

华安策略优选股票型证券投资基金2007 年年度报告摘要

(上接D128页)

本基金投资组合中,投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。于2007年8月1日,本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

Table with columns for 2007年8月1日 (基金合同生效前) and 2006年12月31日, showing fair value and percentage of net asset value for various assets like 交易性金融资产, 股票投资, etc.

本基金以 中标300指数*75%+中信国债指数*20%+金融同业存款利率*5% 为基础衡量市场价格风险。于2007年8月1日(基金合同生效前日),若 中标300指数*75%+中信国债指数*20%+金融同业存款利率*5% 上升5%且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将相应增加约4,138万元(2006年:4,260万元);反之,若 中标300指数*75%+中信国债指数*20%+金融同业存款利率*5% 下降5%且其他市场变量保持不变,本基金资产净值则将相应下降约4,138万元(2006年:4,260万元)。

利率风险
利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

Table showing interest rate risk exposure for 2007年8月1日 and 2006年12月31日, categorized by maturity (1年内, 1年至5年, 5年以上, 不计息, 合计).

Table showing asset and liability breakdown for 2007年8月1日 and 2006年12月31日, including 银行存款, 结算备付金, 交易性金融资产, etc.

于2007年8月1日,若市场利率下降25个百分点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将相应增加约9万元(2006年:89万元);反之,若市场利率上升25个百分点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值则将相应下降约9万元(2006年:89万元)。

外汇风险
本基金的所有资产及负债均以人民币计价,因此无重大外汇风险。

首次执行企业会计准则
本财务报表为按企业会计准则编制,因此无重大会计政策变更。

按原会计准则和制度列报的2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净资产,以及2006年度和2007年1月1日至2007年6月30日止期间的净资产调整额为按企业会计准则列报的所有者权益及净利润的调节过程列示如下:

Table showing adjustments to net assets and net income from original GAAP to IAS, with columns for 2007年1月1日 and 2007年6月30日.

根据上述追溯调整,按原会计准则和制度计算的所有者权益下 未实现利得/损失/科目中的投资价值增值/减值 将变动计入公允价值变动损益,在利润表中的 公允价值变动收益/损失/科目中核算。于会计期末,按原会计准则和制度列示的所有者权益下 未实现利得/损失/科目中的全部余额,按企业会计准则包含于 公允价值变动损益/科目中。

九、华安策略优选股票型证券投资基金投资组合报告

(一)基金资产组合

Table showing asset composition for 2007年8月1日 and 2007年6月30日, including 股票, 权证, 债券, etc.

(二)股票投资组合

Table showing industry classification and market value for the stock portfolio as of 2007年8月1日.

(三)基金投资前十名股票明细

Table listing the top 10 stock holdings as of 2007年8月1日, including 招商银行, 中信证券, etc.

投资者想了解本报告期内基金投资的所有股票明细,应阅读载于http://www.huauan.cn网站的年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动

1.本期累计买入、卖出价值超期初基金资产净值2%或前二十名股票明细

Table showing major changes in the top 20 stock holdings during the reporting period.

(五)债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六)基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七)权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八)资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond holdings as of 2007年8月1日.

(七) 权证投资组合

1.基金投资前五名权证明细

Table listing the top 5 warrant holdings as of 2007年8月1日.

(八) 资产支持证券投资组合

本基金本报告期末未投资资产支持证券。

(九) 投资组合报告附注

1.买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

Table showing total cost of stocks bought and total income from stocks sold during the period.

(五) 债券投资组合

Table showing bond portfolio details as of 2007年8月1日.

(六) 基金投资前五名债券明细

Table listing the top 5 bond