华安宝利配置证券投资基金 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

1、基金概况

基金名称:	华安宝利配置证券投资基金
基金简称:	华安宝利
交易代码:	040004
深交所行情代码:	160404
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2004年8月24日
期末基金份额总额:	1,473,522,718.96份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

投资目标:	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略:	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准:	35%×天相转债指数收益率+30%×天相280指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征:	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险,政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险,管理风险,巨额赎回风险等。

3、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

4、基金托管人

基金管理人:	交通银行股份有限公司(简称"交通银行")
注册地址及办公地址:	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

5、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

6、其他有关资料

会计师事务所:	普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址:	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
登记注册机构:	华安基金管理有限公司
办公地点:	上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

财务指标	2006年度	2005年度	2004年8月24日(基金合同生效日)至2004年12月31日
基金本期净收益:	714,888,931.66	17,162,792.29	5,471,991.16
基金加权份额本期净收益:	0.9281	0.0262	0.0104
期末可供分配基金收益	43,861,245.25	-9,220,882.64	1,411,692.73
期末可供分配基金份额收益	0.0298	-0.0093	0.0024
期末基金资产净值:	1,699,034,787.31	1,064,076,460.83	597,137,202.33
期末基金份额净值:	1.153	1.078	1.002
基金加权平均净值收益率	64.10%	2.53%	1.03%
本期基金份额净值增长率	124.82%	12.75%	0.20%
基金份额累计净值增长率	154.01%	12.98%	0.20%

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。

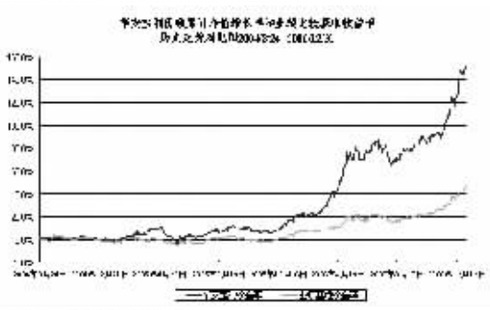
2、净值表现

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
过去三个月	35.78%	1.25%	20.74%	0.60%	15.04%	0.65%
过去六个月	39.62%	1.14%	20.51%	0.57%	19.11%	0.57%
过去一年	124.82%	1.15%	48.50%	0.61%	76.32%	0.54%
自基金合同生效起至今	154.01%	0.93%	46.95%	0.55%	107.06%	0.38%

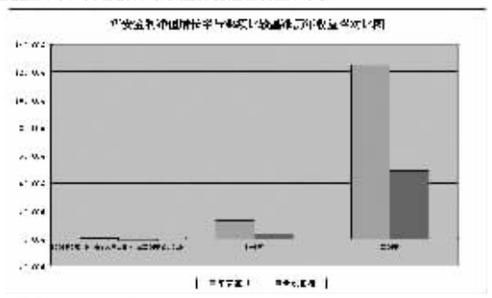
B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



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与同期业绩比较基准的收益率对比图



3、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
2004年8月24日(基金合同生效日)至2004年12月31日	无	
2005年度	0.500元	
2006年度	10.900元	
合计	11.400元	

四、管理人报告

1、基金管理人和基金经理简介

(1)基金管理人

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。

(2)基金经理

袁蓓女士:经济学学士,7年证券从业经历。曾在中国平安保险(集团)股份有限公司投资管理中心工作。2003年1月加入华安基金管理有限公司,在基金投资部从事证券投资和研究工作。现任华安宝利配置基金的基金经理。

汤礼辉先生:经济学硕士,9年证券、基金从业经历。曾在申银万国证券研究所工作。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,从事医药、金融行业及投资策略研究。现任研究发展部副总监、华安宝利配置基金的基金经理、安信证券投资基金的基金经理。

2、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《华安宝利配置证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置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,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

3、基金经理工作报告

(1)本基金业绩表现

2006年对中国经济而言,再次展现了持续高增长低通胀的魅力,中国的全球经济地位再次提升。而2006年的中国证券市场更是锦上添花,股票市场在股改、业绩增长和资金推动以及估值提升等诸多因素的共同影响下拥有了超过100%的上升,给投资人带来了丰厚的回报。

截止2006年12月31日,本基金单位净值为1.153元。全年累计净值上升124.82%,同期衡量业绩的比较基准上涨48.50%;期间完成三次分红,合计每十份分红10.90元,自成立以来本基金累计净值上升154.01%,同期衡量业绩的比较基准上涨46.95%。

(2)基金运作情况回顾

资产配置,基于对股票市场的良好预期,2006年维持了对股性资产的较高配置,其间作小幅调整。总结过去一年的投资运作,虽然整体效果较好,但是"投资是遗憾的艺术",2006年的资本市场是充满机会的市场,在把握了很多机会的同时也错过了众多优良的品种。

普通债券投资,本基金维持低仓位低久期的配置,同时积极参与了一些阶段性的机会,有效地回避了债券市场低收益的风险;可转债的投资,考虑到流动性和行业风格集中等因素,维持较低的配置;股票市场的投资,延用精选细分行业和个股的主要策略,以成长的可持续性为主线,选择相对估值潜力较大的优质公司,提高和维持股票组合的配置。

(3)2007年市场展望和投资策略

展望2007年的证券市场,宏观经济持续、企业盈利增长、优质资产注入、股权激励推进、人民币升值等诸多因素决定股票市场的年度收益水平仍然可观,但毕竟股票市场静态的估值处于较高的位置,整体收益水平将远不如06年的状况,波动也将明显加大;同时债市难有大的整体表现,并伴随以粮价不确定性为主旋律的通胀风险,不确定性增大。因此在资产配置上,仍将保持偏股配置,同时更强调对风险的控制,在股票市场估值提高和债券市场风险释放的过程中,适度降低股票配置,提高基金净值的稳定性。

普通债券投资,由于对物价回升的判断,在2007年将继续维持低久期和低比重,等待风险释放后的机会。看好品种创新和经济数据波动以及供求关系变化给债券市场带来的阶段性和局部性投资机会,重点关注全球范围内的经济趋势特别是物价趋势。

可转债投资,维持其具有良好估值吸引力的判断,但基于短期内市场容量小、流动性不足等缺陷,维持低于基准的配置比重,加强对新品种的提前跟踪与分析,待市场容量上升后逐步提高配置。

股票投资,站在股票市场的新高点,纵观行业间和行业内的估值比较,未来选股较过去难度有很大提高,继续保持并加强与整个研究团队的交流与合作显得尤为重要。未来一年将重点从以下几个角度寻找行业和个股的投资机会:

a)中国在世界分工角色变化中起到重要作用的行业,特别是中国出口结构变化初期有较大发展空间的行业;

b)中国居民收入持续提高,从而对消费和服务的品质和多样化要求逐步提升,由此带来的行业和板块的投资机会仍将持续,尤其是奥运等事件所强化的品牌意识给优势企业创造的提升空间;

c)医疗体制改革带来的机会,这一改革也会给部分企业带来中短期的负面压力,需要更多地甄别;

d)绝对控股股东具有大量未上市优质资产并有治理结构改革要求的板块;

e)税制改革和税收扶植政策给相应行业或企业带来的竞争优势提升和发展潜力提高,特别是本科教育普及率大幅提高后,能够解决新就业问题的行业和板块。

4、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,交通银行在华安宝利配置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华安宝利配置证券投资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,由华安宝利配置证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安宝利配置证券投资基金的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真实、准确、完整。

六、审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师汪棣、陈宇签字出具了普华永道中天审字(2007)第20209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		148,464,268.88	14,011,925.49
清算备付金		4,145,192.49	2,482,464.13
交易保证金		609,609.61	631,465.52
应收证券清算款		10,034,187.78	0.00
应收利息		2,490,005.07	2,197,336.10
应收申购款		31,164,927.09	21,389,021.09
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		1,140,285,922.33	644,179,790.22
其中:股票投资成本		973,589,196.12	587,427,211.75
债券投资市值		381,666,363.72	401,104,589.84
其中:债券投资成本		374,055,358.62	399,494,133.93
权证投资		25,928,793.60	0.00
其中:权证投资成本		18,694,172.45	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		1,744,789,270.57	1,085,996,592.39
负债:			
应付证券清算款		0.00	8,717,535.16
应付赎回款		41,793,550.83	10,932,235.93
应付赎回费		18,141.33	3,497.86
应付管理人报酬		1,179,203.57	1,008,929.12
应付托管费		245,667.40	210,193.58
应付佣金		1,821,547.93	488,739.91
其他应付款		596,372.20	500,000.00
预提费用		100,000.00	59,000.00
负债合计		45,754,483.26	21,920,131.56
所有者权益:			
实收基金		1,473,522,718.96	986,910,091.28
未实现利得		181,650,823.10	86,387,252.19
未分配收益		43,861,245.25	-9,220,882.64
持有人权益合计		1,699,034,787.31	1,064,076,460.83
负债和所有者权益合计		1,744,789,270.57	1,085,996,592.39

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		660,068,311.16	4,068,731.61
债券差价收入		9,837,885.49	8,615,396.42
权证差价收入		42,006,356.87	780,892.07
债券利息收入		6,634,032.31	6,387,597.66
存款利息收入		837,474.14	500,375.66
股利收入		10,723,063.23	6,147,610.01
买入返售证券收入		23,671.23	83,699.74
其他收入		3,022,906.48	854,027.79
收入合计		733,153,700.91	27,438,330.96
费用:			
基金管理人报酬		13,359,575.14	8,081,645.56
基金托管费		2,783,244.74	1,683,676.13
卖出回购证券支出		1,655,159.78	190,390.96
其他费用		466,789.59	319,826.02
其中:信息披露费		260,000.00	260,000.00
审计费用		100,000.00	9,000.00
费用合计		18,264,769.25	10,275,538.67
基金净收益		714,888,931.66	17,162,792.29
加:未实现估值增值变动数		123,179,318.08	58,342,905.50
基金经营业绩		838,068,249.74	75,505,697.79

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		714,888,931.66	17,162,792.29
加:期初未分配收益		-9,220,882.64	5,402,032.00
加:本期申购基金份额的损益平准金		332,838,965.58	3,364,693.64
减:本期赎回基金份额的损益平准金		373,181,506.45	-234,832.05
可供分配基金净收益		665,325,508.15	26,164,349.98
减:本期已分配基金净收益		621,464,262.90	35,385,232.62
期末基金未分配净收益		43,861,245.25	-9,220,882.64

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		1,064,076,460.83	597,137,202.33
二、本期经营活动:			
基金净收益		714,888,931.66	17,162,792.29
未实现估值增值变动数		123,179,318.08	58,342,905.50
经营活动产生的基金净值变动数		838,068,249.74	75,505,697.79
三、本期基金单位交易:			
基金申购款		3,080,107,028.11	1,138,441,036.51
基金赎回款		-2,661,752,688.47	-711,622,243.18
基金单位交易产生的基金净值变动数		418,354,339.64	426,818,793.33
四、本期向持有人分配收益		621,464,262.90	35,385,232.62
五、期末基金净值		1,699,034,787.31	1,064,076,460.83

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。

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:

无。

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("华安基金")	基金管理人 基金注册登记机构 基金销售机构	提取管理费	基金合同
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人 基金代销机构	提取托管费、银行间交易	基金合同、成交确认书
上海国际信托投资有限公司	基金管理人的股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人的股东		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东		
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东		

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). 与关联方进行的交易

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:

本基金在本年度与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

	2006年度	2005年度
卖出债券结算金额	193,166,654.79	0.00

(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1.2%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 1.2% ÷ 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13,359,575.14元。(2005年:8,081,645.56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2,783,244.74元。(2005年度:1,683,676.13元)

(4). 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148,464,268.88元(2005年:14,011,925.49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651,550.59元(2005年:359,363.11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4,145,192.49元计入"结算备付金"科目(2005年:2,482,464.13元)。

5)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		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	50,000,000.00	5.07%	0.00	0.00	50,000,000.00	3.39%	0.00

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		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	50,000,000.00	8.39%	0.00	0.00	50,000,000.00	5.07%	0.00

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:

本报告期末与2005年末均无。

4.本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票列示如下:

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
方案实施阶段停牌:								
600290	S苏福马	2006/12/15	15.47	2007/02/01	22.01	817,692	10,708,153.14	12,649,695.24
000661	S长高新	2006/12/19	5.80	2007/01/19	6.70	1,000,000	5,520,724.48	5,800,000.00
合　计							16,228,877.62	18,449,695.24

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。

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
600456	宝钛股份	2006/09/12	发行结束日起12个月	31.00	31.00	400,000	12,400,000.00	12,400,000.00
600456	宝钛股份(转增股)	-	发行结束日起12个月	-	31.00	320,000	-	9,920,000.00
600761	安徽合力	2006/07/06	发行结束日起12个月	10.60	22.25	1,000,000	10,600,000.00	22,250,000.00
601628	中国人寿	2006/12/28	自新股网上申购部分上市后3个月	18.88	18.88	529,200	9,991,296.00	9,991,296.00
601988	中国银行	2006/06/28	2007/01/05	3.08	5.43	1,414,711	4,357,309.88	7,681,880.73
601872	招商轮船	2006/11/23	2007/03/01	3.71	7.95	392,160	1,454,913.60	3,117,672.00
601666	平煤天安	2006/11/10	2007/02/26	8.16	10.85	228,247	1,862,495.52	2,476,479.95
601006	大秦铁路	2006/07/26	2007/02/01	4.95	8.10	248,440	1,229,778.00	2,012,364.00
002073	青岛软控	2006/09/28	2007/01/18	26.00	47.35	29,813	775,138.00	1,411,645.55
002072	德棉股份	2006/09/22	2007/01/18	3.24	5.05	187,094	606,184.56	944,824.70
002070	众和股份	2006/09/20	2007/01/12	8.84	13.80	53,328	471,419.52	735,926.40
002071	江苏宏宝	2006/09/21	2007/01/12	3.88	7.01	102,417	397,377.96	717,943.17
002076	雪莱特	2006/10/12	2007/01/25	6.86	18.77	32,558	223,347.88	611,113.66
002084	海鸥卫浴	2006/11/14	2007/02/26	8.03	22.27	25,565	205,286.95	569,332.55
002078	太阳纸业	2006/11/03	2007/02/16	16.70	19.05	16,831	281,077.70	320,630.55
合 计							44,855,625.57	75,161,109.26

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券列示如下:

本基金截至2006年12月31日止无流通受限债券。

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	1,140,285,922.33	65.35%
2	债券	381,666,363.72	21.87%
3	权证	25,928,793.60	1.49%
4	银行存款和清算备付金	152,609,461.37	8.75%
5	其它资产	44,298,729.55	2.54%
	合计	1,744,789,270.57	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
B	采掘业	88,815,211.58	5.23%
C	制造业	609,481,486.95	35.87%
C0	食品、饮料	100,263,672.83	5.90%
C1	纺织、服装、皮毛	1,680,751.10	0.10%
C3	造纸、印刷	20,765,630.55	1.22%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	130,446,413.99	7.68%
C5	电子	34,777,819.96	2.05%
C6	金属、非金属	100,286,839.73	5.90%
C7	机械、设备、仪表	162,499,382.19	9.56%
C8	医药、生物制品	55,984,646.20	3.30%
C99	其他	2,776,330.40	0.16%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	17,505,548.08	1.03%
F	交通运输、仓储业	142,112,592.98	8.36%
G	信息技术业	13,639,460.00	0.80%
H	批发和零售贸易	80,074,766.53	4.71%
I	金融、保险业	102,913,176.73	6.06%
J	房地产业	43,700,000.00	2.57%
L	传播与文化产业	42,043,679.48	2.47%
合计		1,140,285,922.33	67.11%

(三)、股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占净值比例
1	600000	浦发银行	4,000,000	85,240,000.00	5.02%
2	000858	五粮液	3,502,643	80,035,392.55	4.71%
3	600028	中国石化	6,500,000	59,280,000.00	3.49%
4	000792	盐湖钾肥	2,500,060	58,901,413.60	3.47%
5	600694	大商股份	1,800,727	52,923,366.53	3.11%
6	600009	上海机场	2,662,657	50,350,843.87	2.96%
7	600761	安徽合力	2,100,000	46,725,000.00	2.75%
8	600037	歌华有线	1,691,218	42,043,679.48	2.47%
9	600596	新安股份	2,259,513	41,077,946.34	2.42%
10	600276	恒瑞医药	1,200,270	38,720,710.20	2.28%

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。

(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%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(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600028	中国石化	149,960,824.57	14.09%
2	600009	上海机场	108,251,057.21	10.17%
3	600037	歌华有线	87,535,127.41	8.23%
4	600000	浦发银行	87,415,739.55	8.22%
5	600036	招商银行	77,725,960.84	7.30%
6	000792	盐湖钾肥	77,619,474.91	7.29%
7	600761	安徽合力	67,980,377.25	6.39%
8	600694	大商股份	65,290,685.48	6.14%
9	600456	宝钛股份	64,002,827.07	6.01%
10	000858	五粮液	61,325,957.06	5.76%
11	600276	恒瑞医药	47,905,075.43	4.50%
12	000069	华侨城A	47,711,518.70	4.48%
13	000933	神火股份	44,947,519.86	4.22%
14	600596	新安股份	42,408,228.52	3.99%
15	600269	赣粤高速	36,527,377.46	3.43%
16	601006	大秦铁路	36,123,683.46	3.39%
17	600383	金地集团	35,398,934.19	3.33%
18	000951	中国重汽	35,369,735.70	3.32%
19	600268	国电南自	32,576,522.79	3.06%
20	600549	厦门钨业	29,799,677.57	2.80%
21	600561	江西长运	29,661,674.79	2.79%
22	000898	鞍钢股份	29,120,090.30	2.74%
23	600811	东方集团	28,775,035.22	2.70%
24	000061	农产品	28,645,774.77	2.69%
25	600308	华泰股份	27,893,703.37	2.62%
26	000528	柳工	27,818,032.31	2.61%
27	000768	西飞国际	27,634,935.41	2.60%
28	600123	兰花科创	26,067,962.14	2.45%
29	600261	浙江阳光	25,890,701.49	2.43%
30	600426	华鲁恒升	25,253,397.55	2.37%
31	600010	包钢股份	24,049,213.95	2.26%
32	000063	中兴通讯	23,301,803.53	2.19%
33	000401	冀东水泥	22,815,771.95	2.14%
34	600309	烟台万华	22,785,270.15	2.14%
35	600118	中国卫星	21,866,880.65	2.06%

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	600028	中国石化	146,120,925.79	13.73%
2	600456	宝钛股份	116,664,018.76	10.96%
3	600309	烟台万华	106,758,255.76	10.03%
4	000069	华侨城A	95,258,296.75	8.95%
5	600761	安徽合力	95,020,686.44	8.93%
6	600036	招商银行	92,117,728.61	8.66%
7	600519	贵州茅台	87,798,293.58	8.25%
8	000402	金融街	84,311,006.50	7.92%
9	000792	盐湖钾肥	74,934,722.83	7.04%
10	600009	上海机场	71,803,932.33	6.75%
11	600037	歌华有线	68,191,197.93	6.41%
12	600583	海油工程	54,198,893.56	5.09%
13	600269	赣粤高速	52,327,707.31	4.92%
14	600276	恒瑞医药	51,747,833.96	4.86%
15	000538	云南白药	50,002,859.36	4.70%
16	600123	兰花科创	42,165,976.99	3.96%
17	600858	银座股份	37,396,174.19	3.51%
18	002025	航天电器	33,341,559.07	3.13%
19	600261	浙江阳光	32,476,958.74	3.05%
20	600000	浦发银行	30,555,542.22	2.87%
21	600694