# 安久证券投资基金 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。本半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，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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的扩募说明书。

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： | 安久证券投资基金 |
| 基金简称： | 基金安久 |
| 交易代码： | 184709 |
| 基金运作方式： | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日： | 1992年8月31日（原四川国信投资基金成立日期）<br>2000年7月4日华安基金管理有限公司开始管理基金安久 |
| 报告期末基金份额总额： | 5亿份 |
| 基金合同存续期： | 15年(自1992年8月31日至2007年8月30日) |
| 基金份额上市交易的证券交易所： | 深圳证券交易所 |
| 上市日期： | 2001年8月31日 |

2、基金的投资

| | |
|---|---|
| 投资目标： | 本基金为积极成长型基金，本基金投资于积极应用新技术的上市公司。 |
| 投资策略： | 本基金将通过努力提高自身综合决策能力来减少风险。同时也通过分散投资来减少风险。<br>本基金的证券资产将不低于基金资产总额的80%，其中投资于国债的比例控制在基金资产净值的20–50%，股票资产的比例控制在45–80%，现金比例根据运作情况调整。<br>在股票资产中，至少70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。本基金界定的成长型股票主要指单一主业或多主业有良好成长性的公司股票，该类公司的特征是：（1）预期利润总额增长速度超过行业平均水平或同期GDP增长速度；（2）新技术应用对公司的主营业务贡献明显。 |
| 业绩比较基准： | 无 |
| 风险收益特征： | 无 |

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： | 上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼<br>（邮政编码：200120） |
| 办公地址： | 上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼<br>（邮政编码：200120） |
| 信息披露负责人： | 冯颖 |
| 联系电话： | 021–58881111 |
| 传真： | 021–68863414 |
| 电子邮箱： | fengying@huaan.com.cn |
| 客户服务热线： | 021–68604666、4008850099 |

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： | 上海市浦东新区银城中路188号<br>（邮政编码：200120） |
| 办公地址： | 上海市浦东新区银城中路188号<br>（邮政编码：200120） |
| 信息披露负责人： | 张咏东 |
| 联系电话： | 021–68888917 |
| 传真： | 021–58408836 |
| 电子邮箱： | zhangyd@bankcomm.com |

5、信息披露

| | |
|---|---|
| 管理人互联网网址： | http://www.huaan.com.cn |
| 基金半年度报告置备地点： | 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

1、主要财务指标（未经审计）

| 财务指标 | 本报告期 |
|---|---|
| 基金本期净收益： | 127,466,088.80 |
| 加权平均基金份额本期净收益： | 0.2549 |
| 期末可供分配基金收益 | 34,328,823.53 |
| 期末可供分配基金份额收益 | 0.0687 |
| 期末基金资产净值： | 702,142,835.81 |
| 期末基金份额净值： | 1.4043 |
| 基金加权平均净值收益率 | 23.43% |
| 本期基金份额净值增长率 | 62.05% |
| 基金份额累计净值增长率 | 30.56% |

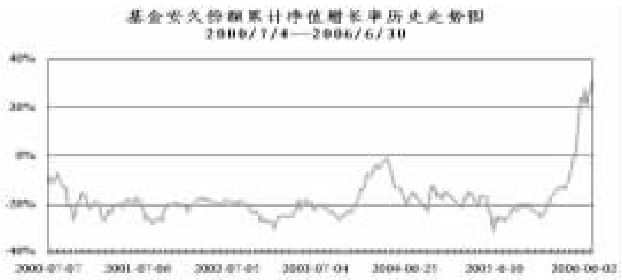
提示：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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 | 6.89% | 4.01% | –– | –– | –– | –– |
| 过去三个月 | 39.61% | 4.01% | –– | –– | –– | –– |
| 过去六个月 | 62.05% | 3.05% | –– | –– | –– | –– |
| 过去一年 | 74.04% | 2.58% | –– | –– | –– | –– |
| 过去三年 | 68.18% | 2.57% | –– | –– | –– | –– |
| 过去五年 | 57.82% | 2.30% | | | | |
| 自基金合同生效起至今 | 30.56% | 2.42% | –– | –– | –– | –– |

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现



### 四、管理人报告

1、基金管理人及基金经理情况

(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6月30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等5只开放式基金，管理资产规模达到344.88亿元。

(2)、基金经理

鲍泓先生，经济学学士，12年证券、基金从业经历。1994年加入天同证券公司，先后担任投资银行总部项目经理、资产管理总部研究员、经理助理等工作。2000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，从事行业与策略研究等工作。

2、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《安久证券投资基金基金合同》、《安久证券投资基金扩募说明书》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。

3、基金经理工作报告

(1)、行情回顾

2006年上半年A股市场呈现突破性的上扬行情，上证综合指数涨幅达到44%。上半年市场有几大突出特点：一是股改对价过程中的财富效应大幅显现，并且流通股东与非流通股东在这一过程中实现了双赢，接近帕累托最优状态，投资者对于资本市场的信心在此基础上开始重建；二是全流通后市场价格代表了更广泛的估值群体的看法，市值真正代表财富，这使企业的经营潜能大大激发，同时伴随资源的流入，上市公司投资价值得以提升；三是市场出现了较明显的结构分化，分享经济增长与人口红利的资源类、消费服务类企业，以及受益于装备升级并开始表现出一定国际竞争力的先进制造类企业都有出色表现，同时一批具备长期增长潜力并且内部治理结构良好的个股也开始享有更高的估值溢价。

（2）、操作回顾

安久基金上半年净值上涨62.05%，好于同期综合指数表现。从关注结构性机会、积极增持稀缺资源、分享经济增长成果的思路出发，我们对食品饮料、零售、医药、化工、机械以及有色等行业进行了重点的配置。同时，我们继续注重自下而上的选股思路，保持了一些具备长期核心竞争力的优质公司的投资力度。其中，有色、食品饮料、化工、地产、零售等行业的投资收到了相对良好的效果。

（3）、展望

我们总体对2006年乃至更长时间内的A股市场的投资机会持乐观态度。同时也应看到，经过上半年大幅的上涨，A股市场目前估值水平与同类市场相比已较为合理。此外，市场的均衡价格在过去一年的大幅上移必然会大大刺激发行供给，全流通及双Q等因素也在一定程度上限制了市场总体PE可能达到的高度。再有就是宏观调控及流通性收缩对投资品及资产价格的冲击也需引起一定的重视。

因此，A股市场的全面转好仍应是渐进的过程，一些结构性投资机会仍需积极把握。一是在经济增长方式转变背景下，消费服务类、先进制造类及稀缺的资源、能源类企业的长期投资机会；二是在宏观经济增长稳定性增强以及制度变革取得实质性突破背景下，上市公司的内涵及外延式增长带来的投资机会；三是在大规模扩容背景下优质新股的投资机会；四是继续给予内部治理结构良好、竞争优势明显的优质公司及具备战略并购价值的公司以溢价。

### 五、托管人报告

2006年上半年，托管人在安久基金的托管过程中，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。

2006年上半年，华安基金管理公司在安久基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。基金管理人遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作按照基金合同的规定进行。

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安久基金的半年度报告中财务指标、净值表现、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)

(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 |
|---|---|---|---|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 6,865,051.62 | 2,070,694.15 |
| 清算备付金 | | 43,471,336.54 | 4,631,266.98 |
| 交易保证金 | | 862,698.42 | 1,131,465.52 |
| 应收证券清算款 | | 0.00 | 5,088,361.21 |
| 应收股利 | | 0.00 | 0.00 |
| 应收利息 | | 1,920,719.17 | 530,072.47 |
| 其他应收款 | | 0.00 | 0.00 |
| 股票投资市值 | | 518,654,740.80 | 331,053,622.25 |
| 其中：股票投资成本 | | 350,428,837.27 | 304,785,745.22 |
| 债券投资市值 | | 143,952,539.98 | 90,653,244.00 |
| 其中：债券投资成本 | | 144,287,779.26 | 90,462,481.50 |
| 权证投资市值 | | 3,075,000.00 | 0.00 |
| 其中：权证投资成本 | | 3,151,651.97 | 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 | | 718,802,086.53 | 435,158,726.58 |
| | | | |
| 负债： | | | |
| 应付证券清算款 | | 14,223,011.84 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | | 832,716.50 | 521,202.32 |
| 应付托管费 | | 138,786.10 | 86,867.08 |
| 应付佣金 | | 461,173.57 | 349,282.92 |
| 应付利息 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他应付款 | | 750,000.00 | 750,000.00 |
| 卖出回购证券款 | | 0.00 | 0.00 |
| 预提费用 | | 253,562.71 | 130,000.00 |
| 负债合计 | | 16,659,250.72 | 1,837,352.32 |
| | | | |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |
| 未实现利得 | | 167,814,012.28 | 26,458,639.53 |
| 未分配收益 | | 34,328,823.53 | –93,137,265.27 |
| 持有人权益合计 | | 702,142,835.81 | 433,321,374.26 |
| 负债和所有者权益合计 | | 718,802,086.53 | 435,158,726.58 |
| 基金份额净值 | | 1.4043 | 0.8666 |

所附附注为本会计报表的组成部分

(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　　单位：人民币元

| 项　目 | 附注 | 2006年1–6月 | 2005年1–6月 |
|---|---|---|---|
| 收入： | | | |
| 股票差价收入 | | 115,798,679.55 | –27,931,889.15 |
| 债券差价收入 | | –508,808.24 | 298,184.23 |
| 权证差价收入 | | 10,105,239.98 | |
| 债券利息收入 | | 1,485,417.61 | 1,408,682.11 |
| 存款利息收入 | | 96,169.31 | 127,132.93 |
| 股利收入 | | 5,417,185.86 | 3,803,860.90 |
| 买入返售证券收入 | | 0.00 | 899.00 |
| 其他收入 | | 0.00 | 43,616.30 |
| 收入合计 | | 132,393,884.07 | –22,249,513.68 |
| | | | |
| 费用： | | | |
| 基金管理人报酬 | | 4,031,517.99 | 3,195,654.54 |
| 基金托管费 | | 671,919.63 | 532,609.15 |
| 卖出回购证券支出 | | 40,520.45 | 63,321.31 |
| 其他费用 | | 183,837.20 | 186,212.29 |
| 其中：上市年费 | | 29,752.78 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | | 119,014.74 | 119,012.93 |
| 审计费用 | | 24,795.19 | 24,795.19 |
| 费用合计 | | 4,927,795.27 | 3,977,797.29 |
| | | | |
| 基金净收益 | | 127,466,088.80 | –26,227,310.97 |
| 加：未实现估值增值变动数 | | 141,355,372.75 | –5,540,674.04 |
| 基金经营业绩 | | 268,821,461.55 | –31,767,985.01 |

所附附注为本会计报表的组成部分

(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　　单位：人民币元

| 项　目 | 附注 | 2006年1–6月 | 2005年1–6月 |
|---|---|---|---|
| 本期基金净收益 | | 127,466,088.80 | –26,227,310.97 |
| 加：期初未分配收益 | | –93,137,265.27 | –46,887,913.37 |
| 可供分配基金净收益 | | 34,328,823.53 | –73,115,224.34 |
| 减：本期已分配基金净收益 | | 0.00 | 0.00 |
| 期末基金未分配净收益 | | 34,328,823.53 | –73,115,224.34 |

所附附注为本会计报表的组成部分

(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　　单位：人民币元

| 项　目 | 附注 | 2006年1–6月 | 2005年1–6月 |
|---|---|---|---|
| 一、期初基金净值 | | 433,321,374.26 | 435,222,968.15 |
| 二、本期经营活动： | | | |
| 基金净收益 | | 127,466,088.80 | –26,227,310.97 |
| 未实现估值增值变动数 | | 141,355,372.75 | –5,540,674.04 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | | 268,821,461.55 | –31,767,985.01 |
| 三、本期向持有人分配收益 | | 0.00 | 0.00 |
| 四、期末基金净值 | | 702,142,835.81 | 403,454,983.14 |

所附附注为本会计报表的组成部分

(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于2005年7月1日起颁布的《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. 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. 本报告期重大会计差错：

无。

3. 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 | 基金管理人<br>基金发起人 | 提取管理费 | 基金契约 |
| 交通银行 | 基金托管人 | 提取托管费<br>银行间交易 | 基金契约<br>银行间成交单 |
| 上海国际信托投资有限公司 | 管理公司股东 | | |
| 上海电气(集团)总公司 | 管理公司股东 | | |
| 上海广电(集团)有限公司 | 管理公司股东 | | |
| 上海沸点投资发展有限公司 | 管理公司股东 | | |
| 上海工业投资(集团)有限公司 | 管理公司股东 | | |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。因此基金交易佣金比率是公允的。

(2).通过关联方席位进行的交易

①通过关联人席位的股票成交量：

本基金通过关联人席位2006年1–6月的股票交易情况：

无。

本基金通过关联人席位2005年1–6月的股票交易情况：

无。

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

②通过关联人席位的债券和回购成交量：

本基金通过关联人席位2006年1–6月的债券及回购交易情况：

无。

本基金通过关联人席位2005年1–6月的债券及回购交易情况：

无。

③本基金与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

本基金与关联人于2006年1–6月进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

无。

本基金与关联人于2005年1–6月进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

无。

(3).关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费，按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

H＝E × 1.5% ÷ 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（扣除本基金持有现金比例超过20%部分的基金资产净值）

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4,031,517.99元。（上年度的上半年：3,195,654.54元）

② 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0.25%的年费率计提，计算方法如下：

H＝E ×0.25% ÷ 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671,919.63元。（上年度的上半年：532,609.15元）

③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交通银行股份有限公司保管，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6,865,051.62元，2005年6月30日为6,973,762.13元。本基金2006年度1–6月由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为17,296.83元，2005年度1–6月为78,546.83元。

(4).基金各关联方投资本基金的情况

1、基金管理公司投资本基金的情况：

2006年度1–6月基金管理公司投资本基金的情况：

| 关联人 | 期初数 | | 本期间增持份额 | 本期间减持份额 | 期末数 | | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 持有份额 | 持有比例 | | | 持有份额 | 持有比例 | |
| 华安基金管理有限公司 | 9,582,100 | 1.92% | 0.00 | 0.00 | 9,582,100 | 1.92% | – |

2005年度1–6月基金管理有限公司投资本基金的情况：

| 关联人 | 期初数 | | 本期间增持份额 | 本期间减持份额 | 期末数 | | 适用费率 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 持有份额 | 持有比例 | | | 持有份额 | 持有比例 | |
| 华安基金管理有限公司 | 5,000,000 | 1.00% | 0.00 | 0.00 | 5,000,000 | 1.00% | – |

2、基金管理公司主要股东及其控制的机构在2005年上半年末和2006年上半年末投资本基金的情况：无。

4. 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：

A.因股权分置改革而暂时停牌的股票。本基金截至2006年6月30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 | 期末估值单价 | 复牌日 | 复牌日开盘价格 | 数量 | 总成本 | 总市值 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 方案沟通协商阶段停牌： | | | | | | | | |
| 600383 | 金地集团 | 2006–3–27 | 8.70 | 2006–07–11 | 9.43 | 315,940 | 2,836,157.67 | 2,748,678.00 |
| | 合　计 | | | | | 315,940 | 2,836,157.67 | 2,748,678.00 |

B.申购的新股。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。申购新股从新股申购日至新股上市日之间不能自由流通。

| 股票名称 | 数量 | 估值方法 | 转让受限原因 | 受限期限 | 总成本 | 总市值 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 中国银行 | 505,000 | 按成本估值 | 未流通 | 至2006–7–5上市 | 1,555,400 | 1,555,400 |
| 合计 | | | | | 1,555,400 | 1,555,400 |

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券情况如下：

无。

### 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 |
|---|---|---|---|
| 1 | 股票 | 518,654,740.80 | 72.16% |
| 2 | 债券 | 143,952,539.98 | 20.03% |
| 3 | 权证 | 3,075,000.00 | 0.43% |
| 4 | 银行存款和清算备付金 | 50,336,388.16 | 7.00% |
| 5 | 其它资产 | 2,783,417.59 | 0.39% |
| | 合计 | 718,802,086.53 | 100.00% |

(二)、股票投资组合

| 序号 | 行业分类 | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|---|---|---|---|
| B | 采掘业 | 61,867,199.82 | 8.81% |
| C | 制造业 | 285,697,550.33 | 40.69% |
| C0 | 食品、饮料 | 70,819,274.45 | 10.09% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 4,696,692.00 | 0.67% |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 42,011,135.39 | 5.98% |
| C5 | 电子 | 16,744,875.84 | 2.38% |
| C6 | 金属、非金属 | 31,033,794.68 | 4.42% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 68,489,531.42 | 9.75% |
| C8 | 医药、生物制品 | 51,902,246.55 | 7.39% |
| F | 交通运输、仓储业 | 25,830,000.00 | 3.68% |
| H | 批发和零售贸易 | 44,134,261.24 | 6.29% |
| I | 金融、保险业 | 47,737,573.36 | 6.80% |
| J | 房地产业 | 37,187,578.65 | 5.30% |
| K | 社会服务业 | 1,632,479.60 | 0.23% |
| M | 综合类 | 14,568,097.80 | 2.07% |
| 合计 | | 518,654,740.80 | 73.87% |

(三)、投资前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量 | 市值 | 占净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | G招行 | 5,951,311 | 46,182,173.36 | 6.58% |
| 2 | 600761 | G合力 | 2,250,432 | 32,563,751.04 | 4.64% |
| 3 | 600519 | G茅台 | 685,475 | 32,518,934.00 | 4.63% |
| 4 | 002021 | 中捷股份 | 4,146,786 | 31,100,895.00 | 4.43% |
| 5 | 600309 | G万华 | 1,900,418 | 27,727,098.62 | 3.95% |
| 6 | 600009 | G沪机场 | 1,800,000 | 25,830,000.00 | 3.68% |
| 7 | 000402 | G金融街 | 3,123,078 | 25,796,624.28 | 3.67% |
| 8 | 600276 | G恒瑞 | 1,059,460 | 25,045,634.40 | 3.57% |
| 9 | 600694 | 大商股份 | 613,300 | 25,028,773.00 | 3.56% |
| 10 | 600887 | G伊利 | 1,054,975 | 24,085,079.25 | 3.43% |

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.huaan.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、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名股票明细

| 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 | G招行 | 38,731,595.70 | 8.94% |
| 2 | 000983 | G西煤 | 27,430,348.64 | 6.33% |
| 3 | 600009 | G沪机场 | 25,267,870.04 | 5.83% |
| 4 | 000933 | G神火 | 24,977,432.48 | 5.76% |
| 5 | 600276 | G恒瑞 | 24,152,506.80 | 5.57% |
| 6 | 000002 | G万科A | 22,360,393.66 | 5.16% |
| 7 | 600887 | G伊利 | 20,754,604.97 | 4.79% |
| 8 | 002021 | 中捷股份 | 17,590,046.35 | 4.06% |
| 9 | 600694 | 大商股份 | 16,836,082.19 | 3.89% |
| 10 | 600456 | G宝钛 | 13,869,439.84 | 3.20% |
| 11 | 600519 | G茅台 | 13,241,125.66 | 3.06% |
| 12 | 600761 | G合力 | 10,971,003.78 | 2.53% |
| 13 | 000538 | G云白药 | 10,448,815.54 | 2.41% |
| 14 | 002007 | 华兰生物 | 10,260,807.75 | 2.37% |
| 15 | 600028 | 中国石化 | 9,660,716.05 | 2.23% |
| 16 | 000825 | G太钢 | 9,537,030.32 | 2.20% |
| 17 | 600123 | G兰花 | 9,007,788.41 | 2.08% |
| 18 | 600050 | G联通 | 8,454,372.10 | 1.95% |
| 19 | 600361 | G综超 | 8,351,417.25 | 1.93% |
| 20 | 600309 | G万华 | 7,590,599.14 | 1.75% |
| 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 | 600456 | G宝钛 | 30,595,279.49 | 7.06% |
| 2 | 000792 | G钾肥 | 25,785,406.48 | 5.95% |
| 3 | 600309 | G万华 | 25,361,095.87 | 5.85% |
| 4 | 000538 | G云白药 | 23,357,904.47 | 5.39% |
| 5 | 000002 | G万科A | 20,213,972.52 | 4.66% |
| 6 | 600000 | G浦发 | 19,598,717.00 | 4.52% |
| 7 | 600261 | G浙阳光 | 19,207,892.20 | 4.43% |
| 8 | 000970 | G三环 | 19,027,496.17 | 4.39% |
| 9 | 600489 | G中黄金 | 19,008,989.44 | 4.39% |
| 10 | 600348 | G国阳 | 18,128,487.98 | 4.18% |
| 11 | 000983 | G西煤 | 17,844,484.97 | 4.12% |
| 12 | 600583 | G海工 | 14,084,802.26 | 3.25% |
| 13 | 600008 | G首创 | 13,975,431.22 | 3.23% |
| 14 | 002041 | 登海种业 | 13,239,548.16 | 3.06% |
| 15 | 002025 | 航天电器 | 12,266,403.65 | 2.83% |
| 16 | 600438 | G通威 | 11,858,817.02 | 2.74% |
| 17 | 000933 | G神火 | 11,706,108.68 | 2.70% |
| 18 | 000869 | G张裕 | 11,691,806.49 | 2.70% |
| 19 | 600153 | G建发 | 10,487,336.31 | 2.42% |
| 20 | 600123 | G兰花 | 9,921,023.88 | 2.29% |
| 21 | 600361 | G综超 | 9,771,498.47 | 2.26% |
| 22 | 000911 | G南糖 | 9,482,017.08 | 2.19% |
| 23 | 600519 | G茅台 | 8,951,632.83 | 2.07% |

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： | 422,983,559.54 |
| 卖出股票的收入总额： | 491,822,599.33 |

* 注：买入股票的成本总额中未扣减股权分置获得的现金对价1,728,000.92元。

(五)、债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国债投资 | 99,018,309.00 | 14.10% |
| 2 | 金融债 | 44,934,230.98 | 6.40% |
| 3 | 转债 | 0.00 | 0.00 |
| | 合计 | 143,952,539.98 | 20.50% |

2、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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 010115 | 21国债⒂ | 387,740 | 38,913,586.40 | 5.54% |
| 2 | 010010 | 20国债⑽ | 254,250 | 25,516,530.00 | 3.63% |
| 3 | 010214 | 02国债⒁ | 203,320 | 20,415,361.20 | 2.91% |
| 4 | 050415 | 05农发15 | 200,000 | 19,990,000.00 | 2.85% |
| 5 | 060404 | 06农发04 | 150,000 | 14,824,230.98 | 2.11% |

(六)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 权证数量(张) | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 580005 | 万华HXB1 | 250,000 | 3,075,000.00 | 0.44% |

(七)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(八)、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。

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(元) |
|---|---|---|
| 1 | 深交所交易保证金 | 750,000.00 |
| 2 | 权证交易保证金 | 112,698.42 |
| 3 | 应收利息 | 1,920,719.17 |
| 4 | 待摊费用 | 0.00 |
| 5 | 应收证券清算款 | 0.00 |
| | 合计 | 2,783,417.59 |

4、处于转股期的可转换债券明细

本报告期末处于转股期的可转换债券情况：无。

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(张) | 成本总额(元) | 获得途径 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 580997 | 招行CMP1 | 1,149,486 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |
| 2 | 580005 | 万华HXB1 | 274,244 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |
| 3 | 580993 | 万华HXP1 | 411,366 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |
| 4 | 580990 | 茅台JCP1 | 1,020,627 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |
| 5 | 038008 | 钾肥JTP1 | 238,672 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |
| 6 | 580005 | 万华HXB1 | 250,000 | 3,151,651.97 | 二级市场买入 |

### 八、基金份额持有人户数和持有人结构

| 基金份额持有人户数 | 平均每户持有基金份额 |
|---|---|
| 6,630 | 75,414.78 |

| 持有人类型 | 份额(份) | 占总份额的比例 |
|---|---|---|
| 机构投资者持有的基金份额 | 410,275,064 | 82.06% |
| 个人投资者持有的基金份额 | 89,724,936 | 17.94% |

截止2006年6月30日，前十名持有人名称、持有份额及占总份额的比例如下：

| 序号 | 持有人名称 | 份额(份) | 占总份额的比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 新华人寿保险股份有限公司 | 49,285,141 | 9.86% |
| 2 | 中国人寿保险股份有限公司 | 48,461,614 | 9.69% |
| 3 | 中国人寿保险（集团）公司 | 47,957,015 | 9.59% |
| 4 | 招商证券–招行–招商证券基金宝集合资产管理计划 | 34,735,554 | 6.95% |
| 5 | 国泰君安–花旗–DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT | 32,195,048 | 6.44% |
| 6 | 中国人寿资产管理有限公司 | 24,485,018 | 4.90% |
| 7 | 泰康人寿保险股份有限公司 | 19,010,617 | 3.80% |
| 8 | 中国人民财产保险股份有限公司 | 17,772,085 | 3.55% |
| 9 | 申银万国–花旗–UBS LIMITED | 15,115,914 | 3.02% |
| 10 | 全国社保基金一零九组合 | 13,937,375 | 2.79% |

注：上述有关持有人数据是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司传送的截止2005年6月30日基金安久全部持有人名册汇总统计而来。

### 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. 本基金管理人于2006年2月15日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，经华安基金管理有限公司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. 本基金管理人于2006年5月27日发布关于变更公司董事长的公告：经华安基金管理有限公司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. 本基金管理人于2006年8月19日发布公告：经华安基金管理有限公司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，同时选举俞妙根先生代为履行公司董事长的职务。

4. 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行业高管任职资格的公告》。

(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)、基金收益分配事项：无。

(六)、基金改聘为其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 |
| – | – | – |
| 退租席位： | | |
| 券商名称 | 上交所席位数 | 深交所席位数 |
| 上海证券有限责任公司 | – | 1 |
| 方正证券有限责任公司 | 1 | – |

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 | 占总成交量比例 | 佣金 | 占总佣金比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券股份有限公司 | 2 | 172,892,210.01 | 19.10% | 141,200.53 | 19.43% |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | 77,750,851.12 | 8.59% | 63,039.50 | 8.68% |
| 平安证券有限责任公司 | 1 | 216,891,990.94 | 23.96% | 176,682.82 | 24.31% |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | 200,507,192.01 | 22.15% | 156,898.44 | 21.59% |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 88,549,397.73 | 9.78% | 72,554.15 | 9.98% |
| 联合证券有限责任公司 | 1 | 148,629,675.22 | 16.42% | 116,303.98 | 16.00% |
| 合　计 | | 905,221,317.03 | 100.00% | 726,679.42 | 100.00% |

(2).债券及回购交易情况：

| 券商名称 | 债券成交量 | 占总成交量比例 | 回购成交量 | 占总成交量比例 | 权证成交量 | 占总成交量比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 东方证券股份有限公司 | 23,025,916.40 | 16.52% | | 0.00% | | |
| 申银万国证券股份有限公司 | 6,526,431.00 | 4.68% | 65,000,000.00 | 76.47% | | |
| 平安证券有限责任公司 | 96,507,220.90 | 69.23% | 20,000,000.00 | 23.53% | 11,832,062.28 | 89.25% |
| 光大证券股份有限公司 | | 0.00% | | 0.00% | | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 13,350,954.80 | 9.58% | | 0.00% | 653,851.39 | 4.93% |
| 联合证券有限责任公司 | | 0.00% | | 0.00% | 771,534.58 | 5.82% |
| 合　计 | 139,410,523.10 | 100.00% | 85,000,000.00 | 100.00% | 13,257,448.25 | 100.00% |

(九)、其他重大事项：

| | 公告事项 | 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号码的公告 | 2006–06–20 |
| 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 | 2006–06–28 |

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)、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”。

**华安基金管理有限公司**

**2006年8月24日**