安瑞证券投资基金 2006年年度报告摘要

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2007 年 3 月 23 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招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

二、基金产品概况

(一)、基金概况

基金名称:	安瑞证券投资基金
基金简称:	基金安瑞
交易代码:	500013
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	本基金由金龙基金、沈阳万利基金、沈阳富民基金清理规范后合并而成。2000年 7 月 18 日华安基金管理有限公司开始管理基金安瑞。
期末基金份额总额:	5亿份
基金存续期:	15年(1992 年 4 月 29 日至 2007 年 4 月 28 日)
基金上市地点:	上海证券交易所
基金上市日期:	2001年 8 月 30 日

(二)、基金的投资

投资目标:	本基金投资于小型上市公司, 通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,获取长期的资本增值。
投资策略:	本基金为小市值基金,本基金的主要投资方向是小型上市公司,指投资时上市公司的总市值或流通市值低于市场平均水平。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%,其中投资于债券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 40-80%,现金比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中,70%投资于合同规定的小市值股票,30%投资于包括新股在内的其他上市公司股票, 在此基础上各自上下浮动 10%。当投资的股票市值因价格上涨等因素高于市场平均水平的 50%时,将作为非小市值股票进行统计。
业绩比较基准:	无
风险收益特征:	无

(三)、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(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 2 楼、37 楼、38 楼(邮政编码:200120)
法定代表人:	王成明
总经理:	俞妙根
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、40088-50099

(四)、基金托管人

基金托管人:	中国工商银行股份有限公司
注册及办公地址:	北京市西城区复兴门内大街 55 号(邮编:100032)
法定代表人:	姜建清
信息披露负责人:	蒋松云
联系电话:	010-66106912
传真:	010-66106904
电子邮箱:	songyun.jiang@icbc.com.cn

(五)、信息披露

信息披露报纸:	中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址:	http://www.huaan.com.cn
报告置备地点:	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

(六)、其他有关资料

会计师事务所:	上海立信长江会计师事务所有限公司
办公地址:	上海南京东路 61 号新黄浦金融大厦 4 楼
登记注册机构:	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
办公地点:	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(一)、主要财务指标

	2006年	2005年	2004年
基金本期净收益	251,156,864.32 元	-10,507,404.86 元	-6,135,596.51 元
加权平均基金份额本期净收益	0.5023 元	-0.0210 元	-0.0123 元
期末可供分配基金收益	196,868,393.20 元	-54,288,471.12 元	-47,191,897.67 元
期末可供分配基金份额收益	0.3937 元	-0.1086 元	-0.0944 元
期末基金资产净值	880,751,434.24 元	463,476,899.59 元	452,808,102.33 元
期末基金份额净值	1.7615 元	0.9270 元	0.9056 元
基金加权平均净值收益率	39.22%	-2.39%	-1.26%
本期基金份额净值增长率	90.02%	2.36%	-2.29%
基金份额累计净值增长率	105.27%	8.02%	5.53%

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。

(二)、净值表现

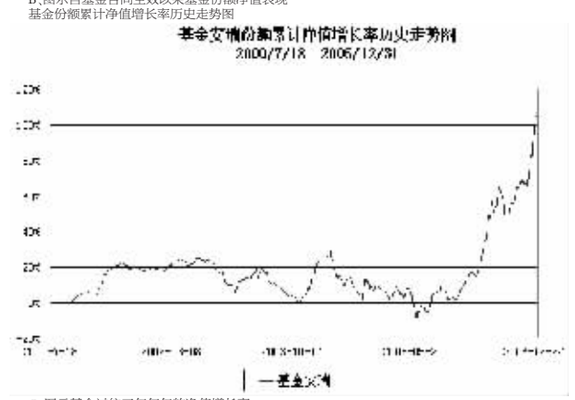
A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
过去三个月	24.80%	2.89%	-	-	-	-
过去六个月	26.06%	2.73%	-	-	-	-
过去一年	90.02%	2.79%	-	-	-	-
过去三年	90.06%	2.61%	-	-	-	-
过去五年	71.65%	2.26%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	105.27%	2.03%	-	-	-	-

备注:本基金合同中没有规定业绩比较基准。

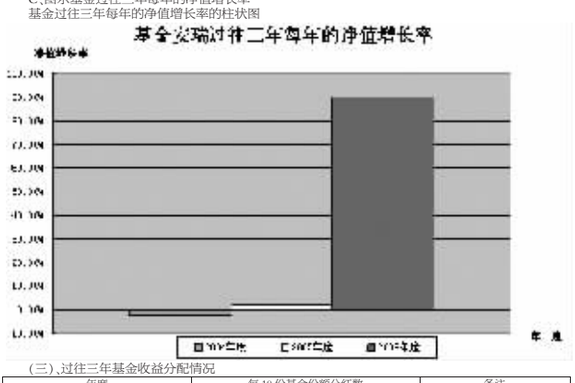
B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率历史走势图



C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金过往三年每年的净值增长率的柱状图



(三)、过往三年基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2006年度	-	
2005年度	-	
2004年度	-	
合计	-	

四、管理人报告

(一)、基金管理人及基金经理简介

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 12 月 31 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、华安宏利、180ETF、华安宏利、华安国际配置 7 只开放式基金,管理人民币资产 265.61 亿元,美元资产 1.98 亿美元。

基金经理:林义将先生,工学硕士,8 年证券、基金从业经历。曾在大鹏证券上海管理总部从事行业与上市公司研究工作。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。

(二)、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《安瑞证券投资基金基金合同》、《安瑞证券投资基金招募说明书》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。11 月 20 日安瑞基金申购"招商轮船"时发生透支,虽经及时处理未对基金利益造成影响,但收到了上海证券交易所的《关于华安基金管理有限公司透支申购新股"招商轮船"的关注函》。除此之外,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

(三)、基金经理工作报告

1、基金业绩表现

2006 年安瑞基金严格遵守基金契约规定的投资目标和投资策略,重点投资于小型上市公司,基金净值增长 90.02%。基金净值增长率超越中信小盘指数 3.6 个百分点, 股票组合收益率超越中信小盘指数 25.4 个百分点。

2、行情回顾

2006 年我国宏观经济超预期增长,资本市场发生了转折性变化。上市公司股权分置改革基本完成,解决了长期影响我国资本市场健康发展的重大历史遗留问题。股票市场扭转了四年来持续低迷的状态,投资者信心恢复,市场规模迅速扩大,上证指数全年上涨 130.43%,并创下历史新高。流通 A 股通过股改获取对价提升了投资价值,新增资金流入股市,推动了股指的持续上涨。为了抑制货币信贷总量过快增长,中国人民银行多次上调了存贷款利率和人民币存款准备金率,紧缩的货币政策没有改变股票市场的上涨趋势."新老划断三步走"在第二季度相继启动,快速扩容挤出了二级市场的部分资金,股票市场在第三季度震荡加剧。上市公司整体经营业绩在第二季度开始得到改善,市场对今、明两年公司盈利增长的乐观预期在整个下半年不断强化,推动市场整体估值水平持续走高。工商银行、中国银行、招商银行等权重股的飚升成就了金融行业的市场龙头地位,也直接推动了上证指数的大幅上涨。两市行业和个股分化严重,"二八现象"特征在第四季度表现得尤为明显:中信小盘指数在中信大盘指数大涨 55.94%的同时仅上涨了 7.52%,两市四成股票的股价逆势下跌。

3、操作回顾

装备制造业是为国民经济发展和国防建设提供技术装备的基础性产业,大力振兴装备制造业是实现国民经济可持续发展的战略举措。《国务院关于加快振兴装备制造业的若干意见》发布后,相关部门将陆续出台具体的实施细则,装备制造业将获得国家产业政策的支持。受房地产开发、资源开采、高速铁路建设、社会主义新农村建设以及出口等多种需求的拉动,工程机械行业迎来了新的发展机遇,相关上市公司盈利大幅增长。从行业月度主要经济指标看,2006 年的宏观调控对工程机械行业的实际影响相对较小。安瑞基金在 2006 年重点投资了工程机械、机床等机械制造行业,取得了良好的投资效果。

中小企业板指数 2006 年上涨 76.12%,落后上证指数 54.31 个百分点。中小企业板由于良好的成长性以及率先启动股改等因素在 2005 年市场低迷的时候有过上佳的表现。2006 年第二季度以来,两市主板公司业绩快速增长,中小板公司的成长性优势开始弱化。在主板公司股权分置改革迅速推进的 2006 年,2005 年已完成股改的中小板对资金的吸引力大为下降,而且随着其"小非"的解禁上市,对股价构成压力,中小企业板多为小型公司,是安瑞基金较好的投资目标。中小企业板相对落后的市场表现拖累了基金净值的增长。

国内钢铁新增产能受到宏观调控政策的严格限制, 大力发展装备制造业增加了钢材的国内需求,国内外钢材价差的存在拉动了出口需求的增长,钢材市场的结构性短缺为特定企业的盈利增长提供了有利的条件,我们在下半年增加了钢铁行业的配置。

4、2007 年展望

宏观调控不会改变经济的增长趋势,2007 年我国经济将继续保持较快的增长速度。宏观紧缩环境下的固定资产投资减速,不会显著降低上市公司的盈利能力,制度环境的改善、管理效率的提升、管理层股权激励机制的推出都有利于提升上市公司的长期盈利能力。安瑞基金重点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。虽然中信小盘指数 2006 年的涨幅落后中信大盘指数 41.38 个百分点,但我们认为这是特定市场环境下的阶段性结果,中信小盘指数过去十年的累计涨幅大幅超越了中信大盘指数。在新的一年里,我们将重点跟踪产业利润在不同行业之间的转移,以期在纷乱浮躁的市场中发现并把握新的投资主题。我们将重点关注先进装备制造、新能源等受到国家产业政策支持的行业,铁路设备、电网设备、通讯设备等受需求拉动的行业,上游原材料价格下降导致盈利能力提升的电解铝、航空等行业,受益于人民币升值的金融、房地产行业,存在价值重估潜力的煤炭、电力行业,积极寻求集团整体上市、资产置换、收购兼并等资产重组的投资机会。

本基金将于 2007 年 4 月 28 日到期,我们将按照相关法律法规和基金合同的要求,积极推动基金转型工作,感谢基金持有人长期以来对本基金的信任和支持,并期待在基金持有人的帮助下使转型获得成功,我们有信心在基金转型后管理得更好。

(四)、基金内部监察报告

本报告期内,监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发,由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查,同时推动公司风险控制机制的完善与优化,保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内,本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面:

(1)组织员工进行法律法规的学习,强化员工合规经营和风险控制意识;

(2)根据法律法规和监管规定的要求,推动公司和相关部门修订完善公司内控制度;

(3)完善投资交易系统控制功能,提高合规监察效率;

(4)开展基金运作稽核检查工作,通过定期检查、不定期抽查等工作方法,加强公司运作合规性控管。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,努力防范和控制各种风险,充分保障基金份额持有人的合法权益。

五、托管人报告

2006 年度,本托管人在对安瑞证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2006 年度, 安瑞证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在安瑞证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在 2006 年度所编制和披露的安瑞证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部　　2007 年 3 月 23 日

六、审计报告

本报告期本基金财务报告经上海立信长江会计师事务所有限公司审计,注册会计师吕秋萍、李刚出具了信长会师报字(2007)第 10108 号标准无保留意见的审计报告。

七、财务会计报告

(一)、资产负债表

二零零六年十二月三十一日

单位:人民币元

项　目	附注	2006年 12 月 31 日	2005年 12 月 31 日
资产:			
银行存款		63,229,737.13	23,800,802.71
清算备付金		4,091,842.11	571,733.51
交易保证金		598,780.49	848,780.49
应收证券清算款		9,996,265.73	2,156,692.31
应收股利		-	-
应收利息		1,786,538.52	1,734,929.65
其他应收款		-	-
股票投资市值		657,864,561.29	342,756,076.47
其中:股票投资成本		474,710,601.27	325,432,689.63
债券投资市值		180,249,649.30	96,311,946.20
其中:债券投资成本		179,719,601.13	95,869,962.33
权证投资市值		397,761.00	-
其中:权证投资成本		198,728.15	-
买入返售证券		-	-
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产合计		918,215,135.57	468,180,961.34
负债:			
应付证券清算款		34,719,025.43	3,352,120.45
应付管理人报酬		1,042,079.26	564,797.00
应付托管费		173,679.90	94,132.82
应付佣金		1,228,916.74	379,811.48
应付利息		-	-
应付收益		-	-
其他应付款		250,000.00	263,200.00
卖出回购证券款		-	-
预提费用		50,000.00	50,000.00
负债合计		37,463,701.33	4,704,061.75
所有者权益:			
实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		183,883,041.04	17,765,370.71
未分配收益		196,868,393.20	-54,288,471.12
持有人权益合计		880,751,434.24	463,476,899.59
负债和所有者权益合计		918,215,135.57	468,180,961.34
基金份额净值		1.7615	0.9270

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十二月三十一日止期间

单位:人民币元

项　目	附注	2006年度	2005年度
收入:			
股票差价收入		249,039,870.73	-12,902,971.98
债券差价收入		-478,144.53	509,255.26
权证差价收入		3,416,511.65	350,115.84
债券利息收入		3,816,855.60	2,913,648.89
存款利息收入		276,699.08	334,102.30
股利收入		7,237,190.30	6,432,638.90
买入返售证券收入		-	-
其他收入		13,200.00	6,836.37
收入合计		263,322,182.83	-2,356,374.42
费用:			
基金管理人报酬		9,486,369.57	6,609,006.08
基金托管费		1,581,061.57	1,101,501.10
卖出回购证券支出		718,926.61	86,931.23
利息支出		-	-
其他费用		378,960.76	353,592.03
其中:上市年费		60,000.00	60,000.00
信息披露费		240,000.00	240,000.00
审计费用		50,000.00	30,000.00
费用合计		12,165,318.51	8,151,030.44
基金净收益		251,156,864.32	-10,507,404.86
加:未实现估值增值变动数		166,117,670.33	21,176,202.12
基金经营业绩		417,274,534.65	10,668,797.26

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十二月三十一日止期间

单位:人民币元

项　目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		251,156,864.32	-10,507,404.86
加:期初未分配收益		-54,288,471.12	-43,781,066.26
可供分配基金净收益		196,868,393.20	-54,288,471.12
减:本期已分配基金净收益		-	-
期末基金未分配净收益		196,868,393.20	-54,288,471.12

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十二月三十一日止期间

单位:人民币元

项　目	附注	2006年度	*2005 年度
一、期初基金净值		463,476,899.59	452,808,102.33
二、本期经营活动:			
基金净收益		251,156,864.32	-10,507,404.86
未实现估值增值变动数		166,117,670.33	21,176,202.12
经营活动产生的基金净值变动数		417,274,534.65	10,668,797.26
三、本期向持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-	-
四、期末基金净值		880,751,434.24	463,476,899.59

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 2 号《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。

本基金为 2007 年内即将到期的封闭式基金。本基金 2006 年度会计报表以持续经营假设为基础编制。

1. 主要会计政策、会计估计及其变更:

本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. 重大会计差错的内容和更正金额:

2006 年度无重大会计差错更正。

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 基金发起人	提取管理费、持有本基金	基金合同
中国工商银行股份有限公司	基金托管人	提取托管费	基金合同
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)总公司	基金管理人股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东		
上海沸点投资发展有限公司	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		

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).通过关联方席位进行的交易

①本报告期(2006 年)本基金通过关联人席位的股票成交量:无。

本基金通过关联人席位 2005 年的股票交易情况: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。

席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款而订立的,因此基金交易佣金比率是公允的。

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本报告期(2006 年)通过关联人席位的债券、回购和权证成交量:无。

本基金通过关联人席位 2005 年的债券、回购和权证成交量:无。

③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 2006 年未进行银行间市场债券买卖和回购交易。

本基金与关联人 2005 年未进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(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,若持有现金比例超过本基金资产净值的 20%,超过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(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

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 9,486,369.57 元。(2005 年 6,609,006.08 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 1,581,061.57 元。(2005 年 1,101,501.10 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中国工商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 12 月 31 日保管的银行存款余额为 63,229,737.13 元, 2005 年 12 月 31 日为 23,800,802.71 元。本基金 2006 年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 244,776.58 元,2005 年度为 312,594.70 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 年度基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	年初数		本年增持份额	本年减持份额	年末数		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	6,318,119	1.26%	-	-	6,318,119	1.26%	申购你和证券市场交易价

2005 年度基金管理有限公司投资本基金的情况:

关联人	年初数		本年增持份额	本年减持份额	年末数		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	2,000,083	0.40%	4,318,036	-	6,318,119	1.26%	申购你和证券市场交易价

2、基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况:无

4. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产:

(1).本基金截至 2006 年 12 月 31 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	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
000728	S京化二	2006-10-12	9.97	07/03/19	10.46	100,000	571,050.09	997,000.00
合　计							571,050.09	997,000.00

(2)、　　基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,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获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下:

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	申购价格	年末估值单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
601628	中国人寿	06/12/28	07/01/09	18.88	18.88	108,000	2,039,040.00	2,039,040.00
合　计							2,039,040.00	2,039,040.00

(3).本基金持有以下因公布重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在所公布的事项的重大影响消除后,并经交易所批准后复牌。

股票名称	数量	总成本	总市值	期末估值单价	转让受限原因	停牌日	复牌日
东方电机	1,050,000	15,818,772.19	28,318,500.00	26.97	重大信息披露停牌	2006-12-20	2007-2-5
合　计		15,818,772.19	28,318,500.00				

(4).本基金截止本报告期末无流通受限债券。

八、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	657,864,561.29	71.65%
2	债券	180,249,649.30	19.63%
3	权证	397,761.00	0.04%
4	银行存款和清算备付金	67,321,579.24	7.33%
5	其他资产	12,381,584.74	1.35%
	合计	918,215,135.57	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
A	农、林、牧、渔业	28,305,084.13	3.21%
B	采掘业	87,437,445.88	9.93%
C	制造业	414,701,161.72	47.09%
C0	其中: 食品、饮料	34,072,400.00	3.87%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	997,000.00	0.11%
C5	电子	61,656,496.22	7.00%
C6	金属、非金属	63,285,321.18	7.19%
C7	机械、设备、仪表	254,689,944.32	28.92%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	12,805,805.45	1.45%
F	交通运输、仓储业	79,554,072.43	9.03%
H	批发和零售贸易	24,549,380.25	2.79%
I	金融、保险业	2,039,040.00	0.23%
J	房地产业	8,472,571.43	0.96%
	合计	657,864,561.29	74.69%

(三)、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	002021	中捷股份	7,504,012	63,784,102.00	7.24%
2	000157	中联重科	2,350,000	51,347,500.00	5.83%
3	000933	神火股份	4,437,719	49,879,961.56	5.66%
4	002025	航天电器	1,962,374	39,306,351.22	4.46%
5	600428	中远航运	2,800,000	30,604,000.00	3.47%
6	600009	上海机场	1,500,000	28,725,000.00	3.26%
7	600875	东方电机	1,050,000	28,318,500.00	3.22%
8	000829	赣南果业	1,172,233	25,097,508.53	2.85%
9	002028	思源电气	850,000	25,066,500.00	2.85%
10	600019	宝钢股份	2,800,000	23,856,000.00	2.71%

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	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000933	神火股份	59,782,920.53	12.90%
2	600019	宝钢股份	53,549,229.22	11.55%
3	000157	中联重科	51,539,988.84	11.12%
4	002028	思源电气	48,360,047.11	10.43%
5	600123	兰花科创	44,468,095.82	9.59%
6	002025	航天电器	42,460,473.09	9.16%
7	600428	中远航运	35,196,237.56	7.59%
8	600009	上海机场	34,993,644.97	7.55%
9	002021	中捷股份	33,870,175.40	7.31%
10	600028	中国石化	33,111,726.19	7.14%
11	600036	招商银行	32,175,830.33	6.94%
12	000858	五 粮 液	30,043,778.46	6.48%
13	000002	万　科 A	30,010,817.01	6.48%
14	002049	晶源电子	27,601,044.77	5.96%
15	000063	中兴通讯	26,196,735.78	5.65%
16	000625	长安汽车	24,897,194.65	5.37%
17	600153	建发股份	24,128,938.65	5.21%
18	000680	山推股份	23,716,549.82	5.12%
19	600089	特变电工	22,305,091.11	4.81%
20	600348	国阳新能	21,631,049.16	4.67%
21	000951	中国重汽	21,377,753.24	4.61%
22	600875	东方电机	20,457,498.24	4.41%
23	600050	中国联通	20,238,890.25	4.37%
24	000825	太钢不锈	20,211,858.74	4.36%
25	000927	一汽夏利	20,178,606.72	4.35%
26	600973	宝胜股份	19,212,338.54	4.15%
27	000829	赣南果业	18,861,764.49	4.07%
28	000410	沈阳机床	17,999,796.35	3.88%
29	000792	盐湖钾肥	17,807,419.81	3.84%
30	600219	南山铝业	17,753,777.52	3.83%
31	600795	国电电力	17,661,336.32	3.81%
32	002023	海特高新	16,881,666.57	3.64%
33	600216	浙江医药	16,617,758.26	3.59%
34	000878	云南铜业	15,147,354.88	3.27%
35	600309	烟台万华	15,068,234.40	3.25%
36	600323	南海发展	14,788,905.05	3.19%
37	600269	赣粤高速	14,223,275.58	3.07%
38	002041	登海种业	13,574,034.70	2.93%
39	002045	广州国光	13,122,079.81	2.83%
40	000039	中集集团	12,904,017.06	2.78%
41	600030	中信证券	12,559,624.55	2.71%
42	600479	千金药业	12,361,546.91	2.67%
43	600372	昌河股份	12,132,451.45	2.62%
44	600302	标准股份	11,547,614.32	2.49%
45	000783	S 石炼化	10,911,117.05	2.35%
46	000898	鞍钢股份	10,384,824.34	2.24%
47	601111	中国国航	10,225,696.86	2.21%
48	600900	长江电力	10,224,872.64	2.21%
49	600710	常林股份	10,095,507.78	2.18%
50	000061	农 产 品	10,011,449.48	2.16%
51	600677	航天通信	9,512,693.15	2.05%
52	000768	西　飞国际	9,472,601.76	2.04%
53	600379	S宝光	9,327,776.94	2.01%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000157	中联重科	83,393,403.31	17.99%
2	002028	思源电气	51,708,813.55	11.16%
3	000680	山推股份	41,115,884.39	8.87%
4	002041	登海种业	40,482,795.03	8.73%
5	600019	宝钢股份	40,304,694.19	8.70%
6	600348	国阳新能	38,830,808.92	8.38%
7	600123	兰花科创	35,944,281.07	7.76%
8	000825	太钢不锈	35,732,446.27	7.71%
9	600036	招商银行	34,290,400.46	7.40%
10	002045	广州国光	33,786,201.27	7.29%
11	000002	万　科 A	33,526,161.12	7.23%
12	600028	中国石化	33,415,854.05	7.21%
13	002021	中捷股份	33,069,543.72	7.14%
14	600216	浙江医药	32,765,050.64	7.07%
15	600438	通威股份	31,940,469.65	6.89%
16	600875	东方电机	29,076,336.05	6.27%
17	002023	海特高新	28,722,262.80	6.20%
18	000951	中国重汽	27,743,136.69	5.99%
19	600302	标准股份	25,516,001.88	5.51%
20	000063	中兴通讯	25,429,184