

安顺证券投资基金 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 基金管理人及董事会对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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事同意,并由董事长签字发

着股指期货已进入实质性准备阶段,大盘蓝筹股作为长期资金战略对象值得重点关注,同时,随着A股市场再融资及IPO的渐次恢复,我们将积极关注其中的优秀企业,寻找机会纳入组合。我们将注重人民币升值背景下,也将积极寻找具备持续竞争优势的公司;同时关注流通环境下,对公司管理团队的综合评估仍将是必要的课题之一

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资者有风险,投资者在做投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

安顺基金在2006年上半年,托管人在安顺基金的托管过程中,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、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2. 基金产品概况

基金名称	安顺证券投资基金
基金简称	基金安顺
交易代码	500009
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年6月16日
期末基金份额总额	30亿份
基金存续期	15年
基金上市地点	上海证券交易所
基金上市日期	1999年6月22日

2. 基金的投资 本基金的投资目标是,为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。

项目	附注	2006年6月30日	2005年12月31日
资产:			
银行存款		480,033,843.71	110,152,587.79
清算备付金		41,666,462.46	20,892,045.07
交易保证金		1,685,882.91	381,465.52
应收证券清算款		0.00	2,309,704.01
应收股利		249,997.50	0.00
应收利息		15,938,301.43	10,284,326.15
其他应收款		57,560,000.00	
股票投资市值		3,592,285,162.02	2,577,245,798.37
其中:股票投资成本		2,686,561,195.16	2,363,350,103.60
债券投资市值		1,004,454,981.09	731,953,945.60
其中:债券投资成本		1,008,814,492.11	730,154,737.55
权证投资市值		25,584,000.00	
其中:权证投资成本		28,608,002.63	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		363,670.63	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		5,219,812,301.75	3,453,309,882.51
负债:			
应付证券清算款		167,899,593.59	59,212,746.80
应付管理人报酬		5,812,374.14	4,133,677.39
应付托管费		968,729.01	688,946.22
应付佣金		3,726,825.16	3,170,644.44
应付利息		35,694.60	0.00
其他应付款		750,000.00	750,000.00
卖出回购证券款		158,890,000.00	0.00
预提费用		367,944.66	220,000.00
负债合计		338,361,151.16	68,176,014.85
所有者权益:			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得		898,340,453.21	215,694,902.82
未分配收益		986,110,697.38	169,438,964.84
持有人权益合计		4,884,451,150.59	3,385,133,867.66
基金和所有者权益合计		5,219,812,301.75	3,453,309,882.51
基金份额净值		1.6282	1.1284

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360号 新上海国际大厦38楼(邮政编码:200120)
法定代表人:	王成明
信息披露负责人:	冯颖
联系电话:	021-58881111
传真:	021-68963414
电子邮箱:	jengying@huanan.com.cn
客户服务热线:	021-68604666, 40088-50099

4. 基金托管人

基金托管人:	交通银行股份有限公司
注册及办公地址:	上海市银城中路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:	021-58408636
电子邮箱:	zhangyong@bankcomm.com

5. 信息披露 信息披露报告 中国证劵报、上海证劵报、证劵时报

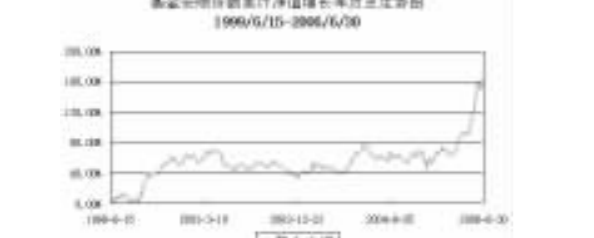
三、主要财务指标和基金净值表现

基金本期净收益:	984,671,732.71
加权平均基金份额本期净收益:	0.3282
期末可供分配基金收益:	986,110,697.38
期末可供分配基金份额净收益:	0.3287
期末基金资产净值:	4,884,451,150.59
期末基金份额净值:	1.6278
基金加权平均净值收益率:	24.27%
本期基金份额净值增长率:	50.46%
基金份额累计净值增长率:	164.28%

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上述数字。

1. 历史各时间段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
过去一个月	4.90%	2.54%	-	-	-	-
过去三个月	32.14%	3.24%	-	-	-	-
过去六个月	50.46%	2.56%	-	-	-	-
过去一年	66.36%	2.18%	-	-	-	-
过去三年	82.05%	2.08%	-	-	-	-
自基金合同生效至今	164.28%	2.16%	-	-	-	-



四、管理人报告 1. 基金管理人及基金经理简介 (一)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,注册资本为1.5亿元人民币。公司总部设在上海陆家嘴金融商务区,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)有限公司和上海浦东投资发展有限公司。

截至2006年6月30日,公司旗下共管理了基金安顺、基金安颐、基金宏富、基金安瑞4只封闭式证券投资基金,华安创新、华安中小盘、华安富利、华安红利、180ETF等5只开放式基金,管理资产规模达到344.88亿元。 (二)基金经理 尚志锐先生:工商管理硕士,10年证券、基金从业经历,曾在上海证券报研究所、上海盛大投资管理有限公司(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年加入华安基金管理有限公司,曾任研究员兼高级研究员。现任基金安顺基金经理、基金安颐基金经理。 陈静女士:工商管理硕士,11年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券研究所(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年加入华安基金管理有限公司,曾任研究员兼高级研究员。现任基金安顺基金助理。

二、经营业绩表

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
收入:			
股票净收入		943,206,262.62	77,961,112.28
债券净收入		-1,037,266.54	2,088,963.37
利息净收入		16,838,444.16	
其他净收入		12,670,510.07	11,860,366.08
公允价值变动		1,503,540.34	1,719,087.25
股利收入		38,071,262.04	46,709,873.48
其他净收入		381,280.42	
其他收入		0.00	14,620.07
收入合计		1,021,883,933.27	140,944,062.65
费用:			
基金管理人报酬		30,054,726.90	22,229,934.38
基金托管费		5,009,121.17	3,871,744.58
卖出回购证券支出		1,413,923.94	42,873.37
其他费用		434,428.65	334,456.44
其中:信息披露费		168,033.31	168,033.31
审计费用		49,588.57	69,588.57
上市费用		29,752.78	29,752.78
费用合计		38,262,250.26	27,469,066.37
基金净收益		984,671,732.71	112,875,043.28
期末未实现估值变动		892,645,950.39	-54,128,637.68
基金经营业绩		1,697,317,283.10	58,746,405.60

(三)收益分配表

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
本期基金净收益		984,671,732.71	112,875,043.28
加:期初未分配收益		169,438,964.84	33,225,440.96
可供分配基金净收益		1,154,110,697.55	146,100,484.14
基本本期应分配收益		168,000,000.17	30,000,000.00
期末未分配净收益		986,110,697.38	116,100,484.14

(四)净值变动表

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
一、期初基金净值		3,385,133,867.66	3,033,062,078.64
二、本期经营业绩			
基金净收益		984,671,732.71	112,875,043.28
期末未实现估值变动		892,645,950.39	-54,128,637.68
经营业绩产生的净值变动		1,697,317,283.10	58,746,405.60
三、本期期间持有人的收益		-168,000,000.17	-30,000,000.00
期末基金净值		4,884,451,150.59	3,061,808,493.24

(五)会计报表附注 1. 会计政策 本基金会按照财政部《证券投资基金会计核算办法》编制,会计信息披露的方式则是根据《中国证监会基金管理委员颁布并于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3号〈半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。

3. 关联方关系和关联交易 (1) 关联方关系、关联方式及法律依据

关联方	关系	关联性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金管理人	提供管理费	基金合同
交通银行股份有限公司	基金托管人	提供托管费、银行间市场交易	基金合同、成交确认书
上海国际信托投资有限公司	基金管理人股东	-	-
上海电气(集团)有限公司	基金管理人股东	-	-
上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东	-	-
上海工业投资发展有限公司	基金管理人股东	-	-
上海工业投资集团有限公司	基金管理人股东	-	-

(二) 关联方报告 1. 基金管理人 基金管理人严格按照有关法律法规及《安顺证券投资基金基金合同》、《安顺证券投资基金招募说明书》等相关法律法规的规定,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况。

关联方	买入债券	卖出债券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
交通银行股份有限公司	69,756,493.16	20,683,506.85	-	-	-

银行存款余额为480,033,843.71元(2006年6月30日:112,379,503.62元)。本报告期内由基金托管人保管的银行存款产生的利息为1,503,540.34元(2005年上半年:1,719,087.25元)。

2. 基金管理人主要股东及其控制的机构投资基金的情况:

关联方	2006年6月30日		2006年6月30日		适用费率
	持有份额	持有比例%	持有份额	持有比例%	
上海浦东信托投资有限公司	3,760,000	0.125	3,760,000	0.125	-

3. 基金投资组合报告 (一) 基金投资组合 截止报告期末本基金投资组合如下: (二) 行业分类的股票投资组合

序号	股票代码	股票名称	数量	总市值	占比
1	600009	G 华安	26,990,000	387,306,600.00	73.9%
2	000402	G 国都	38,990,000	322,667,400.00	65.9%
3	000089	G 鄂电	39,999,999	222,799,994.00	45.6%
4	60051	G 申康	52,799,989	206,447,968.00	42.2%
5	600456	G 宝 钛	4,080,000	191,780,000.00	38.2%
6	600011	G 华 能	38,300,000	181,884,000.00	37.2%
7	600271	G 航 信	6,080,000	181,366,400.00	37.1%
8	600309	G 华 广	12,180,000	177,706,200.00	34.9%
9	600588	G 川 仪	7,288,800	150,440,820.00	30.8%
10	600132	康 美 油 田	5,565,500	135,609,760.00	27.8%

4. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产 (一) 基金流通受限、不能自由转让的资产为: (二) 本基金截止报告期末流通受限债券情况:

股票代码	股票名称	数量	总市值	占比
600041	中远发展	5,588,596	28,188,693.8	32.31%
000057	中国国贸	6,880,000	58,185,230.14	95.29%

(二) 基金投资组合 截止报告期末本基金投资组合如下:

序号	股票代码	股票名称	数量	总市值	占比
1	600009	G 华安	26,990,000	387,306,600.00	73.9%
2	000402	G 国都	38,990,000	322,667,400.00	65.9%
3	000089	G 鄂电	39,999,999	222,799,994.00	45.6%
4	60051	G 申康	52,799,989	206,447,968.00	42.2%
5	600456	G 宝 钛	4,080,000	191,780,000.00	38.2%
6	600011	G 华 能	38,300,000	181,884,000.00	37.2%
7	600271	G 航 信	6,080,000	181,366,400.00	37.1%
8	600309	G 华 广	12,180,000	177,706,200.00	34.9%
9	600588	G 川 仪	7,288,800	150,440,820.00	30.8%
10	600132	康 美 油 田	5,565,500	135,609,760.00	27.8%

(三) 投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	市值占净值比例
1	600009	G 华安	26,990,000	387,306,600.00	73.9%
2	000402	G 国都	38,990,000	322,667,400.00	65.9%
3	000089	G 鄂电	39,999,999	222,799,994.00	45.6%
4	60051	G 申康	52,799,989	206,447,968.00	42.2%
5	600456	G 宝 钛	4,080,000	191,780,000.00	38.2%
6	600011	G 华 能	38,300,000	181,884,000.00	37.2%
7	600271	G 航 信	6,080,000	181,366,400.00	37.1%
8	600309	G 华 广	12,180,000	177,706,200.00	34.9%
9	600588	G 川 仪	7,288,800	150,440,820.00	30.8%
10	600132	康 美 油 田	5,565,500	135,609,760.00	27.8%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动 1. 累计买入、累计卖出价值占期初基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	买入数量	买入金额	占期末基金资产净值比例
01	600009	G 华安	427,632,678.95	6,038,826,855.18	15.57%
02	600208	中信证券	25,853,948.41	6,159,813.47	0.15%
03	600050	G 株 通	241,183,282.79	7,124,541.95	0.17%
04	600011	G 华 能	228,316,810.07	6,699,147.82	0.16%
05	000089	G 鄂电	190,549,563.66	5,653,924.00	0.14%
06	600796	国电电力	177,182,973.48	5,228,525.54	0.13%
07	600588	G 川 仪	157,370,216.36	4,840,531.20	0.12%
08	600011	G 华 能	38,300,000	181,884,000.00	37.2%
09	600271	G 航 信	6,080,000	181,366,400.00	37.1%
10	600309	G 华 广	12,180,000	177,706,200.00	34.9%
11	600588	G 川 仪	7,288,800	150,440,820.00	30.8%
12	600132	康 美 油 田	5,565,500	135,609,760.00	27.8%
13	600796	国电电力	158,997,132.16	4,735,257.78	0.12%
14	600456	G 宝 钛	85,427,903.50	2,614,936.43	0.06%
15	600030	G 美 的	60,753,609.49	1,979,174.62	0.05%
20	000057	中国国贸	57,992,009.00	1,719,087.25	0.04%

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	4,540,479,439.29
卖出股票的收入总额	5,189,594,473.20

(五) 投资组合品种分类的股票投资组合

序号	债券品种	市值	占资产净值比例
1	国债券	666,306,907.40	13.82%
2	金融债	338,148,078.69	6.94%
3	企业债	0.00	0.00%
4	可转债	0.00	0.00%
合计		1,004,454,981.09	20.65%

(七) 权证投资组合

序号	权证代码	权证名称	数量	市值	占资产净值比例
1	580005	万华HXB1	2,080,000	25,584,000.00	0.52%

(八) 资产支持证券投资情况 本基金本报告期末无投资资产支持证券。 (九) 投资组合报告附注 1. 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。

3. 其他资产的构成

序号	其他资产	金额
1	预收账款	1,572,194.40
2	上海证券保证金	65,555.56
3	预收利息	57,142.86
4	应收证券清算款	0.00
5	应收股利	249,997.50
6	应收利息	15,938,301.43
7	证券申购款	57,560,000.00
8	待摊费用	363,670.63
合计		75,797,824.27

4. 处于转股期的可转换债券