

兴安证券投资基金 2006 年年度报告摘要

(上接 56 页) 2. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

3. 本报告期内买入股票的成本总额为 2,340,820,819.15 元; 卖出股票的收入总额为 2,394,096,302.09 元。

Table with 5 columns: 序号, 债券品种, 市值(元), 占净值比例. Lists top 5 bond investments.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 5 stocks held at the end of the period.

(八) 本报告期内基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

Table with 5 columns: 序号, 代码, 权证名称, 数量(份), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 5 warrant investments.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 5 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆登载于本基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 的年度报告正文。

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks sold during the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks bought during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

4. 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。

5. 报告期内获得的权证

Table with 5 columns: 权证名称, 数量(份), 成本总额(元). Lists warrants held during the period.

八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至 2006 年 12 月 31 日兴安证券投资基金持有人情况如下:

(一) 持有人户数

Table with 2 columns: 基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额. Shows number of holders and average shares per holder.

(二) 持有人结构

Table with 3 columns: 机构投资者, 个人投资者, 合计. Shows distribution of investors.

(三) 前十名持有人

Table with 5 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占基金总份额比例. Lists top 10 holders.

注: 以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的前 100 名基金持有人名单编制

九、重大事件提示

(一) 本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 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。

(三) 本基金管理人和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。

(四) 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, 免去李骥刚先生公司副总经理职务。

(五) 经华夏基金管理有限公司董事会、股东会决议, 并报中国证监会核准, 华夏基金管理有限公司现有股东变更为中信证券有限责任公司( 出资 40.725% )、西南证券股份有限公司( 出资 35.725% )、北京证券有限责任公司( 出资 20% ) 和国科科技证券有限责任公司( 出资 3.55% )。

(六) 本报告期内基金投资策略未发生变更。

(七) 本报告期内无基金收益分配事项。

本基金管理人于 2006 年 12 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告, 将《兴安证券投资基金基金合同》中“十八、基金收益与分配(三)基金收益分配原则”中的“1、基金收益分配采取现金方式或法律法规允许的其他方式, 每年分配一次, 管理人应在基金每一会计年度结束后 90 个工作日内公布上一会计年度的收益分配方案并于 120 个工作日内完成分配方案的实施; 2. 基金收益分配比例不得低于基金当年可分配收益的 90%, 其具体分配数额及比例由基金管理人拟定”修订为: “1、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; 2. 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%。”

(八) 本基金收益按年度支付给华夏永通中天会计师事务所有限公司的报酬为 60,000.00 元人民币, 目前该事务所已向本基金提供 7 年的连续审计服务。

(九) 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, 我公司制定了选择券商的标准, 即:

- 1. 经营行为规范, 在一年内无重大违规行为;
2. 公司财务状况良好;
3. 有良好的内部控制制度, 在业内有良好的声誉;

4. 有较雄厚的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司及证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;

5. 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确的信息资讯和服务。

根据以上标准, 本期分别选择了兴安证券、海通证券、渤海证券、中信证券、国泰君安证券、江海证券等机构作为基金专用交易席位, 本期新增了中信建投证券、太平洋证券的交易席位, 席位佣金为股票成交金额的 1%扣除应由券商承担的交易手续费和证管费及结算风险金。

各席位交易量及佣金提款情况如下:

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日租用各券商席位的数据、股票交易量及佣金情况如下:

兴和证券投资基金 2006 年年度报告摘要

(上接 58 页)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks sold during the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks bought during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

兴和证券投资基金 2006 年年度报告摘要

(上接 58 页)

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks sold during the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks bought during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

Table with 5 columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 期末市值(元), 占净值比例. Lists top 20 stocks held at the end of the period.

注: 投资者欲了解本报告期内基金投资的股票明细, 应登陆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. 报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

Table with 5 columns: 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. Lists top 20 stocks sold during the period.

4. 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。

5. 报告期内获得的权证

Table with 5 columns: 权证名称, 数量(份), 成本总额(元). Lists warrants held during the period.

八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至 2006 年 12 月 31 日兴安证券投资基金持有人情况如下:

(一) 持有人户数

Table with 2 columns: 基金份额持有人户数, 平均每户持有基金份额. Shows number of holders and average shares per holder.

(二) 持有人结构

Table with 3 columns: 机构投资者, 个人投资者, 合计. Shows distribution of investors.

(三) 前十名持有人

Table with 5 columns: 序号, 持有人名称, 持有份额(份), 占基金总份额比例. Lists top 10 holders.

注: 以上信息依据中国证券登记结算有限公司深圳分公司提供的前 100 名基金持有人名单编制

九、重大事件提示

(一) 本报告期内, 本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 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。

(三) 本基金管理人和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。

(四) 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, 免去李骥刚先生公司副总经理职务。

(五) 经华夏基金管理有限公司董事会、股东会决议, 并报中国证监会核准, 华夏基金管理有限公司现有股东变更为中信证券有限责任公司( 出资 40.725% )、西南证券股份有限公司( 出资 35.725% )、北京证券有限责任公司( 出资 20% ) 和国科科技证券有限责任公司( 出资 3.55% )。

(六) 本报告期内基金投资策略未发生变更。

(七) 本报告期内无基金收益分配事项。

本基金管理人于 2006 年 12 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告, 将《兴安证券投资基金基金合同》中“十八、基金收益与分配(三)基金收益分配原则”中的“1、基金收益分配采取现金方式或法律法规允许的其他方式, 每年分配一次, 管理人应在基金每一会计年度结束后 90 个工作日内公布上一会计年度的收益分配方案并于 120 个工作日内完成分配方案的实施; 2. 基金收益分配比例不得低于基金当年可分配收益的 90%, 其具体分配数额及比例由基金管理人拟定”修订为: “1、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; 2. 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%。”

(八) 本基金收益按年度支付给华夏永通中天会计师事务所有限公司的报酬为 60,000.00 元人民币, 目前该事务所已向本基金提供 7 年的连续审计服务。

(九) 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, 我公司制定了选择券商的标准, 即:

- 1. 经营行为规范, 在一年内无重大违规行为;
2. 公司财务状况良好;
3. 有良好的内部控制制度, 在业内有良好的声誉;

4. 有较雄厚的研究能力, 能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司及证券市场研究报告, 并能根据基金投资的特殊要求, 提供专门的研究报告;

5. 建立了广泛的信息网络, 能及时提供准确的信息资讯和服务。

根据以上标准, 本期分别选择了兴安证券、海通证券、渤海证券、中信证券、国泰君安证券、江海证券等机构作为基金专用交易席位, 本期新增了中信建投证券、太平洋证券的交易席位, 席位佣金为股票成交金额的 1%扣除应由券商承担的交易手续费和证管费及结算风险金。

各席位交易量及佣金提款情况如下:

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日租用各券商席位的数据、股票交易量及佣金情况如下:

单位: 元

Table with 6 columns: 序号, 券商名称, 租用券商席位数量, 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. Lists top 10 brokers.

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日各券商债券、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. Lists top 6 brokers.

(十) 其他重大事件

1. 本基金管理人于 2006 年 12 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告;

2. 本基金管理人于 2006 年 11 月 22 日发布华夏基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告;

3. 本基金管理人于 2006 年 10 月 28 日发布华夏基金管理有限公司关于变更的公告;

4. 本基金管理人于 2006 年 10 月 28 日发布华夏基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告;

5. 本基金管理人于 2006 年 9 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票“宝钛股份”的公告;

6. 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;

7. 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;

8. 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;

9. 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, 免去李骥刚先生公司副总经理职务;

10. 本基金管理人于 2006 年 4 月 18 日发布华夏基金管理有限公司关于运用固有资金进行基金投资的公告;

11. 本基金管理人于 2006 年 4 月 13 日发布华夏基金管理有限公司上海分公司迁址公告;

12. 本基金管理人于 2006 年 2 月 15 日发布公告, 调整旗下基金基金经理。

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 查阅上述公告。

华夏基金管理有限公司 二〇〇七年三月三十一日

兴安证券投资基金 2006 年年度收益分配公告

华夏基金管理有限公司(以下简称“本公司”)所管理的兴安证券投资基金(以下简称“本基金”)2006 年年度财务报告已由普华永道中天会计师事务所有限公司出具了无保留意见的审计报告。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》等规定, 本公司拟定了本基金 2006 年年度收益分配方案, 经本基金的托管人中国银行股份有限公司复核, 现公告如下:

一、基金简称及代码

基金简称: 基金兴安, 基金代码: 184718

二、收益分配方案

2006 年度本基金可供持有人分配的收益为 267,104,810.78 元。2006 年年度收益分配方案为: 向全体持有人按每 10 份基金份额派发 4.81 元的现金红利, 共计 240,500,000.00 元。

三、权益登记日、除息日和发放日

权益登记日: 2007 年 4 月 6 日

除息日: 2007 年 4 月 6 日

发放日: 2007 年 4 月 9 日

四、收益分配对象

2007 年 4 月 6 日下午深圳证券交易所交易结束后, 在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的本基金全体基金份额持有人。

五、收益发放办法

1. 本次可能的基金份额派发的现金收益于 2007 年 4 月 9 日通过投资者托管的证券公司直接划入投资者的资金账户。

2. 本基金发起人持有的不可赎回部分基金份额应得现金收益由本基金直接向发起人发放。

六、有关税收和费用的说明

根据财政部、国家税务总局的财税[1998]15 号《关于证券投资基金收益分配的通知》及财税字[2004]178 号《关于证券投资基金收益分配的通知》的规定, 基金向投资者分配的基金收益, 暂免征收所得税。

七、咨询方式

投资者可拨打本公司客户服务电话(400-818-6666)或登陆本公司网站(www.ChinaAMC.com)获取相关信息。

特此公告

华夏基金管理有限公司 二〇〇七年三月三十一日