安久证券投资基金 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: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2007年3月21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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告的财务报表部分已经审计。

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) 2000年7月4日华安基金管理有限公司开始管理基金安久
期末基金份额总额:	5亿份
基金存续期:	15年(自1992年8月31日至2007年8月30日)
基金上市地点:	深圳证券交易所
基金上市日期:	2001年8月31日

(二) 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。 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。 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

(三) 基金管理人

基金管理人:	华安基金管理有限公司
注册及办公地址:	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:	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 (邮政编码:200120)
办公地址:	上海市浦东新区银城中路188号 (邮政编码:200120)
法定代表人:	蒋超良
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

(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:	上海市南京东路61号四楼
登记注册机构:	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司
办公地点:	深圳市深南中路1093号中信大厦18楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

财务指标	2006年度	2005年度	2004年度
基金本期净收益	207,563,599.56	–46,249,351.90	25,176,809.13
加权平均基金份额本期净收益	0.4151	–0.0925	0.0504
期末可供分配基金收益	114,426,334.29	–93,137,265.27	–64,777,031.85
期末可供分配基金份额收益	0.2289	–0.1863	–0.1296
期末基金资产净值	1,007,939,273.11	433,321,374.26	435,222,968.15
期末基金份额净值	2.0159	0.8666	0.8704
基金加权平均净值收益率	31.85%	–10.99%	5.39%
本期基金份额净值增长率	132.62%	–0.44%	–6.19%
基金份额累计净值增长率	87.43%	–19.43%	–19.07%

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。

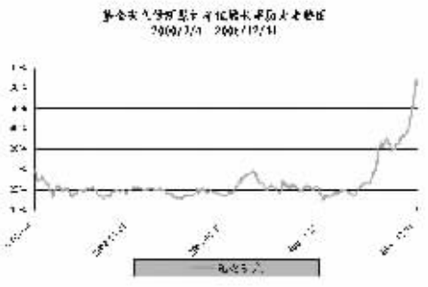
(二) 净值表现

A、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

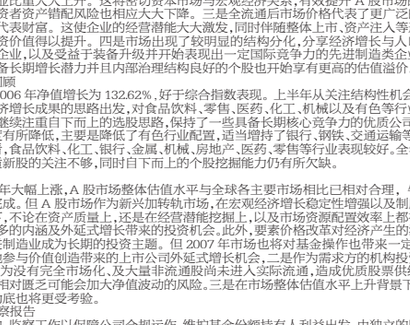
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
三个月	40.50%	3.00%	–	–	–	–
六个月	43.55%	2.87%	–	–	–	–
一年	132.62%	2.95%	–	–	–	–
三年	117.28%	2.79%	–	–	–	–
五年	134.08%	2.40%	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	87.43%	2.47%	–	–	–	–

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



C、图示基金过往三年每年的净值增长率



(三) 基金收益分配情况

本基金过往三年未分红。

四、管理人报告

(一) 基金管理人以及基金经理简介

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、华安宝利、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。

鲍冠先生,经济学硕士,13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工作。

(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。

(三) 基金经理工作报告

(1)行情回顾

2006年A股市场呈现出波澜壮阔的牛市行情,上证综合指数涨幅达到130.43%。全年市场有几个突出特点。一是宏观经济保持了高位的持续增长,同时上市公司盈利状况明显好转,可比公司的净利润同比增长率从一季度的下降,上半年的5.85%迅速提高到前三季度的21.56%。特别是数量众多的中下游行业由于成本压力缓解业绩得到逐步改善,基本面超预期是支持市场持续走强的重要因素。二是制度变迁表现出深远的影响力,股权分置改革不仅带来了对价的财富效应,更重要的是重塑了市场化的价格形成机制,恢复了股票市场正常运转的自我平衡功能及投资本色。而随着A股市场效率的提高,大型IPO重新启动,一度漏出在境外的累积市值庞大的优质企业也陆续回归到A股市场全流通,上市公司结构更为合理,服务类企业比重大大上升。这将密切资本市场与宏观经济关系,有效提升A股市场的整体投资价值与定价权,投资者资产错配风险也相应大大下降。三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,同时伴随整体上市、资产注入等形式的资源流入,上市公司投资价值得以提升。四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2006年净值增长为132.62%,好于综合指数表现。上半年从关注结构性机会、积极增持稀缺资源、分享经济增长成果的思路出发,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,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。下半年操作力度有所降低,主要是降低了有色行业配置,适当增持了银行、钢铁、交通运输等行业股票。从全年实际收益看,食品饮料、化工、银行、金属、机械、房地产、医药、零售等行业表现较好。全年操作中存在的问题是对优质新股的关注不够,同时自下而上的个股挖掘能力仍有所欠缺。

(3)展望

经过2006年大幅上涨,A股市场整体估值水平与全球各主要市场相比已相对合理,牛市的价值回归过程已基本完成。但A股市场作为新兴加转轨市场,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,不论在资产质量上,还是在经营潜能挖掘上,以及市场资源配置效率上都有着较大的改善余地,存在较多的内涵及外延式增长带来的投资机会。此外,要素价格改革对经济产生的深远影响将使消费服务和先进制造业成为长期的投资主题。但2007年市场也将对基金操作也带来一定的挑战,一是如何积极稳妥地参与价值创造带来的上市公司外延式增长机会,二是作为需求方的机构投资者队伍迅速壮大,而IPO行为没有完全市场化、及大量非流通股尚未进入实际流通,造成优质股票供给的阶段性短缺,可投资标的相对匮乏可能会加大净值波动的风险。三是在市场整体估值水平上升背景下,自下而上的个股选择能力功底也将更受考验。

(四)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,交通银行在安久证券投资基金的托管过程中,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、基金托管协议,依法安全保管了基金的资产,勤勉尽责地履行了基金托管人的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。

2006年,按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议,本托管人对基金管理人——华安基金管理有限公司在基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值、基金份额净值和费用计算上进行了认真复核,未发现基金管理人有损害基金持有人的利益行为。

2006年,由基金管理人——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证券投资基金的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、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		29,953,369.94	2,070,694.15
清算备付金		8,648,777.22	4,631,266.98
交易保证金		859,609.61	1,131,465.52
应收证券清算款		5,343,691.99	5,088,361.21
应收股利		0.00	0.00
应收利息		1,032,999.96	530,072.47
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		766,462,377.29	331,053,622.25
其中:股票投资成本		382,062,738.96	304,785,745.22
债券投资市值		205,050,120.20	90,653,244.00
其中:债券投资成本		204,823,500.69	90,462,481.50
权证投资市值		27,336,816.00	0.00
其中:权证投资成本		18,450,135.02	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		1,044,687,762.21	435,158,726.58
负债:			
应付证券清算款		33,929,841.86	0.00
应付赎回款		0.00	0.00
应付管理人报酬		1,170,742.54	521,202.32
应付托管费		195,123.74	86,867.08
应付佣金		572,780.96	349,282.92
其他应付款		750,000.00	750,000.00
预提费用		130,000.00	130,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
负债合计		36,748,489.10	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		393,512,938.82	26,458,639.53
未分配收益		114,426,334.29	–93,137,265.27
持有人权益合计		1,007,939,273.11	433,321,374.26
负债和所有者权益合计		1,044,687,762.21	435,158,726.58

(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		197,117,572.61	–47,667,488.33
债券差价收入		–567,911.16	758,573.42
权证差价收入		11,962,661.12	553,546.21
债券利息收入		3,611,370.12	2,686,007.69
存款利息收入		387,147.20	266,881.22
股利收入		7,606,534.75	4,929,828.30
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		220,117,374.64	–38,428,136.19
费用:			
基金管理人报酬		9,609,918.12	6,330,531.40
基金托管费		1,601,653.02	1,055,088.71
卖出回购证券支出		956,646.29	63,321.31
其他费用		385,557.65	372,274.29
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	50,000.00
费用合计		12,553,775.08	7,821,215.71
基金净收益		207,563,599.56	–46,249,351.90
加:未实现估值增值变动数		367,054,299.29	44,347,758.01
基金经营业绩		574,617,898.85	–1,901,593.89

(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		207,563,599.56	–46,249,351.90
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		114,426,334.29	–93,137,265.27
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		114,426,334.29	–93,137,265.27

(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		433,321,374.26	435,222,968.15
二、本期经营活动:			
基金净收益		207,563,599.56	–46,249,351.90
未实现估值增值变动数		367,054,299.29	44,347,758.01
经营活动产生的基金净值变动数		574,617,898.85	–1,901,593.89
三、本期向持有人分配收益		0.00	0.00
四、期末基金净值		1,007,939,273.11	433,321,374.26

(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. 税项

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文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税(2005)11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税(2005)102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》,财税(2005)103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

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。

③基金买卖股票、债券的差价收入,自2004年1月1日起继续免征企业所得税。对基金取得的股票的股息、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派发股息、红利、利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。自2005年6月13日起,对个人投资者从上市公司取得的股息红利所得,暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定计征个人所得税,基金投资者参照前述规定。

④基金买卖股票按照1‰的税率征收印花税。从2005年1月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按1‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

⑤基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

4. 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
交通银行股份有限公司	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	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		

(2).通过关联方席位进行的交易

① 本报告期通过关联人席位的股票成交量:无。

上年度通过关联人席位的股票成交量:无。

② 本报告期通过关联人席位的债券、回购和权证成交量:无。

上年度通过关联人席位的债券、回购和权证成交量:无。

③ 本报告期与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:无。

上年度与关联人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,按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,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

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9,609,918.12元。(上年度:6,330,531.40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1,601,653.02元。(上年度:1,055,088.71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12月31日保管的银行存款余额为29,953,369.94元(2005年:2,070,694.15)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为197,578.35元。(2005年:94,837.50元)。

本基金用于证券交易结算的资金通过"交通银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于2006年12月31日的相关余额8,648,777.22元计入"清算备付金"科目(2005年:4,631,266.98元)。

(4).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		买入	卖出	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	9,582,100.00	1.92%	0.00	0.00	9,582,100.00	1.92%	–

2005年度基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	年初数		买入	卖出	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	5,000,000.00	1.00%	4,582,100.00	0.00	9,582,100.00	1.92%	–

(5).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:

本报告期末与2005年末均无。

5. 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:

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。

股票名称	数量	总成本	总市值	年末估值单价	转让受限原因	受限期限
广深铁路	591,780	2,225,092.80	4,243,062.60	7.17	网下新股未上市	至2007年3月22日
中国人寿	26,000	490,880.00	490,880.00	18.88	网上新股未上市	至2007年1月9日
中国人寿	119,070	2,248,041.60	2,248,041.60	18.88	网下新股未上市	自网上新股上市日起锁定3个月
大秦铁路	319,280	1,580,436.00	2,582,975.20	8.09	网下新股未上市	至2007年2月1日
山河智能	51,885	518,850.00	1,689,894.45	32.57	网下新股未上市	至2007年3月22日
鲁阳股份	38,917	428,087.00	1,048,813.15	26.95	网下新股未上市	至2007年2月28日
青岛金王	55,377	425,849.13	658,986.30	11.90	网下新股未上市	至2007年3月15日
雪莱特	32,558	223,347.88	611,764.82	18.79	网下新股未上市	至2007年1月25日
青岛软控	12,422	322,972.00	587,312.16	47.28	网下新股未上市	至2007年1月18日
海鸥卫浴	15,978	128,303.34	358,226.76	22.42	网下新股未上市	至2007年2月26日
大唐发电	32,000	213,760.00	329,600.00	10.30	网下新股未上市	至2007年3月21日
江苏宏宝	30,725	119,213.00	215,075.00	7.00	网下新股未上市	至2007年1月12日
合计		8,924,832.75	15,064,632.04			

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限的债券。

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	766,462,377.29	73.37%
2	债券	205,050,120.20	19.63%
3	权证	27,336,816.00	2.62%
4	银行存款和清算备付金	38,602,147.16	3.70%
5	其它资产	7,236,301.56	0.69%
	合计	1,044,687,762.21	100.00%

(二)股票投资组合

行业分类	市值(元)	占资产净值比例
B 采掘业	58,481,449.62	5.80%
C 制造业	407,592,152.61	40.44%
C0 食品、饮料	89,945,964.26	8.92%
C1 纺织、服装、皮毛	546,865.03	0.05%
C3 造纸、印刷	14,886,420.08	1.48%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	56,101,951.80	5.57%
C5 电子	611,764.82	0.06%
C6 金属、非金属	64,908,925.59	6.44%
C7 机械、设备、仪表	107,333,962.41	10.65%
C8 医药、生物制品	72,597,312.32	7.20%
C99 其他制造业	658,986.30	0.07%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	329,600.00	0.03%
F 交通运输、仓储业	26,359,037.80	2.62%
G 信息技术业	22,797,216.63	2.26%
H 批发和零售贸易	31,338,849.68	3.11%
I 金融、保险业	123,267,236.60	12.23%
J 房地产业	65,623,761.25	6.51%
K 社会服务业	5,216,565.44	0.52%
M 综合类	25,456,507.66	2.53%
合 计	766,462,377.29	76.04%

(三)基金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	招商银行	5,100,000	82,773,000.00	8.21%
2	600761	安徽合力	2,818,090	63,209,758.70	6.27%
3	600519	贵州茅台	716,724	62,928,367.20	6.24%
4	600276	恒瑞医药	1,569,398	50,597,391.52	5.02%
5	000402	金融街	2,410,778	40,645,717.08	4.03%
6	600309	烟台万华	1,670,014	40,230,637.26	3.99%
7	600030	中信证券	1,384,500	37,755,315.00	3.75%
8	600583	海油工程	946,858	33,026,407.04	3.28%
9	000825	太钢不锈	2,522,789	32,241,243.42	3.20%
10	002024	苏宁电器	650,200	28,920,896.00	2.87%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于华安基金管理有限公司网站www.huaan.com.cn的年度报告正文。

(二)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	招商银行	42,878,036.51	9.90%
2	600030	中信证券	34,732,106.75	8.02%
3	000933	神火股份	33,396,569.69	7.71%
4	600009	上海机场	31,564,437.34	7.28%
5	600276	恒瑞医药	29,154,299.32	6.73%
6	000869	张裕A	27,582,445.39	6.37%
7	000983	西山煤电	27,430,348.64	6.33%
8	000002	万科A	22,360,393.66	5.16%
9	000157	中联重科	21,422,468.12	4.94%
10	000825	太钢不锈	21,403,516.62	4.94%
11	600887	伊利股份	20,754,604.97	4.79%
12	600028	中国石化	20,292,244.43	4.68%
13	600761	安徽合力	19,915,003.18	4.60%
14	600271	航天信息	19,579,024.07	4.52%
15	002021	中捷股份	18,356,929.54	4.24%
16	600308	华泰股份	18,095,956.09	4.18%
17	600694	大商股份	16,836,082.19	3.89%
18	600519	贵州茅台	15,446,242.62	3.56%
19	600415	小商品城	14,564,820.50	3.36%
20	600456	宝钛股份	13,875,235.22	3.20%
21	002024	苏宁电器	13,696,156.30	3.16%
22	002007	华兰生物	11,442,992.48	2.64%
23	600858	银座股份	10,836,312.26	2.50%
24	000538	云南白药	10,448,815.54	2.41%
25	600123	兰花科创	9,007,788.41	2.08%

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	000538	云南白药	39,799,766.00	9.18%
2	000933	神火股份	31,944,949.29	7.37%
3	600456	宝钛股份	31,028,733.04	7.16%
4	000869	张裕A	29,859,806.73	6.89%
5	000983	西山煤电	29,584,027.19	6.83%
6	600309	烟台万华	28,957,324.11	6.68%
7	000792	盐湖钾肥	28,234,438.31	6.52%
8	002021	中捷股份	27,218,226.66	6.28%
9	600694	大商股份	25,599,319.81	5.91%
10	002025	航天电器	25,583,224.83	5.90%
11	600887	伊利股份	23,379,965.34	5.40%
12	000970	中科三环	22,495,963.91	5.19%
13	600009	上海机场	20,938,987.72	4.83%
14	000002	万科A	20,213,972.52	4.66%
15	600000	浦发银行	19,598,717.00	4.52%
16	600348	国阳新能	19,542,473.32	4.51%
17	600036	招商银行	19,279,674.86	4.45%
18	600261	浙江阳光	19,207,892.20	4.43%
19	600489	中金黄金	19,008,989.44	4.39%
20	600583	海油工程	18,184,922.67	4.20%
21	600028	中国石化	17,746,562.57	4.10%
22	600153	建发股份	15,682,604.01	3.62%
23	000402	金融街	14,628,425.65	3.38%
24	600008	首创股份	13,975,431.22	3.23%
25	600415	小商品城	13,756,761.61	3.17%
26	002041	登海种业	13,239,548.16	3.06%
27	600438	通威股份	11,858,817.02	2.74%
28	600361	华联综超	11,827,942.08	2.73%
29	600519	贵州茅台	10,627,556.32	2.45%
30	600123	兰花科创	9,921,023.88	2.29%
31	600600	青岛啤酒	9,889,704.15	2.28%
32	000911	南宁糖业	9,482,017.08	2.19%
33	000987	广州友谊	9,463,515.04	2.18%
34	000157	中联重科	9,123,939.71	2.11%

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*	731,160,868.90
卖出股票的收入总额	849,842,270.64

*:买入股票的成本总额中未扣除因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价1,868,676.92元。

(三)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	154,960,120.20	15.37%
2	金融债	50,090,000.00	4.97%
	合计	205,050,120.20	20.34%

(四)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(5)	624,850	62,872,407.00	6.24%
2	010010	20国债(10)	339,750	34,240,005.00	3.40%
3	010214	02国债(14)	324,820	32,657,402.80	3.24%
4	050415	05农发15	200,000	19,990,000.00	1.98%
5	060221	06国开21	200,000	19,980,000.00	1.98%

(五)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(份)	市值(元)	占资产净值比例
1	030002	五粮YGC1	778,000	11,298,116.00	1.12%
2	580005	万华HXB1	400,000	8,923,200.00	0.89%
3	031001	侨城HQC1	500,000	7,115,500.00	0.71%

(六)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。

(七)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,未上市交易的权证按价差(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