安信证券投资基金 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:	安信证券投资基金
基金简称:	基金安信
交易代码:	500003
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1998年6月22日
期末基金份额总额:	20亿份
基金存续期:	15年
基金上市地点:	上海证券交易所
基金上市日期:	1998年6月26日

(二)、基金的投资

投资目标:	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险,确保基金资产的安全,并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略:	本基金为成长型基金,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,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主业发展前景良好,在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势,财务状况良好,能保持较高的业绩增长,预期收入或利润增长率不低于同期 GDP 的增长率。
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:	中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")
注册及办公地址:	北京市西城区复兴门内大街 55 号 (邮政编码: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:	custody@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:	上海市南京东路 61 号 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

财务指标	2006年度	2005年度	2004年度
基金本期净收益	843,371,595.07	56,921,411.05	112,880,046.16
基金份额本期净收益	0.4217	0.0285	0.0564
期末可供分配基金收益	844,124,215.05	58,752,620.14	13,831,209.21
期末可供分配基金份额收益	0.4221	0.0294	0.0069
期末基金资产净值	4,391,139,401.91	2,128,528,128.79	2,035,119,374.06
期末基金份额净值	2.1956	1.0643	1.0176
基金加权平均净值收益率	28.14%	2.74%	5.26%
本期基金份额净值增长率	111.13%	5.17%	0.70%
基金份额累计净值增长率	407.46%	140.36%	128.54%

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

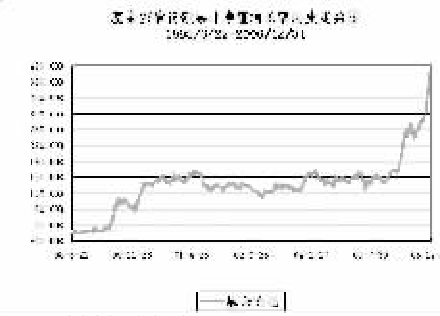
A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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	34.78%	2.53%	-	-	-	-
过去六个月	37.82%	2.54%	-	-	-	-
过去一年	111.13%	2.62%	-	-	-	-
过去三年	123.59%	2.42%	-	-	-	-
过去五年	133.67%	2.17%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	407.46%	2.38%	-	-	-	-

备注:本基金合同中没有规定业绩比较基准。

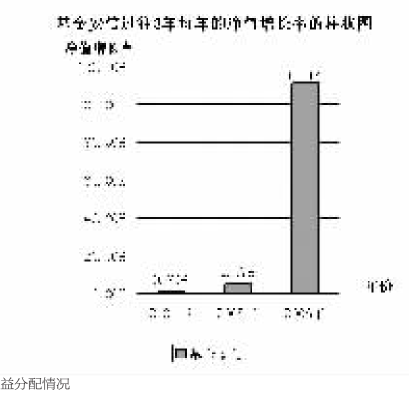
B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

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)、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	0.290 元	-
2005年度	0.060 元	-
2004年度	0.600 元	-

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。

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、安信证券投资基金的基金经理、华安宝利配置基金的基金经理。

(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《安信证券投资基金基金合同》、《安信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。

(三)、基金经理工作报告

以 2005 年启动的股权分置改革为标志,中国股票市场在随后的一年半中出现了根本性的变化。从证券市场发展史的角度看,2006 年的证券市场至少在以下三个方面取得了显著的成就:

资本市场功能的恢复:我们认为股权分置改革的完成并不仅仅意味着股改对价和全流通上市。更重要的是,股权分置改革恢复了资本市场的基础功能。尽管融资是资本市场的基本功能,但资本市场的作用远远不局限于融资。资本市场作为现代市场经济的中心之一,不仅仅是一个融资的中心,还是财富的中心、理财的中心、估值的中心、创业的中心和全社会注意力中心。

资本化率的提高:2006 年优质公司加速回归国内资本市场大大提高了 A 股市场对国民经济的代表性,使资本市场和实体经济的关联度得到了大幅度的提高。

居民理财意识的提高:A 股市场的繁荣刺激了广大居民的投资欲望,更重要的是大大提高了居民的理财意识。市场的良性发展和居民投资意识的提高之间形成了良性的互动。

2006 年基金安信净值增长率 111.13%。在 2006 年的投资中,基金安信在秉承一贯坚持的成长投资风格的基础上,尝试加强组合层面的分析与构造,实现自下而上和自上而下之间的有机结合。在上半年进行了主题配置,增持了包括军工、商业、消费品、医药等在内的主题类资产,以丰富主题覆盖的广度。在三季度继续以重构组合的框架为核心,通过自上而下和自下而上的双向考虑优化组合结构,适应阶段性宏观和微观层面的变化。在四季度我们根据"成长与价值的背离愈加明显"的判断,根据相对收益预期的比较,在保持基金整体成长性风格的基础上,适度提高了价值和重估类资产的持仓比例。以适应在市场流动性相对充足的背景下以稀缺与重估为核心的阶段性市场运行特征。

总结全年的投资情况,主要有以下几个方面的工作没有做好:

没有平衡好长期投资和阶段性结构调整之间的关系。尽管安信秉承选择优质个股进行长期投资的理念,但 2006 年的市场明显存在阶段性的风格变化以及板块相对吸引力的变化,安信过于拘泥于长期投资而未进行较大力度的阶段性结构调整。

对潜力板块的投资力度不足。尽管安信在投资结构性趋势的把握上并不存在重大偏差和遗漏,但是在投资力度的把握上比较保守。

展望 2007 年,基金安信认为 A 股市场将继续延续 2005 年下半年以来的健康发展态势。保持稳定较快发展的中国内地经济环境、资本市场功能的进一步深化、不断提高的居民投资倾向都将为市场的发展提供了力量。但是,目前市场的整体估值已经处于较高水平、进入价值创造阶段的市场将出现明显的信息不对称使共同基金的投资面临较大的压力。

(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年度,本基金托管人在对安信证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,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基金托管人应尽的义务。

2006 年度,安信证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在安信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信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、李刚出具了标准无保留意见的审计报告。

七、财务会计报告

单位:人民币元

(一)、资产负债表

项 目	附注	2006年12月31日	2005年12月31日
资产:			
银行存款		27,562,090.30	153,159,938.64
清算备付金		4,047,376.69	2,172,891.93
交易保证金		848,780.49	1,098,780.49
应收证券清算款		25,493,782.68	0.00
应收股利		0.00	0.00
应收利息		7,682,791.88	6,506,140.49
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		3,387,291,674.40	1,576,118,675.73
其中:股票投资成本		1,857,755,610.96	1,512,251,434.93
债券投资市值		896,870,514.76	441,134,845.80
其中:债券投资成本		896,436,968.92	435,226,577.95
权证投资市值		50,910,820.98	0.00
其中:权证投资成本		33,865,243.40	0.00
配股权证		0.00	0.00
买入返售债券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		4,400,707,832.18	2,180,191,273.08
负债:			
应付证券清算款		0.00	45,778,626.50
应付管理人报酬		5,224,960.49	2,614,802.72
应付托管费		870,826.76	435,800.45
应付佣金		1,502,643.02	1,113,914.62
应付利息		0.00	0.00
应付收益		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款		1,750,000.00	1,500,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用		220,000.00	220,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		9,568,430.27	51,663,144.29
所有者权益:			
实收基金		2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未实现利得		1,547,015,186.86	69,775,508.65
未分配收益		844,124,215.05	58,752,620.14
持有人权益合计		4,391,139,401.91	2,128,528,128.79
负债和所有者权益合计		4,400,707,832.18	2,180,191,273.08

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、经营业绩表

项 目	附注	2006年度	2005年度
收入:			
股票差价收入		753,152,477.99	37,160,218.30
债券差价收入		1,335,999.72	11,714,817.90
权证差价收入		79,090,768.40	2,273,881.94
债券利息收入		17,118,758.01	14,327,645.28
存款利息收入		1,425,354.69	1,455,586.75
股利收入		45,545,488.82	26,953,791.58
买入返售证券收入		387,386.30	0.00
其他收入		322.50	12,665.74
收入合计		898,056,556.43	93,898,607.49
费用:			
基金管理人报酬		44,278,844.39	31,185,603.84
基金托管费		7,379,807.36	5,197,600.65
卖出回购证券支出		2,317,873.11	3,013.70
利息支出		0.00	0.00
其他费用		708,436.50	590,978.25
其中:信息披露费		300,000.00	340,000.00
上市年费		60,000.00	60,000.00
审计费用		100,000.00	120,000.00
费用合计		54,684,961.36	36,977,196.44
基金净收益		843,371,595.07	56,921,411.05
加:未实现估值增值变动数		1,477,239,678.21	48,487,343.80
基金经营业绩		2,320,611,273.28	105,408,754.85

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、收益分配表

项 目	附注	2006年度	2005年度
本期基金净收益		843,371,595.07	56,921,411.05
加:期初未分配收益		58,752,620.14	13,831,209.21
可供分配基金净收益		902,124,215.21	70,752,620.26
减:本期已分配基金净收益		58,000,000.16	12,000,000.12
期末基金未分配净收益		844,124,215.05	58,752,620.14

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、净值变动表

项 目	附注	2006年度	2005年度
一、期初基金净值		2,128,528,128.79	2,035,119,374.06
二、本期经营活动:			
基金净收益		843,371,595.07	56,921,411.05
未实现估值增值变动数		1,477,239,678.21	48,487,343.80
经营活动产生的基金净值变动数		2,320,611,273.28	105,408,754.85
三、本期向持有人分配收益		-58,000,000.16	-12,000,000.12
四、期末基金净值		4,391,139,401.91	2,128,528,128.79

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:

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,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的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
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	管理公司股东 基金发起人	持有本基金	
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		

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本年度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。

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。

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本年度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本年度与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

关联人	买入债券结算金额	卖出债券结算金额	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行股份有限公司	21,092,975.34	0.00	0.00	0.00	488,100,000.00	269,841.95

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,具体计算方法如下:

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,若遇节假日、公休假等,支付日期顺延。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 44,278,844.39 元。(上年度:31,185,603.84 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 7,379,807.36 元。(上年度:5,197,600.65 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,按银行同业利率计算。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 27,562,090.30 元(2005 年:153,159,938.64 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 1,355,859.63 元(2005 年:1,412,942.52 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		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	14,433,600	0.72	-	-	14,433,600	0.72	-

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	12,000,000	0.60	2,433,600	-	14,433,600	0.72	-

(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:

关联人	2006年度		2005年度	
	持有份额	持有比例(%)	持有份额	持有比例(%)
上海国际信托投资有限公司	18,000,000	0.90	18,000,000	0.90

1. 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如下:

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	数量	总成本	总市值	年末估值单价	转让受限原因	停牌日	复牌日	复牌日开盘价格
600582	S天地	1,126,768	25,984,951.53	28,552,301.12	25.34	股权分置改革停牌	2006-12-14	2007-01-15	30.00
	合 计		25,984,951.53	28,552,301.12					

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
大秦铁路	1,417,300	7,015,635.00	11,465,957.00	8.09	网下新股未上市	至 2007 年 2 月 1 日
广深铁路	1,409,000	5,297,840.00	10,102,530.00	7.17	网下新股未上市	至 2007 年 3 月 22 日
中国人寿	99,000	1,869,120.00	1,869,120.00	18.88	网上新股未上市	至 2007 年 1 月 9 日
中国人寿	551,250	10,407,600.00	10,407,600.00	18.88	网下新股未上市	至 2007 年 4 月 9 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
合计		25,018,282.00	34,894,020.15			

2006 年 11 月 13 日前,基金投资的非公开发行股票,在非公开发行股票上市后的约定期限内不能自由转让。

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
宝钛股份	1,800,000	31,000,000.00	55,764,000.00	30.98	非公开发行股票未流通	至 2007 年 9 月 12 日
伟星股份	1,500,000	13,590,000.00	25,260,000.00	16.84	非公开发行股票未流通	至 2007 年 9 月 28 日
合计		44,590,000.00	81,024,000.00			

自 2006 年 11 月 13 日起,基金投资的非公开发行股票,在非公开发行股票上市后的约定期限内不能自由转让。按证监会《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》中规定的方法估值。详见本会计报表附注中基金资产的估值原则。

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
华鲁恒升	6,000,000	45,000,000.00	47,880,000.00	7.98	非公开发行股票未流通	至 2007 年 11 月 22 日
合计		45,000,000.00	47,880,000.00			

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

一、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	3,387,291,674.40	76.97%
2	债券	896,870,514.76	20.38%
3	权证	50,910,820.98	1.16%
4	银行存款和清算备付金合计	31,609,466.99	0.72%
5	其他资产	34,025,355.05	0.77%
	合计	4,400,707,832.18	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	406,361,578.98	9.25%
C 制造业	1,734,714,177.09	39.50%
C0 食品、饮料	235,480,000.00	5.36%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	501,947,500.92	11.43%
C5 电子	38,247,900.60	0.87%
C6 金属、非金属	301,670,823.50	6.87%
C7 机械、设备、仪表	471,561,292.55	10.74%
C8 医药、生物制品	160,546,659.52	3.66%
C99 其他制造业	25,260,000.00	0.58%
F 交通运输、仓储业	294,957,741.54	6.72%
G 信息技术业	135,687,258.09	3.09%
H 批发和零售贸易	292,914,450.32	6.67%
I 金融、保险业	186,734,948.94	4.25%
J 房地产业	130,574,259.60	2.97%
K 社会服务业	95,538,520.84	2.18%
L 传播与文化产业	109,808,739.00	2.50%
合 计	3,387,291,674.40	77.14%

(三)、 基金投资前十名股票明细

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	600028	中国石化	28,000,000	255,640,000.00	5.82%
2	600309	烟台万华	10,000,000	240,900,000.00	5.49%
3	000792	盐湖钾肥	8,915,412	213,167,500.92	4.85%
4	600761	安徽合力	7,000,000	157,010,000.00	3.58%
5	600009	上海机场	8,000,000	153,200,000.00	3.49%
6	000858	五 粮 液	6,500,000	147,680,000.00	3.36%
7	600036	招商银行	8,000,000	129,840,000.00	2.96%
8	600456	宝钛股份	3,840,000	118,963,200.00	2.71%
9	002007	华兰生物	5,000,000	114,400,000.00	2.61%
10	600037	歌华有线	4,504,050	109,808,739.00	2.50%

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

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	600028	中国石化	136,451,198.26	6.41%
2	000858	五 粮 液	115,685,727.89	5.44%
3	600009	上海机场	103,112,462.02	4.84%
4	600694	大商股份	94,215,379.00	4.43%
5	601006	大秦铁路	83,659,623.66	3.93%
6	600761	安徽合力	78,002,211.57	3.66%
7	600269	赣粤高速	73,058,592.73	3.43%
8	000402	金 融 街	69,161,002.09	3.25%
9	600886	国投电力	68,748,750.00	3.23%
10	600037	歌华有线	68,031,917.82	3.20%
11	000768	西飞国际	64,238,838.16	3.02%
12	600456	宝钛股份	55,830,342.57	2.62%
13	000898	鞍钢股份	55,596,914.31	2.61%
14	000063	中兴通讯	52,878,965.96	2.48%
15	600271	航天信息	48,518,335.99	2.28%
16	000625	长安汽车	48,003,457.42	2.26%
17	600000	浦发银行	47,736,830.73	2.24%
18	000069	华侨城 A	47,630,193.51	2.24%
19	002007	华兰生物	46,675,247.46	2.19%
20	600426	华鲁恒升	45,000,000.00	2.11%
21	600036	招商银行	43,370,562.49	2.04%

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	600309	烟台万华	215,831,019.91	10.14%
2	600036	招商银行	194,107,046.59	9.12%
3	000792	盐湖钾肥	132,519,239.99	6.23%
4	600660	福耀玻璃	130,234,813.61	6.12%
5	600050	中国联通	111,187,654.38	5.22%
6	600196	复星医药	109,047,570.29	5.12%
7	600583	海油工程	106,763,633.07	5.02%
8	600851	海欣股份	104,949,435.52	4.93%
9	600269	赣粤高速	82,267,222.18	3.86%
10	000089	深圳机场	82,118,275.46	3.86%
11	600028	中国石化	73,633,537.04	3.46%
12	000768	西飞国际	69,364,160.88	3.26%
13	000402	金 融 街	66,402,509.61	3.12%
14	600886	国投电力	65,995,041.14	3.10%
15	000970	中科三环	58,762,915.85	2.76%
16	600519	贵州茅台	54,459,210.07	2.56%
17	600066	宇通客车	47,423,569.34	2.23%
18	600261	浙江阳光	45,210,750.72	2.12%
19	600598	北 大 荒	42,320,885.73	1.99%
20	600096	云 天 化	35,137,765.18	1.65%

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:	2,672,407,895.97
卖出股票的收入总额:	3,052,487,813.01

* 注:买入股票的成本总额未扣减股权分置获得现金对价 30,129,897.75 元。

(五)、债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	316,734,954.76	7.21%
2	金融债券	580,135,560.00	13.21%
	合计	896,870,514.76	20.42%

(六)、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	060225	06国开 25	1,900,000	189,769,100.00	4.32%
2	010214	02国债⒁	659,980	66,354,389.20	1.51%
3	060303	06进出 03	600,000	60,033,000.00	1.37%
4	060229	06国开 29	600,000	59,914,500.00	1.36%
5	060019	06国债 19	500,000	49,774,829.36	1.13%

(七)、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	数量	市值(元)	占资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	3,505,772	50,910,820.98	1.16%

(八)、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。

(九)、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,未上市交易的权证投资(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,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。

本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	848,780.49
2	应收利息	7,682,791.88
3	应收证券清算款	25,493,782.68
	合计	34,025,355.05

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	成本总额(元)	获得途径
1	580005	万华 HXB1	2,661,862	0.00	股权分置改革被动持有
2	580990	茅台 JCP1	2,462,928	0.00	股权分置改革被动持有
3	580993	万华 HXP1	3,992,793	0.00	股权分置改革被动持有
4	580997	招行 CMP1	9,000,000	0.00	股权分置改革被动持有
5	038005	深能 JTP1	2,532,690	0.00	股权分置改革被动持有
6	038008	钾肥 JTP1	3,600,000	0.00	股权分置改革被动持有
7	030002	五粮 YGC1	3,505,772	33,865,243.40	主动投资
8	031001	侨城 HQC1	500,000	5,575,250.85	主动投资

6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下:

	基金份额
2006年1月1日	14,433,600.00 份
买入	0.00 份
卖出	0.00 份
2006年12月31日	14,433,600.00 份

九、基金份额持有人户数和持有人结构

(一)、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	100,524 户	
平均每户持有基金份额	19,896 份	
项目	份额(份)	占总份额的比例
机构投资者持有的基金份额	862,266,921	43.11%
个人投资者持有的基金份额	1,137,733,079	56.89%

(二)、前十名持有人的名称

序号	项目	份额(份)	占总份额的比例
1	中国人寿保险股份有限公司	187,468,353	9.37%
2	中国人寿保险(集团)公司	154,177,825	7.71%
3	新华人寿保险股份有限公司	81,996,996	4.10%
4	中国平安保险(集团)股份有限公司	52,490,844	2.62%
5	光大证券-工行-光大阳光 2 号集合资产管理计划	51,887,056	2.59%
6	华泰证券-招行-华泰紫金 2 号集合资产管理计划	42,066,641	2.10%
7	全国社保基金六零二组合	33,440,769	1.67%
8	宝钢集团有限公司	26,750,000	1.34%
9	全国社保基金六零四组合	21,918,730	1.10%
10	上海国际信托投资有限公司	18,000,000	0.90%

十、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议:无。

(二)、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

1、本基金管理人重大人事变动如下:

(1). 2006 年 2 月 15 日,本基金管理人发布关于董事变更的公告,鉴于第二届董事会任期已经届满,经本基金管理人第十三次股东会议选举,产生由王成明先生、韩方河先生、辜昌基先生、俞妙根先生、顾培柱先生、张军先生、萧灼基先生、吴伯庆先生、夏大慰先生组成的第三届董事会,其中萧灼基先生,吴伯庆先生、夏大慰先生为独立董事。杜建国先生、缪恒生先生、柳亚男先生、陶晋先生、李华强先生、朱勇先生不再担任本公司董事。

(2). 2006 年 3 月 9 日,本基金管理人发布关于基金经理变更的公告,经公司董事会审议批准并报中国证监会备案,决定聘用汤礼辉先生担任安信证券投资基金基金经理,林彤彤先生不再担任安信证券投资基金基金经理职务。

(3). 2006 年 5 月 27 日,本基金管理人发布关于变更公司董事长的公告,经本基金管理人第三届董事会会议审议通过,并报中国证监会审核批准,免去杜建国先生董事长职务,由王成明先生代为履行公司董事长职务。

(4). 2006 年 8 月 19 日,本基金管理人发布关于由俞妙根先生代行董事长职务的公告,经本基金管理人第三届董事会审议通过,决定免除王成明先生公司代行董事长的职务,由俞妙根先生代为履行公司董事长的职务。

(5). 2006 年 10 月 17 日,本基金管理人发布如下临时公告,接上级部门通知,公司总经理韩方河同志因涉嫌个人违纪,正在协助调查。对于上述事件,公司特澄清如下:一、上述调查仅涉及韩方河同志个人,与本公司及本公司旗下基金无关。二、公司在董事会的领导和大力支持下,目前公司的日常工作由常务副总经理邵杰军同志负责。本公司目前运作一切正常。

(6). 2006 年 11 月 7 日,本基金管理人发布如下临时公告,经股东会选举,徐建国先生、万才华先生任公司董事,王成明先生、韩方河先生不再担任公司董事;谢伟民先生、柳振铎先生任公司监事,韩国璋先生不再担任公司监事。经董事会选举,徐建国先生拟任公司董事长,俞妙根先生任公司副董事长,俞妙根先生不再担任代董事长;经华安基金管理有限公司监事会选举,谢伟民任公司监事长,陈涵不再担任监事长。经董事会审议,拟聘任俞妙根先生任公司总经理,韩方河先生不再担任公司总经理。上述董事、监事人员的变更按规定需报中国证监会备案,董事长的选举、总经理的聘任按规定尚需报中国证监会核准,在中国证监会核准程序没有完成之前,徐建国先生主持公司董事会工作,俞妙根先生主持公司日常工作。

(7). 2007 年 3 月 22 日,本基金管理人发布如下临时公告,根据《证券投资基金行业高级管理人员任职管理办法》的规定,经华安基金管理有限公司股东会议决议,同意张军先生因个人原因辞去本公司董事职务。上述人员的变更已报中国证监会上海证监局备案。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:无。

(三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼:无。

(四)、基金投资策略的改变:无。

(五)、基金收益分配事项:

1、本报告期基金收益分配事项:

	分红公告日	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额收益分配金额	收益分配金额
本期第 1 次分红	2006-4-13	2006-4-18	2006-4-19	0.29 元	58,000,000.16

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况:无。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况:100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自 2004 年 12 月 13 日起至今。

(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形,包括稽查或处罚的次数、原因及结论,如监管部门提出整改意见的,应简单说明整改情况:无。

(八)、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:

新增席位:		
券商名称	上交所席位数	深交所席位数
银河证券有限责任公司	-	1
中国建银投资证券有限责任公司	1	-
退租席位:		
券商名称	上交所席位数	深交所席位数
上海证券有限责任公司	-	1
天同证券有限责任公司	1	1

2.交易成交量及佣金情况:

(1). 股票交易情况:

券商名称	席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
上海证券有限责任公司	1	239,951,830.18	4.35%	195,748.99	4.43%
银河证券有限责任公司	1	314,129,040.05	5.70%	245,807.88	5.56%
招商证券股份有限公司	1	152,302,355.51	2.76%	124,642.48	2.82%
申银万国证券股份有限公司	1	767,482,983.61	13.93%	600,560.87	13.59%
光大证券股份有限公司	1	1,255,562,023.55	22.79%	1,015,869.38	22.99%
国信证券有限责任公司	2	952,135,531.96	17.28%	757,393.62	17.14%
海通证券股份有限公司	1	283,148,408.84	5.14%	231,871.83	5.25%
国泰君安证券股份有限公司	1	361,997,947.39	6.57%	295,346.59	6.69%
红塔证券股份有限公司	1	295,624,231.05	5.37%	241,801.44	5.47%
渤海证券有限责任公司	1	339,302,488.11	6.16%	275,088.30	6.23%
中银国际证券有限责任公司	1	405,250,936.86	7.35%	317,111.90	7.18%
中国建银投资证券有限责任公司	1	143,049,364.70	2.60%	116,549.98	2.64%
合计	13	5,509,937,141.81	100.00%	4,417,793.26	100.00%

(2). 债券、回购及权证交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例	权证成交量	占总成交总量比例
上海证券有限责任公司	25,833,584.30	2.21%	150,000,000.00	5.98%	0.00	0.00%
银河证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券股份有限公司	24,196,555.00	2.07%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国证券股份有限公司	1,263,503.20	0.11%	0.00	0.00%	56,903,997.82	45.85%
光大证券股份有限公司	813,861,810.00	69.59%	791,700,000.00	31.58%	59,325,216.81	47.80%
国信证券有限责任公司	118,348,176.60	10.12%	390,000,000.00	15.56%	0.00	0.00%
海通证券股份有限公司	30,429,080.00	2.60%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	41,707,320.20	3.57%	250,000,000.00	9.97%	0.00	0.00%
红塔证券股份有限公司	60,263,741.10	5.15%	0.00	0.00%	4,913,957.16	3.96%
渤海证券有限责任公司	53,593,482.50	4.58%	775,500,000.00	30.93%	0.00	0.00%
中银国际证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	2,966,420.40	2.39%
中国建银投资证券有限责任公司	0.00	0.00%	150,000,000.00	5.98%	0.00	0.00%
合计	1,169,497,252.90	100.00%	2,507,200,000.00	100.00%	124,109,592.19	100.00%

3. 券商专用席位选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用,选择标准为:

(1) 资历雄厚,信誉良好;

(2) 财务状况良好,经营行为规范;

(3) 内部管理规范、严格,具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要,并能为本基金提供全面的信息服务;

(5) 证券研究或市场研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面研究报告及周到的信息服务,并能根据基金投资的特定要求,提供专题研究报告。

4. 券商专用席位选择程序:

(1) 对席位候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部等部门组织相关人员依据上述席位选择标准和《券商服务评价办法》,对候选席位的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增席位申请审核表》

研究发展部等部门汇总对各候选席位券商的综合评估结果,择优选出拟新增席位,填写《新增席位申请审核表》,对拟新增席位的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选席位名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部等部门提交的《新增席位申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核,并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易席位使用协议》,并通知基金托管人。

(九)、其他重要事项。

	其他重要事项	披露日期
1)	华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金 2005 年度收益分配决议。	2006年 3 月 28 日
2)	华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金 2005 年度收益分配实施公告,向全体持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 0.29 元。	2006年 4 月 13 日
3)	华安基金管理有限公司关于开通全国统一客户服务号码的公告,公司自 2006 年 6 月 20 日起正式开通全国统一客户服务号码 40088-50099(长途话费由本公司支付),客户通过固定电话、小灵通和手机均可拨打。本公司原客户服务号码 021-68604666 仍可继续使用。	2006年 6 月 20 日
4)	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资资产支持证券的公告,可以投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券。	2006年 6 月 28 日
5)	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资 G 宝钛(600456)非公开发行股票的公告	2006年 9 月 14 日
6)	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资伟星股份(002003)非公开发行股票的公告	2006年 10 月 11 日
7)	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资华鲁恒升(600427)非公开发行股票的公告	2006年 11 月 25 日
8)	华安基金管理有限公司关于修改旗下基金基金合同的公告,对收益分配条款和基金份额持有人大会表决条款作出修改。	2006年 12 月 21 日
9)	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资山东药玻(600529)非公开发行股票的公告	2007年 3 月 5 日
10)	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资晶源电子(002049)非公开发行股票的公告	2007年 3 月 15 日

前款所涉重大事件已作为临时报告在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》上披露。

十一、备查文件目录

1、《安信证券投资基金基金合同》

2、《安信证券投资基金招募说明书》

3、《安信证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准安信证券投资基金设立的文件;

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件;

6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

7、基金托管人业务资格批件和营业执照;

8、上述文件的存放地点和查阅方式如下:

存放地点:基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站 http://www.huaan.com.cn。

查阅方式:投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
2007 年 3 月 31 日

华安基金管理有限公司
安信证券投资基金 2006 年度收益分配公告

本公司所管理的安信证券投资基金(以下简称"基金安信")2006 年度财务报告已由上海立信长江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》、《安信证券投资基金基金合同》及其他法律法规的规定,本公司议定了基金安信 2006 年度收益分配方案,经基金托管人中国工商银行股份有限公司复核,现公告如下:

一、收益分配方案

截至 2006 年末,基金安信可供分配收益为 844,124,215.05 元。本基金管理人决定 2006 年度收益分配方案为:向全体持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 4.20 元,共派发现金红利 840,000,000.00 元,占可供分配收益的 99.51%。

根据财政部、国家税务总局共同发布的财税字[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》,基金向投资者分配基金收益,暂免征所得税。

二、收益分配对象

2007 年 4 月 5 日下午交易结束后,在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司登记在册的基金安信的全体持有人。

三、权益登记日、除息日和红利发放日

权益登记日:2007 年 4 月 5 日

除息交易日:2007 年 4 月 6 日

红利发放日:2007 年 4 月 12 日

四、收益发放办法

本公司于 2007 年 4 月 10 日将本基金收益分配的款项及代理发放收益的手续费足额划入中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的指定银行账户。中国证券登记结算有限责任公司上海分公司在 2007 年 4 月 11 日将已办理指定交易的投资者的现金红利金额通过资金结算系统划付给被指定交易的证券公司,投资者可在 2007 年 4 月 12 日领取现金红利。对未办理指定交易的投资者的现金红利暂由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司保管,待其办理指定交易并经确认后即将其尚未领取的现金红利划付给被指定交易的证券公司,投资者在办理指定交易后的第二个交易日可领取现金红利。

五、咨询办法

1、华安基金管理有限公司网站:http://www.huaan.com.cn;

2、华安基金管理有限公司客户服务热线:40088-50099。

特此公告

华安基金管理有限公司
2007 年 3 月 31 日