

兴安证券投资基金 2006年半年度报告摘要

基金管理人:华夏基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

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。

一、基金简介

(一)基金基本情况
1.基金名称:兴安证券投资基金
2.基金简称:基金兴安
3.交易代码:184718

2季度业绩明显超预期。
2006年上半年基金兴安及时提高了股票仓位并调整了股票结构。基金兴安始终保持75%左右的股票仓位,加强了行业和个股的选择,加大了食品饮料、商业、军工等行业投资力度,在个股选择上获得了超额收益,有效提升了本基金净值增长率,同时在房地产和有色两个行业及时在高位减持,在机械行业进行了谨慎增持。

在投资策略方面,基金兴安继续保持高比例的股票仓位,坚持不断优化股票资产组合,在保持行业适度均衡的前提下增加股票的行业集中度。企业的核心竞争力和估值水平始终是基金兴安选股的重要依据。

本基金管理人根据《兴安证券投资基金基金合同》与《兴安证券投资基金托管协议》,自2006年7月20日起报告兴安证券投资基金(以下简称“基金兴安”或“本基金”)的全部资产。现根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《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>》及其他相关规定,出具本托管人报告。

1.本托管人在托管基金兴安基金期间,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和本基金合同以及托管协议的规定,诚信地履行了基金托管人的职责,不存在损害基金兴安持有人利益的行为。

(1)其在基金资产净值的计算、基金费用开支等方面遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金会计核算办法》、本基金合同以及托管协议的规定;未发现其存在任何损害基金兴安持有人利益的行为。

(二)基金业绩表现
1.基金净值表现
(1)基金净值表现
截至2006年6月30日,本基金资产净值1,436,685,322.58元,基金份额净值1.451,165,829.64元。

(二)基金业绩表现
1.基金净值表现
(1)基金净值表现
截至2006年6月30日,本基金资产净值1,436,685,322.58元,基金份额净值1.451,165,829.64元。

Table with 4 columns: 2006年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间, 2006年6月30日止期间

Table with 4 columns: 基金份额(份), 占基金总资产比例, 本期买入(份), 本期卖出(份)

Table with 4 columns: 基金份额(份), 占基金总资产比例, 本期买入(份), 本期卖出(份)

根据中国证监会的有关规定,2006年5月18日起新股发行时不再单独向基金配售新股,基金可比照同一股数,战略投资者参与新股认购,其中基金作为一般股或战略投资者的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购配的新股,从新股获权日至新股上市之日之间不能自由转让。

此外,根据中国证券监督管理委员会发行监管部2002年4号文《关于向二级市场投资者配售新股有关问题补充通知》及后续规定,自2002年5月20日起,恢复向二级市场投资者配售新股。基金以持有的上市流通股票市值参与配售,但累计申购总额不得超过基金按规则可申购的总额,获配新股从新股获权日至新股上市之日之间不能自由流通。

Table with 5 columns: 成交申报日期, 上市日期, 可流通数量, 申购价格, 申购数量, 成交金额, 申购溢价率

六、投资组合报告
(一)报告期末基金资产组合情况
1. 股票
2. 债券
3. 权证
4. 资产支持证券
5. 其他资产

Table with 2 columns: 项目, 金额(元), 占总资产比例

Table with 3 columns: 序号, 行业分类, 股票市值(元), 市值占基金资产净值比例

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于本基金管理人网站www.ChinaAMC.com的年度报告全文。

(四)报告期内基金投资组合的重大变动
1.报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于本基金管理人网站www.ChinaAMC.com的年度报告全文。

(四)报告期内基金投资组合的重大变动
1.报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例

注:投资者欲了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读刊载于本基金管理人网站www.ChinaAMC.com的年度报告全文。

(四)报告期内基金投资组合的重大变动
1.报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

Table with 4 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例

Table with 4 columns: 2006年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间, 2006年1月1日至2006年6月30日止期间, 2006年6月30日止期间

3.报告期末买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table with 2 columns: 买入股票成本总额, 卖出股票收入总额

(五)报告期末按券种分类的债券投资组合

Table with 4 columns: 序号, 债券品种, 债券市值(元), 市值占基金资产净值比例

Table with 4 columns: 序号, 债券名称, 市值(元), 占净值比例

(七)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细
截至本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

(八)投资组合报告附注
1.报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

Table with 4 columns: 序号, 权证名称, 代码, 市值(元), 市值占基金资产净值比例, 获得方式

4.基金的其他资产构成

Table with 2 columns: 类别, 金额

5.至本报告期末,本基金持有的处于转股期的可转换债券明细
截至本报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

七、基金管理人、基金托管人、基金销售机构和基金持有人情况
截至2006年6月30日基金兴安持有人情况如下:

Table with 2 columns: 类别, 数量

Table with 3 columns: 机构投资者持有的基金份额, 个人投资者持有的基金份额, 未确认基金份额持有人的基金份额

Table with 3 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占基金份额比例

八、重大事件揭示
(一)本报告期本基金未召开基金份额持有人大会。

(二)经华夏基金管理有限公司第二届董事会2006年第二次会议决议,免去李操刚先生公司副总经理职务。

(三)本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)本报告期本基金投资策略未发生改变。

(五)本报告期本基金未发生收益分配事项。

(六)本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生变更。

(七)本基金管理人及基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。

(八)选择证券经营机构交易席位的情况
为了贯彻中国证监会的有关决定,我们制定了选择券商的标准,即:

Table with 5 columns: 序号, 券商名称, 租用席位数量, 股票交易量, 占股票交易总额比例, 应付佣金, 占应付佣金总额比例

2006年1月1日至2006年6月30日各券商交易、回购交易量情况如下:
单位:元

Table with 5 columns: 序号, 券商名称, 债券交易量, 占债券交易总额比例, 回购交易量, 占回购交易总额比例

(九)其他重大事件
1.本基金管理人于2006年6月12日发布华夏基金管理有限公司深圳分公司迁址公告;

2.本基金管理人于2006年6月1日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金资产支持证券投资方案的公告;

3.本基金管理人于2006年5月24日发布公告,调整旗下部分基金基金经理;
4.本基金管理人于2006年5月13日发布华夏基金管理有限公司公告,免去李操刚先生公司副总经理职务;

重要提示:下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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

Table with 2 columns: 主要会计数据和财务指标, 2006年1月1日至2006年6月30日

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益

Table with 4 columns: 序号, 基金本期收益, 基金本期净收益, 期末可供分配基金收益