# 兴安证券投资基金 2006年年度报告摘要

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2007年3月24日复核了本报告中的财务指标、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，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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。本报告期自2006年1月1日起至2006年12月31日止。

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。

**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
4、基金运作方式：契约型封闭式
5、基金合同生效日：2000年7月20日
6、报告期末基金份额总额：500,000,000份
7、基金合同存续期：15年
8、基金份额上市交易所：深圳证券交易所
9、基金上市日期：2000年9月20日

（二）基金产品说明

1、基金投资目标：本基金重点投资于具有核心竞争能力，主营业务具有持续成长性，符合国民经济产业升级和结构调整方向的上市公司。本基金将通过积极进取的投资策略，在尽可能分散和规避投资风险的前提下，谋求基金资产长期稳定的增值。

2、基金投资策略：本基金将重点投资于具有核心竞争能力，主营业务具有持续成长性，符合国民经济产业升级和结构调整方向的上市公司。

3、业绩比较基准：无

4、风险收益特征：无

（三）基金管理人有关情况

1、基金管理人名称：华夏基金管理有限公司
CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.
2、注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区A区
3、办公地址：北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
4、邮政编码：100032
5、法定代表人：凌新源
6、信息披露负责人：张弘弢
7、联系电话：（010）88066688
8、传真：（010）88066566
9、国际互联网址：http://www.ChinaAMC.com
10、电子邮箱：chinaamc@ChinaAMC.com

（四）基金托管人有关情况

1、基金托管人名称：中国银行股份有限公司（简称"中国银行"）
2、注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号
3、办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
4、邮政编码：100818
5、法定代表人：肖钢
6、信息披露负责人：宁敏
7、联系电话：（010）66594977
8、传真：（010）66594942
9、国际互联网址：http://www.BOC.cn
10、电子邮箱：tgxxpl@bank-of-china.com

（五）信息披露事宜

登载年度报告正文的管理人网址：www.ChinaAMC.com
基金年度报告置备地点：基金管理人、基金托管人的办公地址

**二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况**

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。

（一）主要财务指标

| 项目 | 2006年 | 2005年 | 2004年 |
|---|---|---|---|
| 1,基金本期净收益 | 288,001,708.68元 | –17,866,686.69元 | 51,184,758.58元 |
| 2,基金份额本期净收益 | 0.5760元 | –0.0357元 | 0.1024元 |
| 3,期末可供分配基金收益 | 267,104,810.78元 | –20,896,897.90元 | –3,030,211.21元 |
| 4,期末可供分配基金份额收益 | 0.5342元 | –0.0418元 | –0.0061元 |
| 5,期末基金资产净值 | 1,083,904,759.47元 | 512,766,286.32元 | 496,986,683.23元 |
| 6,期末基金份额净值 | 2.1678元 | 1.0255元 | 0.9940元 |
| 7,基金加权平均净值收益率 | 39.47% | –3.55% | 9.89% |
| 8,本期基金份额净值增长率 | 111.39% | 3.17% | –3.99% |
| 9,基金份额累计净值增长率 | 123.36% | 5.66% | 2.42% |

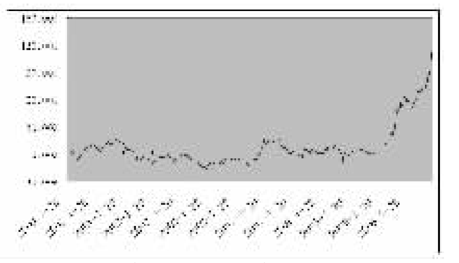
（二）基金净值表现及收益分配情况

1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差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 | 31.93% | 3.18% | – | – | – | – |
| 过去六个月 | 37.38% | 2.90% | – | – | – | – |
| 过去一年 | 111.39% | 3.07% | – | – | – | – |
| 过去三年 | 109.39% | 2.79% | – | – | – | – |
| 过去五年 | 133.67% | 2.50% | – | – | – | – |
| 自基金成立至今 | 123.36% | 2.34% | – | – | – | – |

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

兴安证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图



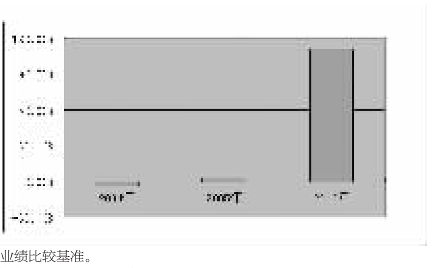
（2000年7月20日至2006年12月31日）

注：1、本基金无业绩比较基准。

2、本基金投资于股票、债券的比例不低于基金资产总值的80%；投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%；持有一家上市公司的股票，不得超过基金资产净值的10%；本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和，不得超过该证券的10%；遵守中国证监会规定的其他比例限制。本基金按规定自本基金上市之日起六个月内达到上述规定的投资比例。

3、过往三年基金每年净值增长率的柱形图

兴安证券投资基金过往三年每年净值增长率的柱形图



注：本基金无业绩比较基准。

4、过往三年本基金无收益分配事项。

**三、管理人报告**

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司。华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准的首批全国性基金管理公司之一，注册资本13800万元。公司总部设在北京，在北京、上海和深圳设有分公司。

截至2006年12月，公司管理资产规模792亿元人民币，管理着基金兴华、基金兴和、基金兴科、基金兴安4只封闭式基金，华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板ETF、华夏稳增、华夏回报二号、华夏优势增长11只开放式基金，以及亚洲债券基金二期中国子基金和全国社保基金投资组合，是国内管理基金数目最多的基金管理公司，也是管理资产规模最大的基金管理公司之一。

2、基金经理简介

刘文动先生，硕士。曾任鹏华基金管理有限公司投资总部副总经理兼机构理财部总监，平安保险集团投资管理中心组合经理助理、平安证券有限责任公司研究员。2006年加入华夏基金管理有限公司。现任华夏基金管理有限公司投资总监、兴安证券投资基金基金经理（2006年5月起任职）、兴华证券投资基金基金经理（2007年2月起任职）。

（二）报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

（三）报告期内基金的业绩表现和投资策略

1、本基金业绩表现

截至2006年12月31日，本基金份额净值为2.1678元，本报告期份额净值增长率为111.39%，同期上证综指上涨130.43%，深圳成指上涨132.12%。

2、行情回顾及运作分析

2006年是中国资本市场大发展的一年。股权分置改革基本完成，上证A股指数大幅上涨至年底的2815点，比上年底上涨了130%。沪深A股流通市值达到24000亿元左右，与2005年11109亿元相比增加了约116%。

在本轮股市上涨过程中，人民币升值、消费升级和产业结构升级成为主线，食品、银行、有色、房地产、机械、旅游成为领涨行业，电力、煤炭、电子、家电等行业表现落后。本轮股市上涨是自2001年指数大幅下跌后的第一次大幅上涨，其核心原因来自中国经济快速增长和在世界经济中地位提升的背景下股票价格低估，同时股改对价提升公司估值吸引力、业绩增长承诺和股权激励促使上市公司业绩增长不断超过预期。人民币长期升值趋势下，外资涌入和人民消费意愿不断增强、持续上涨的行情所带来的财富效应吸引了大量储蓄资金流入股市等。

在中国A股市场升温的同时，2006年，基金业获得爆发式增长。全年新设立基金89只，首发规模达到3888亿元，同比增长了288%；新增开户数突破700万户，较年初增长超过300%。其中，新设立偏股型基金68只，首发总规模3153亿元，投资者对基金的认可和投资热情达到历史顶峰，基金发行出现井喷，一个多月时间里发行了6家100亿元规模以上的基金，市场参与者的结构发生了巨大的变化。

基金兴安投资风格稳健，始终保持75%以上的仓位，行业配置上保持一定的均衡性，精选个股，机械、食品等行业配置和个股选择带来全年的超额收益。组合中部分成长股在第4季度面临市场资金追逐大盘股的短期压力。

整体来看，基金兴安在2006年整体表现良好，前3季度的投资取得不错成绩，在成长股投资方面获得超额收益，把握了军工、有色、地产、食品和商业等投资机会，并适时调整了行业配置。4季度对银行、地产、钢铁等处于估值洼地，且成长性尚好的板块投资略显不足，同时组合中的成长股表现平平，因而没有使得前三季的投资业绩更上一层楼，是2006年缺憾之处。基金兴安积极反思，在12月及时调整组合，为2007年的投资做好布局。

3、市场展望和投资策略

展望2007年，尽管在2006年市场累计升幅巨大，但上市公司股权激励效应显现、企业盈利超过预期、税制改革预期、人民币持续升值等因素仍支持中国股市长期走好，长期牛市的趋势并没有改变。

从长期投资角度来看，基金兴安仍将把研究和投资的重点放在消费升级等相关领域，人民币升值仍然是基金兴安最关注的投资背景，金融、食品、旅游、地产和商业等消费服务业仍是关注的重点行业，同时随着国家经济实力的壮大和政治地位的提高，先进装备制造业同样值得长期关注。

从中期投资来看，相比其他投资渠道，A股市场的投资价值明显，资金将持续流入，投资者的结构将不断变化和多元化，股票市场的活跃性和流动性将进一步提升，企业的核心竞争力和长期成长性仍然是股票投资价值的首选评估指标，基金兴安看好成长股的投资表现。

展望2007年上半年，市场的整体市盈率短期达到合理区间，能否进一步提升更多依靠资金的推动，证券市场总体进一步大幅上涨更多依靠估值水平的上升，主动进行行业轮动选择所面临的风险也在加大。同时随着中国经济的发展，大型国有企业仍然是中国经济大多数支柱性行业的龙头企业，将逐渐加入与世界同类巨头的竞争行列，进一步做大做强是势在必行的。资本市场为国有企业的做大做强提供了良好的外部环境和支持平台，基金兴安关注国有企业尤其是央企在中国资本市场的作为带来的投资机会。同时相关产业的主题投资也值得重点关注，例如高速铁路、循环经济新能源、新材料、自主创新设备、奥运、数字电视、3G等。

基金兴安将继续以"为信任奉献回报"为宗旨，全力为基金持有人提供长期稳定的回报。

（四）为投资人提供的服务

1、向投资者发放普及性基金知识宣传材料

本基金管理人组织专业人员撰写并印制了介绍基金理财知识的宣传资料，并通过销售机构向投资者发放。为了方便投资者，本基金管理人互联网站专门设立知识课堂，供投资者浏览阅读有关普及基金知识的电子文档。另外，为了保证宣传活动的覆盖面，本基金管理人每季度在为投资者邮寄基金账户对账单的同时寄送"客户服务问答"等资料，总结常见的问题，向投资者介绍基金投资业务规则等基本知识。

2、开展"理财365活动"，进行面对面的宣传普及工作

本基金管理人与代销机构合作，在全国范围内开展了"理财365活动"，截止到2006年12月31日共组织报告会221场，活动期间向投资者讲解正确的基金投资理念和基本的基金理财知识，引导投资者树立长期投资理念，帮助投资者选择适合自己风险承受能力的基金产品。此外，本基金管理人还于每月开展网络嘉宾聊天活动，由基金经理在网上与投资者直接沟通、宣传成熟的基金投资理念等。

3、公开风险提示

本基金管理人通过电视台专访、全国30余家重点平面媒体宣传、在各门户网站刊登宣传文章等形式，在行业内较早的对投资者进行了风险提示，并在本基金管理人各直销网点专门设置了风险提示公告。

通过上述宣传活动，本基金管理人加强了对投资者的教育，普及了基金知识，对提高投资者的风险意识达到了良好的效果。

**四、托管人报告**

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称"本托管人"）在对兴安基金（以下称"本基金"）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、基金合同和托管合同的有关规定，不存在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。

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管合同的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本年度报告中的财务指标、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真实、准确和完整。

**中国银行股份有限公司**
2007年3月24日

**五、审计报告**

普华永道中天审字(2007)第20464号

兴安证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的兴安证券投资基金(以下简称"基金兴安")会计报表，包括2006年12月31日的资产负债表、2006年度的经营业绩表及基金净值变动表以及会计报表附注。

一、管理层对会计报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《兴安证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制会计报表是基金兴安的基金管理人华夏基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

（1）设计、实施和维护与会计报表编制相关的内部控制，以使会计报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

（2）选择和运用恰当的会计政策；

（3）作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对会计报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对会计报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关会计报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的会计报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与会计报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价会计报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述会计报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《兴安证券投资基金基金合同》及中国证券监督管理委员会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了基金兴安2006年12月31日的财务状况以及2006年度的经营成果和基金净值变动。

**普华永道中天　　注册会计师　　汪棣**
**会计师事务所有限公司　　注册会计师　　魏琦**
**中国　上海市**　　2007年3月23日

**六、财务会计报告**

（一）基金会计报表

兴安证券投资基金
2006年12月31日资产负债表
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

| | 附注 | 2006年12月31日 | 2005年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产 | | | |
| 银行存款 | 7a | 191,958,196.72 | 33,164,938.64 |
| 清算备付金 | 7b | 7,500,554.38 | 247,765.00 |
| 交易保证金 | 7b | 638,549.12 | 440,099.81 |
| 应收证券清算款 | | 8,685,210.76 | – |
| 应收利息 | 7c | 1,810,802.58 | 1,934,637.32 |
| 其他应收款 | | 675.78 | 675.78 |
| 股票投资市值 | | 848,302,900.55 | 347,723,761.96 |
| 其中：股票投资成本 | | 531,693,418.30 | 314,069,557.08 |
| 债券投资市值 | | 220,136,806.40 | 135,016,735.30 |
| 其中：债券投资成本 | | 219,962,920.45 | 135,007,755.96 |
| 权证投资市值 | | 7,827,050.00 | – |
| 其中：权证投资成本 | | 7,810,469.51 | – |
| 资产总计 | | 1,286,860,746.29 | 518,528,613.81 |
| 负债及持有人权益 | | | |
| 负债 | | | |
| 应付证券清算款 | | 197,303,228.53 | 3,824,442.34 |
| 应付管理人报酬 | | 1,249,428.88 | 627,200.25 |
| 应付托管费 | | 208,238.12 | 104,533.36 |
| 应付佣金 | 7d | 3,034,889.77 | 545,950.02 |
| 其他应付款 | 7e | 1,100,201.52 | 600,201.52 |
| 预提费用 | 7f | 60,000.00 | 60,000.00 |
| 负债合计 | | 202,955,986.82 | 5,762,327.49 |
| 持有人权益 | | | |
| 实收基金 | 7g | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |
| 未实现利得 | 7h | 316,799,948.69 | 33,663,184.22 |
| 未分配收益/(累计基金净损失) | | 267,104,810.78 | (20,896,897.90) |
| 持有人权益合计 | | 1,083,904,759.47 | 512,766,286.32 |
| (2006年末每份基金份额净值：2.1678元) | | | |
| (2005年末每份基金份额净值：1.0255元) | | | |
| 负债及持有人权益总计 | | 1,286,860,746.29 | 518,528,613.81 |

兴安证券投资基金
2006年度经营业绩表及收益分配表
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

| | 附注 | 2006年度 | 2005年度 |
|---|---|---|---|
| 收入/(损失) | | | |
| 股票差价收入/(损失) | 7i | 271,220,999.68 | (17,528,297.75) |
| 债券差价收入 | 7j | 241,544.83 | 134,072.81 |
| 权证差价收入 | 7k | 18,619,802.60 | 349,194.97 |
| 债券利息收入 | | 4,445,762.23 | 3,408,851.42 |
| 存款利息收入 | | 782,284.55 | 203,842.82 |
| 股利收入 | | 7,510,613.77 | 4,852,004.62 |
| 买入返售证券收入 | | – | – |
| 其他收入 | 7l | 90.75 | 22,500.79 |
| 收入/(损失)合计 | | 302,821,098.41 | (8,557,830.32) |
| 费用 | | | |
| 基金管理人报酬 | | (10,789,019.62) | (7,556,262.90) |
| 基金托管费 | | (1,798,169.97) | (1,259,377.18) |
| 卖出回购证券支出 | | (1,824,226.42) | (109,557.74) |
| 其他费用 | 7m | (407,973.72) | (383,658.55) |
| 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 | | (60,000.00) | (60,000.00) |
| 费用合计 | | (14,819,389.73) | (9,308,856.37) |
| 基金净收益/(损失) | | 288,001,708.68 | (17,866,686.69) |
| 加：未实现估值增值变动数 | | 283,136,764.47 | 33,646,289.78 |
| 基金经营业绩 | | 571,138,473.15 | 15,779,603.09 |
| 本年基金净收益/(损失) | | 288,001,708.68 | (17,866,686.69) |
| 减：年初累计基金净损失 | | (20,896,897.90) | (3,030,211.21) |
| 可供分配基金净收益/累计基金净损失 | | 267,104,810.78 | (20,896,897.90) |
| 减：本年已分配基金净收益 | | – | – |
| 年末未分配基金净收益/累计基金净损失 | | 267,104,810.78 | (20,896,897.90) |

兴安证券投资基金
2006年度基金净值变动表
(除特别注明外，金额单位为人民币元)

| | | 2006年度 | 2005年度 |
|---|---|---|---|
| 年初基金净值 | | 512,766,286.32 | 496,986,683.23 |
| 本年经营活动 | | | |
| 基金净收益/(损失) | | 288,001,708.68 | (17,866,686.69) |
| 未实现估值增值变动数 | | 283,136,764.47 | 33,646,289.78 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 | | 571,138,473.15 | 15,779,603.09 |
| 本年向基金持有人分配收益 | | | |
| 向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数 | | – | – |
| 年末基金净值 | | 1,083,904,759.47 | 512,766,286.32 |
| 后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。 | | | |

（二）会计报表附注

（除特别注明外，金额单位为人民币元）

1、主要会计政策和会计估计

（1）会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

（2）记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

（3）记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

（4）基金资产的估值原则

股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。2006年11月13日之前由非公开发行形成的暂时流通受限股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；2006年11月13日起由非公开发行形成的暂时流通受限股票，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价低于非公开发行股票的初始成本，按市场交易均价估值，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价高于非公开发行股票的初始成本，按两者差价在非公开发行股票锁定期的摊销金额与初始成本之和估值。

债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值。

银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

权证投资

从获赠确认日、买入成交确认日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

实际投资成本与估值的差异计入"未实现利得/(损失)"科目。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（5）证券投资基金成本计价方法

股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价时冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/（损失）。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资，后于权证实际取得日按本会计报表附注3(5)权证投资中所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/（损失）；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/（损失）。出售债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证成本。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

（6）待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用采用直线法在受益期间内逐日摊销。

（7）收入/（损失）的确认和计量

股票差价收入/（损失）于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/（损失）于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/（损失）于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/（损失）按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认。资产支持证券利息收入按凭证票面价值与基金管理人预期的收益率计算的金额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

（8）费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提。如果由于卖出回购证券和现金分红以外原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的20%，超过部分不计提基金管理人报酬。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

待摊费用反映已经支付的、影响基金份额净值小数点后第五位，应于各受益期分摊的费用。

预提费用反映尚未支付的、影响基金份额净值小数点后第五位，应计入本期的费用。

（9）实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。

（10）基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配采用现金方式，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次。基金年度收益分配比例不得低于基金年度可分配收益的90%。基金收益分配后，每基金份额净值不能低于面值。

经宣告的基金分配收益于分红除权日从持有人权益转出。

（11）无为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计。

（12）无会计政策、会计估计变更。

2、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

3、重大关联方关系及关联交易

（1）关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华夏基金管理有限公司 | 基金管理人、基金发起人 |
| 中国银行股份有限公司 | 基金托管人 |
| 中信证券股份有限公司("中信证券") | 基金管理人的股东 |
| 西南证券有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 北京证券有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 中国科技证券有限责任公司 | 基金管理人的股东 |
| 北京市国有资产经营有限责任公司 | 基金管理人的原股东 |

根据华夏基金管理有限公司于2006年10月28日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监基金字(2006)127号文批准，公司股东变更为中信证券股份有限公司(出资40.725%)、西南证券有限责任公司(出资35.725%)、北京证券有限责任公司(出资20%)和中国科技证券有限责任公司(出资3.55%)。

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证券交易及交易佣金

| | 2006年度 | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 买卖股票成交量 | | 买卖债券成交量 | | 债券回购成交量 | | 买卖权证成交量 | | 佣金 | |
| | 成交量 人民币元 | 占全年成交量的比例 | 成交量 人民币元 | 占全年成交量的比例 | 成交量 人民币元 | 占全年成交量的比例 | 成交量 人民币元 | 占全年成交量的比例 | 佣金 人民币元 | 占全年佣金总量的比例 |
| 中信证券 | 908,857,729.32 | 19.66% | 107,724,080.80 | 38.61% | 2,477,500,000.00 | 71.37% | 26,848,592.98 | 40.92% | 735,067.53 | 19.81% |

本基金2005年未通过关联方席位进行证券交易。

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证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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。

（3）基金管理人报酬

支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬10,789,019.62元(2005年：7,556,262.90元)。

（4）基金托管费

支付基金托管人中国银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费1,798,169.97元(2005年：1,259,377.18元)。

（5）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银行保管，并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191,958,196.72元(2005年12月31日：33,164,938.64元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为715,455.82元(2005年：190,160.57元)。

（6）与关联方通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易

本基金在本年度与基金托管人中国银行通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易如下：

| | 2006年度 | 2005年度 |
|---|---|---|
| 买入债券结算金额 | 35,767,916.30 | – |
| 卖出债券结算金额 | 20,278,496.52 | – |
| 卖出回购证券结算金额 | 55,000,000.00 | – |
| 卖出回购证券利息支出 | 23,986.31 | – |

本基金2005年未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

（7）关联方及基金管理公司主要股东的控制机构持有的基金份额

| | 2006年12月31日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 基金份额数(份) | 占基金总份额比 | 本期买入份额(份) | 本期卖出份额(份) |
| 华夏基金管理有限公司 | 49,979,877 | 10.00% | 44,814,442 | – |
| | 2005年12月31日 | | | |
| | 基金份额数(份) | 占基金总份额比 | 本期买入份额(份) | 本期卖出份额(份) |
| 华夏基金管理有限公司 | 5,165,435 | 1.03% | 47,451 | – |

基金管理人华夏基金管理有限公司在本会计年度运用固有资金购入本基金44,814,442份基金份额。于2006年12月31日，华夏基金管理有限公司持有本基金总份额的10.00%。

4、、流通受限制不能自由转让的基金资产

（1）流通受限制不能自由转让的股票

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 | 年末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量(股) | 年末估值总额 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 000819 | S岳兴长 | 2006-12-6 | 18.62 | 2007-2-12 | 18.69 | 19,980 | 372,027.60 |
| 000721 | S西饮食 | 2006-10-16 | 7.00 | 2007-3-5 | 7.08 | 1,250,781 | 8,755,467.00 |
| 000852 | S江钻 | 2006-10-31 | 12.33 | 2007-2-27 | 12.92 | 698,659 | 8,614,465.47 |
| 合计 | | | | | | | 17,741,960.07 |

因股权分置改革而暂时停牌的股票估值按照最近交易日的市场交易均价估值。

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。

此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

本基金截至2006年12月31日止，因上述原因投资的流通受限制的股票情况如下：

| 股票名称 | 成功申购日期 | 上市日期 | 可流通日期 | 申购价格 | 期末估价 | 成功申购股数(股) | 成本 | 市值 | 市值占净值比 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 大秦铁路 | 2006-7-26 | 2006-8-1 | 2007-2-1 | 4.95 | 8.09 | 531,800 | 2,632,410.00 | 4,302,262.00 | 0.40% |
| 工商银行 | 2006-10-23 | 2006-10-27 | 2007-1-29 | 3.12 | 6.03 | 1,458,080 | 4,549,209.60 | 8,792,222.40 | 0.81% |
| 北辰实业 | 2006-9-28 | 2006-10-16 | 2007-1-16 | 2.40 | 6.74 | 625,556 | 1,501,334.40 | 4,216,247.44 | 0.39% |
| 中国人寿 | 2006-12-28 | 2007-1-9 | 2007-4-9 | 18.88 | 18.88 | 220,500 | 4,163,040.00 | 4,163,040.00 | 0.38% |
| 东源电器 | 2006-9-27 | 2006-10-18 | 2007-1-18 | 7.88 | 14.05 | 42,423 | 334,293.24 | 596,043.15 | 0.06% |
| 雪莱特 | 2006-10-12 | 2006-10-25 | 2007-1-25 | 6.86 | 18.79 | 32,558 | 223,347.88 | 611,764.82 | 0.06% |
| 苏州固锝 | 2006-11-1 | 2006-11-16 | 2007-2-16 | 6.39 | 10.26 | 53,560 | 342,248.40 | 549,525.60 | 0.05% |
| 中材科技 | 2006-11-7 | 2006-11-20 | 2007-2-26 | 8.98 | 19.52 | 39,938 | 358,643.24 | 779,589.76 | 0.07% |
| 孚日股份 | 2006-11-14 | 2006-11-24 | 2007-2-26 | 6.69 | 8.62 | 105,027 | 702,630.63 | 905,332.74 | 0.08% |
| 海鸥卫浴 | 2006-11-14 | 2006-11-24 | 2007-2-26 | 8.03 | 22.42 | 51,929 | 416,989.87 | 1,164,248.18 | 0.11% |
| 东方海洋 | 2006-11-14 | 2006-11-28 | 2007-2-28 | 7.49 | 11.66 | 66,640 | 499,133.60 | 777,022.40 | 0.07% |
| 新野纺织 | 2006-11-21 | 2006-11-30 | 2007-3-1 | 5.19 | 6.12 | 235,260 | 1,220,999.40 | 1,439,791.20 | 0.13% |
| 鲁阳股份 | 2006-11-21 | 2006-11-30 | 2007-2-28 | 11.00 | 26.95 | 38,917 | 428,087.00 | 1,048,813.15 | 0.10% |
| 新海宜 | 2006-11-21 | 2006-11-30 | 2007-2-28 | 8.66 | 13.47 | 47,619 | 412,380.54 | 641,427.93 | 0.06% |
| 网盛科技 | 2006-12-6 | 2006-12-15 | 2007-3-15 | 14.09 | 55.84 | 17,772 | 250,407.48 | 992,388.48 | 0.09% |
| 非公开发行股票 | | | | | | | | | |
| 宝钛股份 | 2006-9-13 | 2006-9-13 | 2007-9-13 | 17.22 | 30.98 | 342,000 | 5,890,000.00 | 10,595,160.00 | 0.98% |
| 苏宁电器 | 2006-6-22 | 2006-6-23 | 2007-6-21 | 24.00 | 44.48 | 520,000 | 12,480,000.00 | 23,129,600.00 | 2.13% |
| 安徽合力 | 2006-7-6 | 2006-7-6 | 2007-7-6 | 10.60 | 22.43 | 1,000,000 | 10,600,000.00 | 22,430,000.00 | 2.07% |
| | | | | | | | 47,005,155.28 | 87,134,479.25 | |

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值。2006年11月13日之前由非公开发行形成的暂时流通受限股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；2006年11月13日起由非公开发行形成的暂时流通受限股票，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价低于非公开发行股票的初始成本，按市场交易均价估值，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价高于非公开发行股票的初始成本，按两者差价在非公开发行股票锁定期的摊销金额与初始成本之和估值。

（2）流通受限制不能自由转让的债券

本基金截至2006年12月31日止未持流通受限制不能自由转让的债券。

**七、投资组合报告**

（一）报告期末基金资产组合情况

| | 金额（元） | 占总资产比例 |
|---|---|---|
| 股票 | 848,302,900.55 | 65.92% |
| 债券 | 220,136,806.40 | 17.11% |
| 权证 | 7,827,050.00 | 0.61% |
| 资产支持证券 | – | – |
| 银行存款和清算备付金合计 | 199,458,751.10 | 15.50% |
| 其他资产 | 11,135,238.24 | 0.87% |
| 合计 | 1,286,860,746.29 | 100.00% |

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

| 序号 | 行业分类 | 市值（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 777,022.40 | 0.07% |
| B | 采掘业 | 66,632,307.68 | 6.15% |
| C | 制造业 | 392,996,700.10 | 36.26% |
| C0 | 其中：食品、饮料 | 92,223,874.12 | 8.51% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 2,345,123.94 | 0.22% |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | 41,132,572.75 | 3.79% |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 27,840,861.87 | 2.57% |
| C5 | 电子 | 13,891,746.56 | 1.28% |
| C6 | 金属、非金属 | 150,883,366.39 | 13.92% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 60,934,842.47 | 5.62% |
| C8 | 医药、生物制品 | 3,744,312.00 | 0.35% |
| C99 | 其他制造业 | – | – |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 35,019,123.20 | 3.23% |
| E | 建筑业 | – | – |
| F | 交通运输、仓储业 | 13,779,262.00 | 1.27% |
| G | 信息技术业 | 65,656,010.67 | 6.06% |
| H | 批发和零售贸易 | 73,017,509.20 | 6.74% |
| I | 金融、保险业 | 129,021,277.16 | 11.90% |
| J | 房地产业 | 54,188,708.09 | 5.00% |
| K | 社会服务业 | 11,877,007.65 | 1.10% |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | 5,337,972.40 | 0.49% |
| | 合计 | 848,302,900.55 | 78.26% |

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 期末市值（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 000568 | 泸州老窖 | 3,191,573 | 81,193,617.12 | 7.49% |
| 2 | 600718 | 东软股份 | 2,585,621 | 61,537,779.80 | 5.68% |
| 3 | 002024 | 苏宁电器 | 1,125,534 | 50,063,752.32 | 4.62% |
| 4 | 000024 | 招商地产 | 1,786,645 | 49,972,460.65 | 4.61% |
| 5 | 600005 | 武钢股份 | 7,500,000 | 47,775,000.00 | 4.41% |
| 6 | 601398 | 工商银行 | 7,410,080 | 44,682,782.40 | 4.12% |
| 7 | 600963 | 岳阳纸业 | 3,669,275 | 41,132,572.75 | 3.79% |
| 8 | 600016 | 民生银行 | 3,800,000 | 38,456,000.00 | 3.55% |
| 9 | 000562 | 宏源证券 | 2,719,972 | 33,537,254.76 | 3.09% |
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 1,032,500 | 30,944,025.00 | 2.85% |

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金管理人网站www.ChinaAMC.com的年度报告正文。

（四）报告期内股票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

| 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 | 600036 | 招商银行 | 61,717,467.72 | 12.04% |
| 2 | 000024 | 招商地产 | 58,624,013.95 | 11.43% |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 50,333,086.08 | 9.82% |
| 4 | 000825 | 太钢不锈 | 44,072,241.44 | 8.59% |
| 5 | 600718 | 东软股份 | 43,024,147.91 | 8.39% |
| 6 | 000933 | 神火股份 | 41,225,859.48 | 8.04% |
| 7 | 600016 | 民生银行 | 40,473,486.99 | 7.89% |
| 8 | 600028 | 中国石化 | 38,206,001.79 | 7.45% |
| 9 | 600005 | 武钢股份 | 36,452,918.22 | 7.11% |
| 10 | 000767 | 漳泽电力 | 35,823,204.50 | 6.99% |
| 11 | 002008 | 大族激光 | 35,315,456.57 | 6.89% |
| 12 | 002028 | 思源电气 | 34,343,291.81 | 6.70% |
| 13 | 600808 | 马钢股份 | 31,764,190.73 | 6.19% |
| 14 | 000063 | 中兴通讯 | 30,957,334.58 | 6.04% |
| 15 | 600787 | 中储股份 | 30,089,779.94 | 5.87% |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 29,096,582.16 | 5.67% |
| 17 | 000793 | 华闻传媒 | 28,996,638.17 | 5.65% |
| 18 | 600963 | 岳阳纸业 | 28,964,267.48 | 5.65% |
| 19 | 600761 | 安徽合力 | 28,706,491.17 | 5.60% |
| 20 | 600460 | 士兰微 | 28,287,063.47 | 5.52% |
| 21 | 000562 | 宏源证券 | 28,053,271.29 | 5.47% |
| 22 | 601398 | 工商银行 | 26,840,509.89 | 5.23% |
| 23 | 600880 | 博瑞传播 | 26,040,551.57 | 5.08% |
| 24 | 000400 | 许继电气 | 25,011,123.77 | 4.88% |
| 25 | 600616 | 第一食品 | 24,782,898.87 | 4.83% |
| 26 | 002024 | 苏宁电器 | 24,530,438.08 | 4.78% |
| 27 | 000039 | 中集集团 | 22,597,534.79 | 4.41% |
| 28 | 600019 | 宝钢股份 | 21,891,023.28 | 4.27% |
| 29 | 600585 | 海螺水泥 | 21,023,082.75 | 4.10% |
| 30 | 600584 | 长电科技 | 20,806,422.44 | 4.06% |
| 31 | 000002 | 万科A | 20,641,639.60 | 4.03% |
| 32 | 600642 | 申能股份 | 20,312,704.00 | 3.96% |
| 33 | 600089 | 特变电工 | 20,265,684.80 | 3.95% |
| 34 | 600594 | 益佰制药 | 19,881,551.97 | 3.88% |
| 35 | 000997 | 新大陆 | 19,276,834.46 | 3.76% |
| 36 | 600219 | 南山铝业 | 18,612,792.79 | 3.63% |
| 37 | 000970 | 中科三环 | 18,298,693.02 | 3.57% |
| 38 | 600177 | 雅戈尔 | 18,065,918.00 | 3.52% |
| 39 | 600527 | 江南高纤 | 18,022,190.80 | 3.51% |
| 40 | 600677 | 航天通信 | 17,805,528.67 | 3.47% |
| 41 | 600299 | 星新材料 | 17,723,465.37 | 3.46% |
| 42 | 600423 | 柳化股份 | 17,622,501.36 | 3.44% |
| 43 | 600050 | 中国联通 | 17,173,511.33 | 3.35% |
| 44 | 600688 | S上石化 | 17,173,413.75 | 3.35% |
| 45 | 600015 | 华夏银行 | 16,452,848.69 | 3.21% |
| 46 | 600855 | 航天长峰 | 16,326,857.73 | 3.18% |
| 47 | 600010 | 包钢股份 | 16,166,914.64 | 3.15% |
| 48 | 600960 | 滨州活塞 | 15,785,906.10 | 3.08% |
| 49 | 600363 | 联创光电 | 15,766,683.80 | 3.07% |
| 50 | 000758 | 中色股份 | 15,706,094.76 | 3.06% |
| 51 | 600694 | 大商股份 | 15,681,958.99 | 3.06% |
| 52 | 600572 | 康恩贝 | 15,351,392.43 | 2.99% |
| 53 | 600456 | 宝钛股份 | 15,187,747.38 | 2.96% |
| 54 | 600268 | 国电南自 | 15,175,417.41 | 2.96% |
| 55 | 600331 | 宏达股份 | 14,823,669.66 | 2.89% |
| 56 | 000852 | S江钻 | 14,749,593.71 | 2.88% |
| 57 | 000930 | 丰原生化 | 14,727,471.07 | 2.87% |
| 58 | 000690 | 宝新能源 | 14,722,793.43 | 2.87% |
| 59 | 000768 | 西飞国际 | 14,675,852.67 | 2.86% |
| 60 | 601111 | 中国国航 | 14,151,263.15 | 2.76% |
| 61 | 600360 | 华微电子 | 14,003,620.93 | 2.73% |
| 62 | 600835 | 上海机电 | 13,973,475.53 | 2.73% |
| 63 | 600325 | 华发股份 | 13,866,325.45 | 2.70% |
| 64 | 000807 | 云铝股份 | 13,824,735.49 | 2.70% |
| 65 | 600118 | 中国卫星 | 13,293,212.80 | 2.59% |
| 66 | 002022 | 科华生物 | 13,206,461.40 | 2.58% |
| 67 | 000617 | S济柴 | 13,001,488.70 | 2.54% |
| 68 | 000898 | 鞍钢股份 | 12,865,716.32 | 2.51% |
| 69 | 000061 | 农产品 | 12,769,220.90 | 2.49% |
| 70 | 600196 | 复星医药 | 12,758,190.59 | 2.49% |
| 71 | 600879 | 火箭股份 | 12,701,416.37 | 2.48% |
| 72 | 600361 | 华联综超 | 12,589,035.28 | 2.46% |
| 73 | 600475 | 华光股份 | 12,532,291.30 | 2.44% |
| 74 | 600343 | 航天动力 | 12,530,639.06 | 2.44% |
| 75 | 000069 | 华侨城A | 11,831,100.72 | 2.31% |
| 76 | 002007 | 华兰生物 | 11,689,148.47 | 2.28% |
| 77 | 600472 | 包头铝业 | 11,506,144.80 | 2.24% |
| 78 | 600033 | 福建高速 | 11,433,527.92 | 2.23% |
| 79 | 600271 | 航天信息 | 11,360,720.52 | 2.22% |
| 80 | 600849 | 上海医药 | 11,325,291.27 | 2.21% |
| 81 | 000939 | 凯迪电力 | 11,302,597.94 | 2.20% |
| 82 | 600309 | 烟台万华 | 11,274,215.22 | 2.20% |
| 83 | 000917 | 电广传媒 | 11,241,887.81 | 2.19% |
| 84 | 000960 | 锡业股份 | 11,158,104.31 | 2.18% |
| 85 | 600151 | 航天机电 | 11,002,906.32 | 2.15% |
| 86 | 600031 | 三一重工 | 10,968,504.15 | 2.14% |
| 87 | 600161 | 天坛生物 | 10,850,510.67 | 2.12% |
| 88 | 600536 | 中国软件 | 10,462,421.94 | 2.04% |
| 89 | 600517 | 置信电气 | 10,407,807.06 | 2.03% |
| 90 | 600741 | 巴士股份 | 10,233,557.02 | 2.00% |

(下转67版)