

华安创新证券投资基金 2006年半年度报告摘要

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

基金管理人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...

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2006年8月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容...

一、重要提示

1.基金概况
基金名称:华安创新证券投资基金
基金简称:华安创新
交易代码:040001

2.基金的投资

基金管理人将以分散投资降低投资风险,提高基金资产的安全性,并积极推动追求投资收益的确定增长为目标...

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:上海市浦东新区世纪大道1600号
信息披露负责人:陈杰

4.基金托管人

基金托管人:交通银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号
信息披露负责人:陈杰

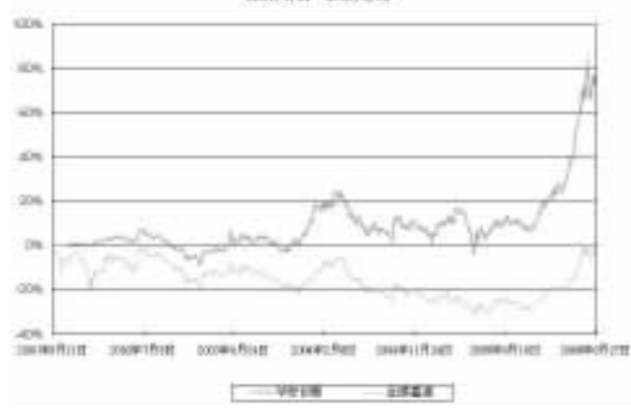
5.信息披露

基金互联网网址: http://www.huain.com.cn
信息披露地址: 上海市浦东新区世纪大道1600号

三、主要财务指标和基金净值表现

1.主要财务指标(未经审计)
基金本期净收益: 802,108,935.56
加权平均基金份额本期净收益: 0.3629

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)...



四、管理人报告

1.基金管理人及基金经理简介
(1)基金管理人
华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立...

(2)基金经理
刘明先生,硕士,9年证券从业经历,曾任浦银基金管理有限责任公司从事研究、投资工作...

的资金环境使市场难以出现超预期调整,中长期牛市场并未改变。消费和服务仍然是永恒的主题...

2006年上半年,托管人在华安创新基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规...

2006年上半年,华安基金管理公司在华安创新基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回的计算...

六、财务会计报告(未经审计)

(一)资产负债表

Table with columns: 项目, 附注, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Rows include assets like 银行存款, 债券投资, and liabilities like 应付债券, 应付赎回款.

(二)经营业绩表

Table with columns: 项目, 附注, 2006年1月1日至6月30日, 2005年1月1日至6月30日. Rows include 收入, 公允价值变动损益, 基金净收益.

(三)收益分配表

Table with columns: 项目, 附注, 2006年1月1日至6月30日, 2005年1月1日至6月30日. Rows include 本期基金净收益, 本期可供分配基金净收益.

(四)净值变动表

Table with columns: 项目, 附注, 2006年1月1日至6月30日, 2005年1月1日至6月30日. Rows include 期初基金份额, 本期申购, 本期赎回.

1. 会计政策
本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。
2. 本报告期无会计差错更正。

Table with columns: 关联方, 关系, 交易性质, 法律依据. Rows include 华安基金管理有限公司, 交通银行股份有限公司.

Table with columns: 关联人, 买入债券/卖出债券金额, 买入/卖出债券利息收入, 利息支出. Rows include 华安基金管理有限公司, 交通银行股份有限公司.

(3)关联方报酬
①基金管理人报酬
本基金支付给基金管理人管理费,按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提...

②基金托管费
本基金支付给基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提...

③基金在本报期间需支付基金管理费20,389,945.77元。(2005年上半年:17,986,661.70元)
④基金在本报期间需支付基金托管费3,396,824.31元。(2005年上半年:2,997,776.92元)

⑤基金在本报期间需支付基金托管费3,396,824.31元。(2005年上半年:2,997,776.92元)
⑥基金在本报期间需支付基金托管费3,396,824.31元。(2005年上半年:2,997,776.92元)

⑦基金在本报期间需支付基金托管费3,396,824.31元。(2005年上半年:2,997,776.92元)
⑧基金在本报期间需支付基金托管费3,396,824.31元。(2005年上半年:2,997,776.92元)

2006年上半年基金管理人投资本基金的情况:
关联人 期间数 持有份额 持有比例 买入 卖出 持有份额 持有比例 适用费率

Table showing investment performance for 2006年上半年, including columns for 关联人, 期间数, 持有份额, 持有比例, 买入, 卖出, 持有份额, 持有比例, 适用费率.

2.基金管理人主要股东及其控制的机构投资本基金的情况:
关联人 期间数 持有份额 持有比例 买入 卖出 持有份额 持有比例 适用费率

Table showing investment performance for 2006年上半年, including columns for 关联人, 期间数, 持有份额, 持有比例, 买入, 卖出, 持有份额, 持有比例, 适用费率.

4.本基金受理赎回、不能自由转让的基金资产
(1)本基金截止本报告期末未遭受赎回限制情况如下:
A. 赎回受限,不能自由转让的资产为申购的新股。在估值时如果该股票未上市,则按成本计价...

Table with columns: 股票代码, 数量, 总市值, 估值方法, 转让受限原因, 受限期限. Rows include 006009, 060040, 040216, 010214, 010110.

(2)本基金截止本报告期末受限债券如下:
股票代码 数量 总市值 估值方法 转让受限原因 受限期限

Table with columns: 股票代码, 数量, 总市值, 估值方法, 转让受限原因, 受限期限. Rows include 060009, 060009, 060009, 060009, 060009.

七、投资组合报告

(一)基金资产组合
序号 资产组合 金额(元) 占总资产比例

Table with columns: 序号, 资产组合, 金额(元), 占总资产比例. Rows include 1 股票, 2 债券, 3 权证, 4 银行存款和清算备付金合计, 5 其他资产.

(二)按行业分类的股票投资组合
序号 行业分类 市值(元) 占资产净值比例

Table with columns: 序号, 行业分类, 市值(元), 占资产净值比例. Rows include A 农林、牧、渔, B 采掘业, C 制造业, etc.

(三)股票投资前十名股票明细
序号 股票代码 股票名称 股票数量(股) 市值(元) 占资产净值比例

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 股票数量(股), 市值(元), 占资产净值比例. Rows include 1 600519, 2 000061, 3 600309, etc.

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.huain.com.cn网站的半年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动
1.累计买入、卖出金额前十名股票明细

Table with columns: 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. Rows include 1 000063, 2 600008, 3 000002, etc.

(五)基金资产净值变动
买入股票的成本总额: 3,310,436,999.26
卖出股票的收入总额: 4,209,675,182.22

Table with columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占资产净值比例. Rows include 1 国债债券, 2 金融债券, 3 企业债券, 4 可转债债券.

Table with columns: 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. Rows include 1 060009, 2 060040, 3 040216, etc.

(七)收益投资组合
1.基金投资组合五名权证明细
序号 权证代码 权证名称 数量 市值(元) 占资产净值比例

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 市值(元), 占资产净值比例. Rows include 1 580005, 2 580005, 3 580005, etc.

(八)资产支持证券投资组合
本基金本报告期末未持有资产支持证券。
(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允价值截止日(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...

Table with columns: 序号, 其他资产, 金额(元). Rows include 1 深圳结算保证金, 2 上海权证保证金, 3 深圳权证保证金, etc.

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 成本总额(元), 获得途径. Rows include 1 580007, 2 580006, 3 580005, etc.

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 成本总额(元), 获得途径. Rows include 5 580000, 6 580000, 7 580000, etc.

Table with columns: 序号, 权证代码, 权证名称, 数量, 成本总额(元), 获得途径. Rows include 4 580005, 5 580000, 6 580000, etc.

基金资产持有人户数及持有人的结构
基金资产持有人户数 份额(份) 占总份额的比例

Table with columns: 基金资产持有人户数, 份额(份), 占总份额的比例. Rows include 平均每户持有基金份额, 机构投资者持有的基金份额, 个人投资者持有的基金份额.

九、开放式基金份额变动

Table with columns: 项目, 份额(份). Rows include 基金合同生效日的基金份额总额, 期初基金份额总额, 加:本期申购基金份额总额, etc.

十、重大事件

- (一)基金持有人大会决议情况: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.基金管理人于2006年2月15日发布公告:鉴于第二届董事会任期已届满,经华安基金管理有限公司第十三次股东会选举,产生由王成明先生、韩方明先生、廖昌基先生、俞尚松先生、顾伟廷先生、张军先生、谢均基先生、夏大慰先生组成的第三届董事会,其中谢均基先生、吴伯庆先生、夏大慰先生为独立董事。杜建国先生、廖彬生先生、柳永生先生、陶晋先生、李华俊先生、朱勇先生不再担任本公司董事。
2.本基金托管人在本报告期内重大人事变动情况:
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人离任的公告》。
(三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼:无。
(四)、基金投资策略的改变:无。
(五)、基金投资标的变更:无。
(六)、基金估值方法变更:无。
(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门处罚或处分的情况:无。
(八)、本报告期间租用证券公司席位情况如下:
1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:
新增席位:
券商名称 上交所席位数 深交所席位数
国信证券有限责任公司 0 1
新增席位:
券商名称 上交所席位数 深交所席位数
天同证券有限责任公司 1 0
2. 交易成交总额及佣金情况:
(1)股票交易情况:
券商名称 租用席位数量 成交金额 占成交总额比例 佣金 占佣金总额比例
国泰君安证券股份有限公司 2 602,875,876.12 8.06% 480,893.49 8.04%
海通证券股份有限公司 1 649,709,926.28 8.71% 508,465.28 8.50%
申银万国证券股份有限公司 2 404,764,226.00 5.43% 316,730.76 5.29%
广发证券股份有限公司 1 1,446,388,171.93 19.38% 1,181,064.81 19.74%
东方证券股份有限公司 2 209,045,989.59 2.80% 163,579.63 2.73%
平安证券股份有限公司 1 765,848,940.82 10.27% 599,280.02 10.01%
招商证券股份有限公司 1 556,961,648.10 7.45% 454,151.99 7.59%
中国国际金融有限公司 1 415,349,406.21 5.57% 336,582.39 5.62%
中银国际证券有限责任公司 1 310,685,274.96 4.16% 253,512.29 4.24%
中国银河证券股份有限公司 1 1,349,345,538.06 18.09% 1,107,617.87 18.43%
国信证券股份有限公司 1 750,833,709.94 10.06% 587,504.14 9.82%
合 计 14 7,459,798,708.01 100.00% 5,984,333.67 100.00%
(2)债券交易情况:
券商名称 租用席位数量 成交金额 占成交总额比例 佣金 占佣金总额比例
国泰君安证券股份有限公司 54,908,132.40 6.41% 55,000,000.00 7.37% 5,670,213.87 4.05%
海通证券股份有限公司 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0.00 0.00%
申银万国证券股份有限公司 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0.00 0.00%
广发证券有限责任公司 96,731,536.30 11.30% 318,200,000.00 42.62% 35,527,561.62 25.39%
东方证券股份有限公司 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0.00 0.00%
平安证券有限责任公司 0.00 0.00% 0.00 0.00% 0.00 0.00%
平安证券股份有限公司 171,552,040.00 20.04% 400,000.00 0.00% 70,208,793.03 50.17%
中国国际金融有限公司 249,442,228.40 28.14% 148,400,000.00 19.88% 28,521,410.65 20.38%
中国银河证券股份有限公司 85,546,820.30 9.99% 40,000,000.00 5.36% 0.00 0.00%
中国银河证券股份有限公司 197,882,393.90 23.12% 185,000,000.00 24.78% 0.00 0.00%
国信证券股份有限公司 1 750,833,709.94 10.06% 587,504.14 9.82%
合 计 856,043,151.30 100.00% 746,600,000.00 100.00% 139,927,989.19 100.00%
(九)、其他重要事项:
1.变更基金份额发售机构:
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事项公告 2006年1月12日
2) 华安基金管理有限公司关于开通建行开放式基金业务公告 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) 华安基金管理有限公司关于开通“平安-浦发基金”基金电子直销业务的公告 2006年6月20日
2.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公告 2006年1月23日
2) 华安基金管理有限公司关于开通建设银行基金业务公告 2006年6月20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6月20日
3. 基金管理人、基金托管人、基金销售机构在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上披露:
(一)2006年7月18日,交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于住所变更的公告》。交通银行股份有限公司住所由“上海市仙霞路18号”变更为“上海市浦东新区银城中路188号”。