# 华安创新证券投资基金

## 更新的招募说明书摘要

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　基金类型:契约型开放式

2006年第2号

### 一、基金合同的生效日期

华安创新证券投资基金经中国证监会2001年8月15日证监基金字[2001]33号文件《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》批准发起设立,基金合同于2001年9月21日正式生效。

### 二、重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2006年9月21日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日。

### 三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1. 名称:华安基金管理有限公司
2. 注册地址:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
3. 设立日期:1998年6月4日
4. 办公地址:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦2楼、37楼、38楼
5. 联系电话:(021)58881111
6. 联系人:冯颖
7. 注册资本:15,000万元人民币
8. 股权结构:

上海电气(集团)总公司持股20%、上海国际信托投资有限公司持股20%、上海工业投资(集团)有限公司持股20%、上海沸点投资发展有限公司持股20%、上海广电(集团)有限公司持股20%。

(二)主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

(1)董事会:

俞妙根先生,大学学历,高级经济师。历任上海申信进出口公司副经理,上海国际信托投资公司公关部科长、驻德国汉堡办事处总代表、AIT公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理,现任上海国际信托投资有限公司副总经理。

王成明先生,大学学历,高级经济师。历任上海市仪表电子工业供销公司副总经理、总经理、党委副书记,上海市仪电商社总经理兼党委书记,上海仪电控股(集团)公司副总裁、上海广电股份有限公司总经理、董事长,上海广电(集团)有限公司副总裁、总裁、党委副书记,上海电气(集团)总公司党委书记、董事长。

韩方河先生,研究生学历,高级经济师。历任上海市物价研究所所长,上海市物价局政策研究处处长,上海国际信托投资公司证券总部副总经理、证券投资信托部总经理,现任华安基金管理有限公司董事、总经理。

辜昌基先生,大专学历,高级工程师。历任上海合成纤维研究所副科长,中石化上海石化总厂涤编厂总工程师、厂长助理,中石化上海石化股份公司副总经理,中石化上海金山实业公司总经理,上海市经委副主任,现任上海工业投资(集团)有限公司董事长。

顾培柱先生,大专学历,高级经济师。历任上海电子管二厂车间副主任,上海电子管厂副科长、办公室主任,上海电子管六厂、二厂厂长、副厂长,上海灯泡厂厂长,上海真空电子器件股份有限公司常务副总经理、副董事长、董事长,上海广电(集团)有限公司副总裁兼上海广电电子股份有限公司董事长、上海广电NEC液晶显示器有限公司董事长,现任上海广电(集团)有限公司总裁。

张军先生,大学学历,会计师职称,中国注册会计师、中国注册税务师。历任湘财证券有限责任公司营业部、上海总部财务负责人,现任上海沸点投资发展有限公司投资部总经理。

独立董事:

萧灼基先生,研究生学历,教授。现任全国政协委员,政协经济委员会委员,北京大学经济学院教授,博士生导师,北京市、云南省、吉林省、成都市,武汉市等省市专家顾问,北京市场经济研究所所长,《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生,研究生学历,教授。历任上海财经大学科研处处长,上海财经大学南德管理学院院长,上海财经大学常务副校长,现任上海国家会计学院院长、党委书记,APEC金融与发展项目执行秘书处秘书长,兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

(2)监事会:

陈涵女士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长,现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

韩国璋先生,大学学历,高级经济师。历任上海木螺钉五厂党支部副书记,上海钢球厂党支部副书记、书记,上海钢球厂全质办副主任(主持)、综合办副主任(主持)、综合管理部副主任(主持),上海机电工业管理局局长秘书,上海机电控股(集团)公司办公室主任,上海电气(集团)总公司总裁助理兼集团办公室主任,现任上海电气(集团)总公司副总裁。

徐丹女士,研究生学历,高级会计师,中国注册税务师。历任上海石化总厂计财处会计、财务副科长,中石化上海金山实业公司财务处副处长,上海金山实业投资发展有限公司总会计师兼财务部主任,上海金山区财政局副局长,中石化上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实华经济发展公司财务部经理,现任上海工业投资(集团)有限公司总会计师。

戴金宝先生,研究生学历,高级经济师。历任上海无线电三厂供销科科员,上海无线电二厂设计科设计师、党委书记助理、纪委书记,上海广电股份有限公司(原上海广播电视集团公司)组织部长、办公室主任、董事会秘书处主任,现任上海广电(集团)有限公司战略发展部经理。

蒋位先生,研究生学历,经济师。曾在上海财经大学任讲师,上海市发展计划委员会工作,现任上海沸点投资发展有限公司投资部高级经理。

孙志方先生,研究生学历,经济师。曾在上海国际信托投资公司综合研究室、法律顾问室、证券投资信托部工作,历任华安基金管理有限公司监察稽核部总经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理、研究发展部总监。

(3)高级管理人员:

韩方河先生,研究生学历,高级经济师,23年经济、金融从业经验。历任上海市物价研究所所长,上海市物价局政策研究处处长,上海国际信托投资公司证券总部副总经理、证券投资信托部总经理,现任华安基金管理有限公司董事、总经理。

邵杰军先生,研究生学历,13年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理总部总经理助理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

姚毓林先生,研究生学历,13年证券和投资专业经验。曾是美国避险基金投资公司Berens Capital合伙人,并曾在美国道琼斯公司(Dow Jones)房屋抵押贷款债券部,美国高盛公司(Goldman Sachs)风险管理部和美国避险基金公司Alpha Asset Management工作,现任华安基金管理有限公司副总经理。

李炳旺先生,研究生学历,19年基金业工作经验。曾任国际证券投资信托公司资讯暨注册登记部主管、怡富证券投资信托公司注册登记与IT资讯部主管、综合规划部副总经理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

章国富先生,研究生学历,20年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师,上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹(集团)有限公司财务部副部长(主持工作)、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监,现任华安基金管理有限公司督察长。

2. 基金经理介绍

刘新勇先生,硕士,10年证券从业经历,曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999年5月加入华安基金管理有限公司后,曾任研究发展部高级研究员、华安中国A股基金的基金经理。

3. 本公司采取集体投资决策制度,投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

姚毓林先生,副总经理
王国卫先生,总经理助理、基金投资部总监
孙志方先生,总经理助理、研究发展部总监
陆敏慧女士,固定收益部副总监
诸 慧女士,集中交易部副总监

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 四、基金托管人

(一) 基金托管人基本情况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
公司法定英文名称:BANK OF COMMUNICATIONS CO.,LTD
法定代表人:蒋超良
住所:上海市浦东新区银城中路188号 邮政编码:200120
注册时间:1987年3月30日
注册资本:458.04亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号
联系人:张咏东
电话:021-68888917

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行,自1987年重新组建以来,交通银行各项业务和机构建设持续健康发展,目前在我国138个大中城市设有分支行,全行员工5万余人,截至2005年末,资产总额为14234.39亿元人民币,实现税后利润92.49亿元人民币。根据《银行家》杂志最新排名,交通银行按资产总额排名世界1000家大银行中第73位。2005年6月23日,交通银行成功在香港主板市场上市,成为首家在境外上市的内地商业银行。1998年被《欧洲货币》评为中国最佳银行,1999年被《环球金融》评为中国最佳银行,2005年被《金融亚洲》评为中国最佳银行。

交通银行总行设资产托管部,现有员工60余人。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

王滨先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,南开大学经济学博士,高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006年1月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

阮红女士,交通银行资产托管部总经理,复旦大学企业管理专业博士研究生学历,高级经济师。具有近二十年银行金融从业经验,在银行经营管理方面具有丰富的理论与实践经验。曾任交通银行调研部副主任科员、交通银行办公室秘书处主任科员、交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、交通银行办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、党委委员,2006年1月至今任交通银行资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况

截止2005年底,交通银行共托管证券投资基金31只,包括普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、兴科基金、安久基金、科汇基金、科讯基金、久富基金、华安创新基金、科瑞基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、湘财合丰系列基金(成长、周期、稳定)、鹏华普天系列基金(债券、收益)、海富通精选基金、博时现金收益证券投资基金、易方达50指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、鹏华中国50开放式证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、富国天益价值证券投资基金、华安宝利证券投资基金、国联优质成长证券投资基金、银河银富货币市场证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、湘财风险预算混合型证券投资基金等基金、万家公用事业证券投资基金,托管了2只QFII基金——日兴中国人民币国债母基金、日兴AM中国人民币A股母基金,同时交通银行也是全国社会保障基金两家托管行之一。托管总规模近1000亿元。

### 五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1. 直销机构:

(1)华安基金管理有限公司上海投资理财中心
地址:上海市浦东新区浦东南路360号新上海国际大厦2楼
电话:(021)68863400
传真:(021)68863223
联系人:程安至

(2)华安基金管理有限公司北京投资理财中心
地址:北京市西城区金融街23号平安大厦106室
电话:(010)66219999
传真:(010)66214060
联系人:刘彦珠

(3)华安基金管理有限公司电子交易平台
咨询及交易电话:40088-50099;(021)68604666
交易网站:www.huaan.com.cn
联系人:赵敏

2. 代销机构:

(1)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹榕
客户服务中心电话:95559

(2)中国工商银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:(010)66107911
传真:(010)66107914
联系人:田耕
客户服务中心电话:95588

(3)中国银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
电话:(010)66594909
传真:(010)66594853
联系人:王娟
客户服务中心电话:95566

(4)国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区商城路618号
法定代表人:祝幼一
电话:(021)62580818
传真:(021)62583439
联系人:芮敏祺
客户服务中心电话:4008888666
公司网站:www.gtja.com

(5)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:黎晓宏
电话:(010)65183888
传真:(010)65182261
联系人:魏明
客户服务中心电话:4008888108
公司网站:www.csc108.com

(6)渤海证券有限责任公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市河西区宾水道3号
法定代表人:张志军
电话:(022)28451883
传真:(022)28451616
联系人:徐焕强
公司网站:www.ewww.com

(7)海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53594566-4125
传真:(021)53858549
联系人:金芸
客户服务中心电话:(021)962503或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com

(8)申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
法定代表人:谢平
电话:(021)54033888
传真:(021)64736644
联系人:王序微
客户服务中心电话:(021)962505
公司网站:www.sywg.com.cn

(9)兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419125
传真:(021)68419867
联系人:缪白
客户服务中心电话:(021)68419125
公司网站:www.xyzq.com.cn

(10)招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39—45层
法定代表人:宫少林
电话:(0755)82943511
传真:(0755)82943237
联系人:黄健
客户服务中心电话:4008888111;(0755)26951111
公司网站:www.newone.com.cn

(11)中国银河证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:朱利
电话:(010)66568888
传真:(010)66568536
客户服务中心电话:(010)68016655
联系人:郭京华
公司网站:www.chinastock.com.cn

(12)广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河北路183号大都会广场36楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87555888
传真:(020)87557985
联系人:肖中梅
客户服务中心电话:(020)87555888
公司网站:www.gf.com.cn

(13)国信证券有限责任公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦21层
法定代表人:何如
电话:(0755)82130833
传真:(0755)82133302
联系人:林建闽
客户服务中心电话:800-810-8868
公司网站:www.guosen.com.cn

(14)长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:魏云鹏
电话:(0755)83516094
传真:(0755)83516199
联系人:高峰
客户服务中心电话:(0755)82288968
公司网站:www.cc168.com.cn

(15)湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:陈学荣
电话:(021)68634518
传真:(021)68865938
联系人:杜颖灏
客户服务中心电话:(021)68865020
公司网站:www.xcsc.com

(16)光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东南路528号证券大厦南塔15-17楼
法定代表人:王明权
电话:(021)68816000
传真:(021)68817271
联系人:刘晨
客户服务中心电话:10108998
公司网站:www.ebscn.com

(17)财富证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层
法定代表人:蒋永明
电话:(0731)4403343
传真:(0731)4403439
联系人:张治平
公司网站:www.cfzq.com

(18)世纪证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦40-42楼
法定代表人:段强
电话:(0755)83199599-8212
传真:(0755)83199545
联系人:章磊
客户服务中心电话:(0755)83199599
公司网站:www.csco.com.cn

(19)国海证券有限责任公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅峰
电话:(0771)5539262
传真:(0771)5539033
联系人:覃清芳
客户服务中心电话:4008888100
公司网站:www.ghzq.com.cn

(二)基金注册与过户登记人
名称:华安基金管理有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
电话:(021)58881111
传真:(021)68862332
联系人:朱永红
客户服务中心电话:40088-50099;(021)68604666

(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
负责人:韩炯
电话:(021)68818100
传真:(021)68816880
经办律师:韩炯、秦悦民

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区东昌路568号(200120)
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼(200021)
法定代表人:杨绍信
电话:(021)63863388
传真:(021)63863300
联系人:陈尚伟
经办注册会计师:汪棣、薛竞

### 六、基金的名称

本基金名称:华安创新证券投资基金。

### 七、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

### 八、基金的投资目标

基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极追求投资收益的稳定增长为目标,以诚信原则及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。

本基金的投资原则:

1. 本基金遵循诚信稳健原则,高度重视基金资产的安全性,力求更好地降低投资风险。

2. 本基金主要投资于在中国境内上市的创新类上市公司的股票和债券,以获取资本利得为主要投资目标。

3. 本基金将根据市场变化,灵活选择一定比例的短期投资,在防范风险的前提下,力求增加基金的收益。

4. 在严格遵守《基金法》、《试点办法》、《基金合同》等有关规定的前提下,基金管理人可根据具体情况,不断调整投资组合,提高投资组合的回报率,但基金的股票资产中至少有80%属于华安创新证券投资基金名称所显示的投资内容。

### 九、基金的投资方向

本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。

这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。

高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域,包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。

传统产业类型的上市公司中,如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。

本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素:公司创新能力强,主营业务市场空间大,财务状况良好,具有相当竞争优势等。

本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产,如国债和现金,从而保持基金资产良好的流动性。

### 十、基金的投资决策

(一)决策依据

1. 国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定;
2. 国内国际宏观经济环境;
3. 国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期;
4. 国家产业政策;
5. 各地区、各行业发展状况;
6. 上市公司研究;
7. 证券市场走势。

(二)投资流程

1. 投资决策委员会会议形成由参加会议成员签字的书面决议,确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议,由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理提议,可临时召开投资决策委员会会议。

2. 基金经理设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括:每日基金申购和赎回净现金流量;《基金合同》的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;基金经理的独立判断;风险分析小组的建议等。

3. 基金经理向集中交易室下达投资指令。交易员收到基金投资指令后,按时间优先、价格优先、综合平衡、比例分配原则完成指令。

4. 风险分析小组对开放式基金投资组合进行评估,向基金经理提出调整建议。

5. 监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

(三)基金投资限制

基金管理人应依据有关法令及《基金合同》规定,运作管理本基金:

1. 本基金投资组合应遵循下列规定:

① 本基金投资于股票、债券的比例,不低于本基金资产总值的80%;
② 本基金持有1家上市公司的股票,不超过本基金资产净值的10%;
③ 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有1家公司发行的证券的总和,不超过该证券的10%;
④ 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%;
⑤ 本基金股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;
⑥ 中国证监会的其它比例限制。

2. 禁止用本基金资产从事以下行为:

① 投资于其他证券投资基金;
② 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;
③ 动用银行信贷资金从事基金投资;
④ 将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款;
⑤ 从事证券信用交易;
⑥ 以基金资产进行房地产投资;
⑦ 从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
⑧ 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券;
⑨ 当时有效的法律、法规、规章、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

### 十一、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率(中信国债指数于2006年4月12日起更名为中信标普国债指数)。

当上述比较基准中参照的指数不再有效或被取消后,或基金管理人认为该等参照的指数收益率无法合理衡量本基金整体业绩时,基金管理人有权对上述基金整体业绩比较基准进行调整并公告。

### 十二、基金的风险收益特征

本基金的风险收益特征:无。

### 十三、基金的投资组合报告(未经审计)

(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。

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10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2006年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(二)基金投资组合报告

(1)基金资产组合

| 序号 | 资产组合 | 金额(元) | 占总资产比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 股票 | 1,828,657,160.36 | 68.41% |
| 2 | 债券 | 539,208,416.56 | 20.17% |
| 3 | 权证 | 0.00 | 0.00% |
| 4 | 银行存款和清算备付金合计 | 233,224,890.35 | 8.73% |
| 5 | 其他资产 | 71,903,642.22 | 2.69% |
|  | 合计 | 2,672,994,109.49 | 100.00% |

(2)股票投资组合

① 按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业分类 | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 18,597,566.85 | 0.71% |
| B | 采掘业 | 83,187,169.18 | 3.17% |
| C | 制造业 | 861,687,423.43 | 32.88% |
| C0 | 食品、饮料 | 298,379,000.00 | 11.38% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 11,284,000.00 | 0.43% |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 227,923,758.72 | 8.70% |
| C5 | 电子 | 1,744,297.19 | 0.07% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 113,684,367.52 | 4.34% |
| C8 | 医药、生物制品 | 208,672,000.00 | 7.96% |
| F | 交通运输、仓储业 | 24,069,780.00 | 0.92% |
| H | 批发和零售贸易 | 261,987,863.64 | 10.00% |
| I | 金融、保险业 | 206,651,647.16 | 7.88% |
| J | 房地产业 | 165,134,489.20 | 6.30% |
| K | 社会服务业 | 89,066,220.90 | 3.40% |
| M | 综合类 | 118,275,000.00 | 4.51% |
|  | 合计 | 1,828,657,160.36 | 69.77% |

② 基金投资前十名股票明细

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000061 | G农产品 | 19,380,000 | 234,304,200.00 | 8.94% |
| 2 | 600036 | G招行 | 20,000,000 | 198,800,000.00 | 7.59% |
| 3 | 600519 | G茅台 | 3,500,000 | 166,005,000.00 | 6.33% |
| 4 | 600858 | G银座 | 7,500,000 | 118,275,000.00 | 4.51% |
| 5 | 600309 | G万华 | 7,000,000 | 105,210,000.00 | 4.01% |
| 6 | 600276 | G恒瑞 | 4,700,000 | 100,392,000.00 | 3.83% |
| 7 | 600315 | G家化 | 4,645,310 | 75,207,568.90 | 2.87% |
| 8 | 000402 | G金融街 | 7,000,000 | 70,140,000.00 | 2.68% |
| 9 | 600583 | G海工 | 2,600,000 | 58,708,000.00 | 2.24% |
| 10 | 600383 | G金地 | 6,000,000 | 56,340,000.00 | 2.15% |

(3)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 | 国家债券 | 219,794,266.80 | 8.38% |
| 2 | 金融债券 | 318,490,856.16 | 12.15% |
| 3 | 企业债券 | 0.00 | 0.00% |
| 4 | 可转换债券 | 923,293.60 | 0.04% |
|  | 合计 | 539,208,416.56 | 20.57% |

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 | 050404 | 05农发04 | 850,000 | 86,606,500.00 | 3.30% |
| 2 | 010214 | 02国债⒁ | 595,740 | 59,806,338.60 | 2.28% |
| 3 | 040216 | 04国开16 | 500,000 | 53,051,000.00 | 2.02% |
| 4 | 060202 | 06国开02 | 500,000 | 49,060,000.00 | 1.87% |
| 5 | 060407 | 06农发07 | 400,000 | 39,862,904.11 | 1.52% |

(4)权证投资组合

① 基金投资前五名权证明细

本报告期末本基金所持有权证情况:无。

(5)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。

(6)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)的市场收盘价计算,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。

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 | 深圳结算保证金 | 3,150,710.43 |
| 2 | 上海权证担保金 | 54,054.05 |
| 3 | 深圳权证担保金 | 55,555.56 |
| 4 | 应收证券清算款 | 58,862,021.24 |
| 5 | 应收股利 | 388,800.00 |
| 6 | 应收利息 | 8,897,580.86 |
| 7 | 应收基金申购款 | 494,920.08 |
|  | 合计 | 71,903,642.22 |

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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 580008 | 国电JTB1 | 200,000 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |

(7)开放式基金份额变动

| 序号 | 项目 | 份额(份) |
|---|---|---|
| 1 | 期初基金份额总额 | 2,039,269,855.16 |
| 2 | 加:本期申购基金份额总额 | 49,198,838.88 |
| 3 | 减:本期赎回基金份额总额 | 356,881,277.23 |
| 4 | 期末基金份额总额 | 1,731,587,416.81 |

### 十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。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招募说明书。

(一)基金净值表现

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

(截至时间2006年6月30日)

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 2006年上半年 | 53.44% | 1.32% | 40.51% | 1.05% | 12.93% | 0.27% |
| 2005年度 | 6.52% | 1.03% | -3.11% | 0.99% | 9.63% | 0.04% |
| 2004年度 | -2.29% | 0.96% | -10.71% | 0.97% | 8.42% | -0.01% |
| 2003年度 | 17.84% | 0.75% | 2.12% | 0.82% | 15.72% | -0.07% |
| 2002年度 | -7.51% | 0.47% | -12.07% | 1.20% | 4.56% | -0.73% |
| 2001-9-21(基金合同生效日)至2001-12-31 | 1.20% | 0.12% | -6.42% | 1.43% | 7.62% | -1.31% |

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

### 十五、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1. 基金费用的种类

① 基金管理人的管理费;
② 基金托管人的托管费;
③ 证券交易费用;
④ 基金信息披露费用;
⑤ 基金份额持有人大会费用;
⑥ 与基金相关的会计师费和律师费;
⑦ 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2. 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

① 基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计算。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末,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,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

② 基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

③ 上述1中③至⑦项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

3. 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

4. 基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

(二)与基金销售有关的费用

1. 本基金申购费率(直销机构电子交易平台除外)分为1.0%、1.2%和1.5%三档。投资者在一天之内有多笔申购,适用费率按单笔分别计算:

一次申购金额高于1,000万元(含1,000万元)的,申购费率为申购金额的1.0%;

一次申购金额低于1,000万元但高于100万元(含100万元),申购费率为申购金额的1.2%;

一次申购金额低于100万元的,申购费率为申购金额的1.5%。

投资者通过直销机构电子交易平台申购本基金的费率为0.6%。

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金资产。

2. 本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.5%,按持有期递减。具体费率如下:

| 持有期 | 赎回费率 |
|---|---|
| 365天以内(含第365天) | 0.5% |
| 365天-730天(含第730天) | 0.3% |
| 730天-1095天(含第1095天) | 0.2% |
| 1095天-1460天(含第1460天) | 0.1% |
| 1460天以上 | 0 |

赎回费用由赎回人承担,在扣除不超过赎回总金额的0.1%的基金注册与过户登记费后,即当赎回费率大于0.1%(不包括0.1%)时,基金注册与过户登记费为赎回总金额的0.1%;当赎回费率小于或等于0.1%时,基金注册与过户登记费为赎回费用的75%,余额列入基金资产。

3. 转换费率

本基金管理人已开通了本基金与华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金之间的转换业务。目前本业务仅限于直销机构(上海投资理财中心、北京投资理财中心和电子交易平台)以及交通银行股份有限公司、中信建投证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、中国银河证券有限责任公司、海通证券股份有限公司、长城证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、湘财证券有限责任公司、国信证券有限责任公司、光大证券股份有限公司、世纪证券有限责任公司、国海证券有限责任公司和财富证券有限责任公司等部分代销机构办理。

转换费用包括转出基金的赎回费和转换申购补差费两部分。基金转换费用由基金份额持有人承担。

1)目前华安旗下各开放式基金的赎回费率如下,转出基金的赎回费根据持有人对该基金的持有期限适用相对应的费率确定。

| 基金名称 | 持有时间 | 赎回费率 |
|---|---|---|
| 华安创新 | 365天以内(含第365天) | 0.5% |
|  | 365天-730天(含第730天) | 0.3% |
|  | 730天-1095天(含第1095天) | 0.2% |
|  | 1095天-1460天(含第1460天) | 0.1% |
|  | 1460天以上 | 0 |
| 华安中国A股 | 全部 | 0 |
| 华安富利 | 全部 | 0 |
| 华安宝利 | 365天以内(含第365天) | 0.5% |
|  | 365天以上 | 0.25% |

2)转换申购补差费按转入基金与转出基金之间申购费率的差额计算收取,具体计算公式如下:

基金转换申购补差费率=max[(转入基金的申购费率-转出基金的申购费率),0],即转入基金申购费率减去转出基金申购费率,如为负数则取0

根据各开放式基金最新招募说明书或公告的约定,目前相关开放式基金申购费率如下:

| 基金名称 | 申购金额 | 申购费率(直销电子交易平台除外) |
|---|---|---|
| 华安创新 | 0≤M<100万 | 1.5% |
|  | 100万≤M<1000万 | 1.2% |
|  | M≥1000万 | 1% |
| 华安中国A股 | 0≤M<100万 | 1.5% |
|  | 100万≤M<1000万 | 1.2% |
|  | M≥1000万 | 0.9% |
| 华安富利 | 全部 | 0 |
| 华安宝利 | 0≤M<100万 | 1.2% |
|  | 100万≤M<1000万 | 1.1% |
|  | M≥1000万 | 1% |

目前,直销电子交易平台的申购费率如下,如中国证监会对于基金电子交易费率另有新规定,从其规定。

| 基金名称 | 申购费率(直销电子交易平台) |
|---|---|
| 华安创新 | 0.6% |
| 华安中国A股 | 0.6% |
| 华安富利 | 0 |
| 华安宝利 | 0.48% |

4. 基金管理人可视市场情况对上述费率进行调整,但申购费率最高不超过3%,赎回费率最高不超过1%。

基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调低申购费率、赎回费率或转换费率,调低后的申购费率、赎回费率和转换费率应在最新的招募说明书中列示。如在招募说明书或任何一份更新的招募说明书有效期间上述费率如发生变更,基金管理人最迟应于新的费率实施日3个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

5. 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调低基金申购费率、基金赎回费率或基金转换费率。

(三)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项规定如下:

① 以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

② 基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,自2004年1月1日起继续免征营业税和企业所得税(2003年:在年底前暂免征收营业税和企业所得税)。

③ 基金从证券市场中取得的其他收入包括股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税。

④ 自2005年1月24日起,基金买卖股票按成交额的0.1%缴纳证券(股票)交易印花税。(2005年1月24日之前,基金买卖股票按成交额的0.2%缴纳证券(股票)交易印花税。)

### 十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

| 章节 | 主要更新内容 |
|---|---|
| 三、基金管理人 | 更新了基金管理人"主要人员情况"。 |
| 四、基金托管人 | 更新了基金托管人的有关资料。 |
| 五、相关服务机构 | 更新了部分代销机构的信息。 |
| 九、基金的投资 | 更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。 |
| 十、基金的业绩 | 更新了基金合同生效以来的投资业绩。 |
| 二十一、对基金份额持有人的服务 | 在"(六)基金电子交易"部分,增加了上海浦东发展银行为华安"银基通"签约和资金结算银行。 |
| 二十二、其他应披露事项 | 披露了自2006年3月22日至2006年9月21日期间本基金的公告信息;<br>披露了公司总经理韩方河同志因涉嫌个人违纪,正在协助调查的事件。 |
| 其他文字性修改 | 新增华安基金管理有限公司的客户服务电话:40088-50099。 |

**华安基金管理有限公司**
**二〇〇六年十一月四日**