题的通知>>,应对分离交易可转债及相关权证的投资成本进行分摊。基金投资的分离交易可转债所获得的相关权证成本随之进行相应调整,其中:马钢CWB1由原成本0.00元调整为225,722.00元,钢钒GFC1由原成本0.00元调整为24,586.93元,中化CWB1由原成本0.00元调整为69,445.66元。该调整不影响当期以及期末基金净值。

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	17,348	-
平均每户持有基金份额	30,018.50	-
机构投资者持有的基金份额	276,106,846.87	53.02%
个人投资者持有的基金份额	244,654,132.34	46.98%

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	3,094,001,262.00
期初基金份额总额	1,729,244,455.42
加:本期申购基金份额总额	907,551,849.24
减:本期赎回基金份额总额	2,116,035,325.45
期末基金份额总额	520,760,979.21

十一、 重大事件

(一)、 基金份额持有人大会决议：

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

(二)、 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、 本基金管理人重大人事变动如下：

(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、本基金托管人重大人事变动如下：

2006 年，本基金托管人中国工商银行股份有限公司的专门基金托管部门发生的高管人事变动：无。

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

(五)、基金收益分配事项：

1、本报告期基金收益分配事项：

	权益登记日、除 息日	红利划出日、红 利再投资日	每10份基金 份额收益分 配金额	收益分配金额
本报告期第1次 分红	2006 年 6 月 13 日	2006 年 6 月 14 日	0.50 元	36,619,627.55

(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：100,000.00 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	占总成交 总量比例	佣金	占总佣金 总量比例
申银万国证券股份有限公司	1	89,167,331.17	2.14%	73,117.10	2.17%
中信证券股份有限公司	1	210,102,669.71	5.03%	172,283.37	5.11%
招商证券股份有限公司	1	534,340,879.04	12.80%	418,125.58	12.40%
宏源证券股份有限公司	1	278,825,077.68	6.68%	228,636.40	6.78%
广发证券股份有限公司	1	862,426,405.48	20.66%	674,854.66	20.02%
国泰君安证券股份有限公司	1	85,917,600.87	2.06%	70,452.53	2.09%
中信建投证券有限责任公司	1	245,971,065.36	5.89%	201,695.61	5.98%
中国银河证券股份有限公司	1	800,662,557.83	19.18%	656,538.70	19.48%
国金证券有限责任公司	1	1,066,991,204.27	25.56%	874,928.13	25.96%
合 计		4,174,404,791.41	100.00%	3,370,632.08	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
申银万国证券股份有限公司	258,629.40	11.31%	-	-	150,255.00	0.55%
中信证券股份有限公司	1,167,600.00	51.06%	-	-	10,638,970.59	39.12%
招商证券股份有限公司	104,625.00	4.57%	-	-	901,602.50	3.31%
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	756,066.45	33.06%	-	-	3,299,068.08	12.13%
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	4,669,801.27	17.17%
国金证券有限责任公司	-	-	-	-	7,538,449.39	27.72%
合 计	2,286,920.85	100.00%	0.00	0.00%	27,198,146.83	100.00%

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. 基金合同修改

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

2. 代销渠道变更

其他重要事项		披露日期
1) 华安基金管理有限公司关于变更基金代销机构的公告，根据华安基金管理有限公司与中信建投证券有限责任公司、华夏证券股份有限公司 2005 年 12 月签署的协议书，自即日起，中信建投将作为华夏证券开放式基金业务的继承人，原华夏证券与华安基金签订的所有代销协议中应由华夏证券享有和承担的权利义务，均变更为由中信建投享有和承担，华夏证券不再享有和承担原代销协议规定的任何权利义务。		2006 年 1 月 12 日
2) 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 年 1 月 14 日
3) 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 年 3 月 7 日
4) 中国工商银行关于增加基金定投业务基金产品的通告		2006 年 4 月 14 日
5) 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
6) 华安基金管理有限公司关于新增中信万通证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告		2006 年 12 月 25 日
7) 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 19 日



3. 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 年 1 月 23 日
2)	华安基金管理有限公司关于开通“华安 - 浦发银基通”基金电子直销业务的公告	2006 年 6 月 20 日
3)	华安基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告，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
4)	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 年 6 月 28 日
5)	华安基金管理有限公司关于开通上海浦东发展银行网上银行办理“华安 - 浦发银基通”基金电子直销业务的公告	2006 年 7 月 25 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。

十二、 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 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