

安瑞证券投资基金 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: 中国工商银行股份有限公司

一、重要提示 基金管理人及董事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。

基金托管人中国工商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, 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。投资风险, 投资者在作出投资决策前请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 1、基金概况 基金名称: 安瑞安瑞

Table with 2 columns: 基金概况, 基金合同生效日: 2000年7月18日, 基金上市日期: 2001年8月30日

2、基金的投资 投资目标: 本基金投资于小型上市公司, 即公司市值低于市场平均市值的上市公司。投资目标是发掘小型上市公司中的投资机会, 通过积极的投资策略, 获取长期资本增值。

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: 上海市浦东新区世纪大道160号

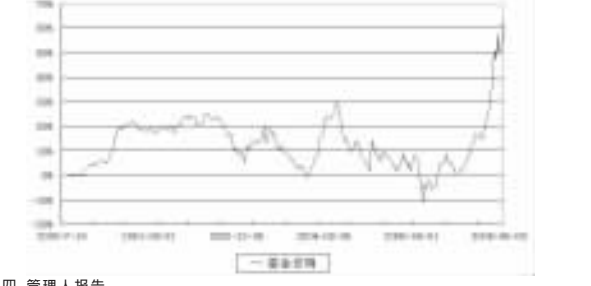
三、主要财务指标和基金净值表现 1、主要财务指标(未经审计) 基金本期净收益: 114,491,213.43 加权平均基金份额本期净收益: 0.2290

Table with 2 columns: 财务指标, 本报告期 基金本期净收益: 114,491,213.43

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。

Table with 2 columns: 新近 净增长率①, 业绩比较基准收益增长率② 过去一个月: 10.54%, 4.47%

备注: 本基金合同中没有规定业绩比较基准。 B、图示自基金合同生效以来基金净值表现 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



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 林义将先生, 工学硕士, 8年证券、基金从业经历, 1999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。

本报告期内, 本基金管理人严格遵守有关法律法规及《安瑞证券投资基金合同》、《安瑞证券投资基金招募说明书》等有关规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产。

3.1 上半年业绩表现 上半年安瑞基金净值增值60.73%, 上证指数上涨44.02%, 基金净值表现好于同期上证指数。

3.2 行情回顾 上半年宏观经济快速增长, 上市公司股权分置改革稳步推进, 股票市场延续了去年12月以来的上升趋势。

3.3 操作回顾 上半年安瑞基金始终保持了较高的股票仓位。对上市公司2005年度报告以及2006年一季度报告的统计结果表明, 与沪深主板公司相比, 深圳中小企业板公司整体更具有盈利能力和成长性。

3.4 下半年展望 上半年较高的宏观经济数据加剧了市场对进一步加强宏观调控的担忧。我们认为宏观经济调控不会改变经济的增长趋势。

2006年上半年, 我国宏观经济将继续保持较快的增长速度。宏观调控环境下, 固定资产投资增速, 不会显著降低。

五、托管人报告 2006年上半年, 本托管人在对安瑞基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同。

六、财务会计报告(未经审计) (一)、资产负债表 单位: 人民币元 项 目 附注 2006年6月30日 2005年12月31日

Table with 2 columns: 项 目, 附注 资产: 银行存款 14,156,672.26, 交易准备付金 1,577,391.85

(二)、经营业绩表 自二零零六年一月一日至二零零六年六月三十日止期间 单位: 人民币元 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

Table with 2 columns: 项 目, 附注 收入: 股票差价收入 110,560,500.84, 债券差价收入 -28,703,342.00

(三)、收益分配表 自二零零六年一月一日至二零零六年六月三十日止期间 单位: 人民币元 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

Table with 2 columns: 项 目, 附注 本期基金净收益 114,491,213.43, 期末可供分配基金净收益 60,202,742.31

(四)、净值变动表 自二零零六年一月一日至二零零六年六月三十日止期间 单位: 人民币元 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

Table with 2 columns: 项 目, 附注 一、期初基金净值 463,676,895.69, 二、本期损益: 基金净收益 114,491,213.43

(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》。

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。

3、关联方关系和关联交易 (1)关联方: 关系、交易性质及法律依据列示

Table with 4 columns: 关联人, 关系, 交易性质, 法律依据 华安基金管理有限公司 基金管理人

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)本报告期与关联方进行的交易 (3)本报告期(2006年1-6月)通过关联方席位的股票成交量: 无。

2006年1-6月通过关联方席位的股票成交量: 无。 2006年1-6月通过关联方席位的债券、回购和权证成交量: 无。

(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。

费。计算方法如下: H = E x 1.5% / 当年天数 H为每日应支付的管理费 E为前一日基金资产净值

4. 本基金截止本报告期末未流通受限股票情况如下: (1) 本基金的限售股 在估值时如果该股票还未上市, 则按成本计价。

2006年度1-6月基金管理公司投资本基金的情况: 2006年度1-6月基金管理人中国工商银行股份有限公司保管, 按银行同业利率计息。

1、基金管理人投资本基金的情况: 2006年度1-6月基金管理人中国工商银行股份有限公司保管, 按银行同业利率计息。

Table with 2 columns: 关联人, 附注 华安基金管理有限公司 6,318,119 1.26%

2006年度1-6月基金管理公司投资本基金的情况: 2006年度1-6月基金管理人中国工商银行股份有限公司保管, 按银行同业利率计息。

Table with 2 columns: 关联人, 附注 华安基金管理有限公司 6,318,119 1.26%

2、基金管理人主要股东及控制机构投资本基金的情况: 无 4. 本基金受限股, 不能自由转让的基金资产

(1) 本基金的限售股 在估值时如果该股票还未上市, 则按成本计价。如已上市, 则按当日市场平均价计价。

Table with 2 columns: 股票名称, 数量 中国银行 504,000 1,562,320.00

(2) 本基金截止本报告期末未流通受限股票。 7、投资业绩报告 (一)、基金资产净值 序号 资产组合 金额(元) 占总资产比例

Table with 2 columns: 序号, 资产组合 1 股票 645,066,398.42 76.91%

(二)、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 1,406,244.69 0.20%

Table with 2 columns: 序号, 行业分类 A 农林、牧、渔业 1,406,244.69 0.20%

(三)、股票投资组合前十名股票明细 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 2 columns: 序号, 股票代码 1 000201 中航股份 7,650,000 57,375,000.00

投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细, 应查阅登载于http://www.huawen.com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、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%的股票明细: 序号 股票代码 股票名称 本期累计买入额

Table with 2 columns: 序号, 股票代码 1 000208 中投证券 7,050,000 57,375,000.00

(五)、其他重要事项: 1) 华安基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务热线的公告 2006年6月20日

2) 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

Table with 2 columns: 序号, 股票代码 20 002045 广州光 15,200,440.53 2.28%

2. 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额。 742,007,469.25 770,222,140.91

Table with 2 columns: 序号, 债券品种 1 国债投资 108,313,781.60 15.50%

(六)、基金投资前五名债券明细 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

Table with 2 columns: 序号, 债券代码 1 010010 20国债01 370,190 37,152,268.40 5.32%

(七)、权证投资组合 1. 基金投资前五名权证证明 权证代码 权证名称 数量 市值(元) 占资产净值比例

Table with 2 columns: 序号, 权证代码 1 580006 万华HXB1 110,000 1,363,000.00 0.19%

(八)、资产支持证券投资组合 本基金本报告期末未投资资产支持证券。 0. 投资组合投资情况 1. 本基金的投资方法

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)的市场平均价计算, 已发行未上市股票采用成本价计算。

2. 本报告期末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。

3. 其他投资组合 序号 其他资产 金额(元) 1 深圳结算保证金 548,792.94

Table with 2 columns: 序号, 其他资产 1 深圳结算保证金 548,792.94

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

Table with 2 columns: 序号, 转债代码 1 - - - - -

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 成本总额(元) 获得途径

Table with 2 columns: 序号, 权证代码 1 580005 万华HXB1 110,000 0 股权分置改革被动持有

八、基金份额持有人户数及持有人结构 基金份额持有人户数及持有人结构 项目 份额(份) 占总份额的比例

Table with 2 columns: 项目, 份额(份) 基金份额持有人户数 22,781 100%

九、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. 本基金管理人在本报告期内重大人事变动如下: 本基金管理人于2006年2月15日发布公告: 鉴于第二届董事会任期已经届满, 经华安基金管理有限公司第十二次股东会议选举, 产生由王成明先生、韩方河先生、葛昌基先生、俞妙根先生、魏朝柱先生、张晖先生、潘均斌先生、吴伯庆先生、夏大慰先生组成的第三届董事会, 其中曹炳基先生、吴伯庆先生、夏大慰先生为独立董事, 杜国辉先生、李海强先生、李海强先生、陶晋先生、朱勇先生不再担任公司董事。

2. 本基金托管人在本报告期内没有发生重大人事变动。 (三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼: 无。 (四)、基金投资策略的重大变更: 无。 (五)、基金收益分配事项: 无。 (六)、基金收益分配审计的会计师事务所情况, 包括解聘原会计师事务所的原因, 以及是否履行了必要的程序; 未改聘会计师事务所。 (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, 包括稽查或处罚的次数、原因及结论, 如监管部门提出整改意见的, 应简单说明整改情况: 无。 (八)、本报告期内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变更情况:

Table with 2 columns: 券商名称, 上交所席位数 深交所席位数

2. 交易成交及佣金情况: (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

Table with 2 columns: 券商名称, 租用席位数量 上海证券有限责任公司 1 99,087,666.62 65.6%

(2) 债券、回购及权证交易情况: 券商名称 债券成交金额 占债券成交总额比例 回购成交金额 占回购成交总额比例 权证成交金额 占权证成交总额比例

Table with 2 columns: 券商名称, 债券成交金额 上海证券有限责任公司 3,954,994.40 24.1%

(九)、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开通全国统一客户服务热线的公告 2006年6月20日

2) 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

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