

华安宝利配置证券投资基金

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

一、重要提示

基金管理人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。

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。

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预示其未来表现。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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

二、基金产品概况

Table with 2 columns: Item and Value. Includes fund name (华安宝利配置证券投资基金), code (040004), and investment objective.

投资目标:本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活运用资产配置,并充分发掘基金资产的增值潜力,在有效控制风险的基础上,获取超越业绩比较基准的投资收益。

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

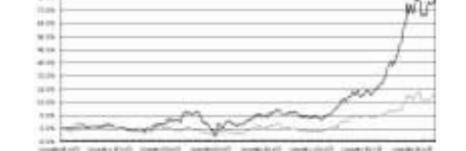
业绩比较基准:35%*大相转债指数收益率+30%*大相280指数收益率+30%*天相国债全价指数收益率+5%*金融同业存款利率

基金管理人:华安基金管理有限公司
注册及办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:王成明

基金托管人:交通银行股份有限公司(简称“交通银行”)
注册及办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:韩志征

主要财务指标:2006年1-6月
基金本期净收益:266,663,236.32
基金本期加权平均净值收益率:24.24%

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:封闭式基金交易费用,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。



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
袁晓女士,经济学学士,6年证券从业经历。曾在中国平安保险(集团)股份有限公司投资管理工作。

(3) 基金业绩表现
截止2006年6月30日,本基金单位净值为1.626元,累计净值1.766元,2006年上半年单位净值上升61.02%,同期业绩比较基准上升20.83%,超越比较基准40.19%。

(4) 市场展望和投资策略
宝利配置基金仍看好制度改革给股票市场带来的中长期机遇和经济长期高速增长对市场的趋势,同时也将积极应对价值回归合理化后面面临短期调整的可能性,立足于各自

标市场和市场的相对估值比较,结合国际市场估值水平和国内外宏观经济,动态的调整资产配置比例和优化组合结构。

五、托管人报告

2006年上半年,托管人在华安宝利基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2006年上半年,华安基金管理有限公司在华安宝利基金运作中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

2006年上半年,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、财务会计报告(未经审计)

Table with 5 columns: Item, Unit, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Shows assets, liabilities, and net assets.

Table with 5 columns: Item, Unit, 2006年6月30日, 2005年12月31日. Shows income and expenses.

资产负债表
资产: 银行存款 90,436,117.10, 14,011,926.49
负债: 应付债券 10,699,620.00, 10,699,620.00

利润表
营业收入 3,065,598.44, 2,197,336.10
营业支出 10,699,620.00, 10,699,620.00
净利润 2,866,000.00, 1,497,716.10

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 538,086,906.38, -1,571,282.97
投资活动产生的现金流量净额 -206,925,308.78, 51,279,369.67

所有者权益变动表
本期净利润 266,663,236.32, 1,785,663.74
本期利润分配 0.00, 5,402,020.00

资产负债表
资产: 银行存款 90,436,117.10, 14,011,926.49
负债: 应付债券 10,699,620.00, 10,699,620.00

利润表
营业收入 3,065,598.44, 2,197,336.10
营业支出 10,699,620.00, 10,699,620.00
净利润 2,866,000.00, 1,497,716.10

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 538,086,906.38, -1,571,282.97
投资活动产生的现金流量净额 -206,925,308.78, 51,279,369.67

所有者权益变动表
本期净利润 266,663,236.32, 1,785,663.74
本期利润分配 0.00, 5,402,020.00

资产负债表
资产: 银行存款 90,436,117.10, 14,011,926.49
负债: 应付债券 10,699,620.00, 10,699,620.00

利润表
营业收入 3,065,598.44, 2,197,336.10
营业支出 10,699,620.00, 10,699,620.00
净利润 2,866,000.00, 1,497,716.10

现金流量表
经营活动产生的现金流量净额 538,086,906.38, -1,571,282.97
投资活动产生的现金流量净额 -206,925,308.78, 51,279,369.67

所有者权益变动表
本期净利润 266,663,236.32, 1,785,663.74
本期利润分配 0.00, 5,402,020.00

前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

本基金在本报告期内需支付基金托管费1,357,356.28元。(上年度的上半年:664,534.37元)

(4) 本基金的银行保管的银行存款余额及由此产生的利息收入
本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。基金托管人于2006年6月30日保管的银行存款余额为90,436,117.10元(2005年6月30日:26,246,095.33元)。

(5) 基金关联方投资本基金的情况
(1) 基金管理人投资本基金的情况:
2006年度的上半年(2006年1-6月)基金管理人投资本基金的情况:

Table with 10 columns: Party, Transaction Type, Amount, etc. Shows transactions between the fund manager and the fund.

2005年度的上半年(2005年1-6月)基金管理有限公司投资本基金的情况:

Table with 10 columns: Party, Transaction Type, Amount, etc. Shows transactions between the fund manager and the fund.

(6) 基金管理人主要股东及控制的其他关联方投资本基金的情况:
本报告期末与2005年上半年度由基金托管人保管的银行存款余额为174,451.40元(2005年上半年度:214,997.22元)。

(7) 基金关联方投资本基金的情况
(1) 基金管理人投资本基金的情况:
2006年度的上半年(2006年1-6月)基金管理人投资本基金的情况:

Table with 10 columns: Party, Transaction Type, Amount, etc. Shows transactions between the fund manager and the fund.

(2) 本基金截止本报告期末无流通受限债券。

七、投资组合报告
(一) 基金资产组合
1. 股票
2. 债券
3. 权证
4. 其他资产

(二) 股票投资组合
1. 行业分布
2. 地区分布
3. 基金重仓股

(三) 投资组合前十名股票明细
1. 股票代码
2. 股票名称
3. 数量
4. 市值
5. 占净值比例

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动
1. 累计买入、累计卖出价值前十名股票的股票明细

(五) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(七) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(八) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(九) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(十一) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十二) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十三) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(十四) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十五) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(十七) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十八) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十九) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(二十) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十一) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十二) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(二十三) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十四) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十五) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(二十六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十七) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十八) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

Table with 5 columns: Code, Name, Quantity, Market Value, Proportion. Shows fund assets and liabilities.

(八) 资产支持证券投资组合
本基金报告期内未投资资产支持证券。

(九) 投资组合内未投资资产支持证券
1. 本基金的投资方法
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。

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. 整个报告期内购回的权证统计
序号 权证代码 权证名称 数量 成本总额(元) 获得途径

基金份额持有人户数及持有人结构
项目 份额(份) 占总额的比例

九、开放式基金份额变动
项目 份额(份)

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。

(三) 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的人事变动:
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聘任基金托管人职务的公告》。

(四) 基金投资策略的改变:无。
(五) 基金收益分配事项:
权益登记日、除息日、红利划出日、红利再投资日、每10份基金份额收益分配金额

(六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(七) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(八) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(九) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十一) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(十二) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十三) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十四) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(十五) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十七) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(十八) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(十九) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(二十一) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十二) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十三) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(二十四) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十五) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

(二十七) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十八) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况:
(二十九) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况: