

安久证券投资基金
2007 年半年度报告
(现已更名为
华安策略优选股票型证券投资基金)

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

签发日期：2007 年 8 月 28 日

一、	重要提示.....	3
二、	基金产品概况.....	3
1、	基金概况.....	3
2、	基金的投资.....	3
3、	基金管理人.....	4
4、	基金托管人.....	4
5、	信息披露.....	4
6、	登记注册机构.....	5
三、	主要财务指标和基金净值表现.....	5
1、	主要财务指标（未经审计）.....	5
2、	净值表现.....	5
四、	管理人报告.....	6
1、	基金管理人及基金经理情况.....	6
2、	基金运作合规性声明.....	7
3、	基金经理工作报告.....	7
五、	托管人报告.....	8
六、	财务会计报告（未经审计）.....	8
(一)、	资产负债表.....	8
(二)、	经营业绩表.....	9
(三)、	收益分配表.....	10
(四)、	净值变动表.....	10
(五)、	会计报表附注.....	10
七、	投资组合报告.....	15
(一)、	基金资产组合.....	15
(二)、	股票投资组合.....	15
(三)、	股票明细.....	16
(四)、	报告期内股票投资组合的重大变动.....	17
(五)、	债券投资组合.....	18
(六)、	权证投资组合.....	18
(七)、	资产支持证券投资组合.....	19
(八)、	投资组合报告附注.....	19
八、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	19
九、	重大事件.....	20
十、	备查文件目录.....	24

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。本半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 8 月 22 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。

二、基金产品概况

1、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
报告期末基金份额总额：	5 亿份
基金合同存续期：	15 年（自 1992 年 8 月 31 日至 2007 年 8 月 30 日）
基金份额上市交易的证券交易所：	深圳证券交易所
上市日期：	2001 年 8 月 31 日

2、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

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 38 楼
(邮政编码 : 200120)
法定代表人 : 王成明
信息披露负责人 : 冯颖
联系电话 : 021-38969999
传真 : 021-68863414
电子邮箱 : fengying@huan.com.cn
客户服务热线 : 021-68604666、4008850099

4、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

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
管理人互联网网址 : <http://www.huan.com.cn>

基金半年度报告置备 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼
地点：

6、登记注册机构

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

1、主要财务指标（未经审计）

财务指标	本报告期
基金本期净收益：	487,936,850.30
加权平均基金份额本期净收益：	0.9759
期末可供分配基金收益	492,363,184.59
期末可供分配基金份额收益	0.9847
期末基金资产净值：	1,462,585,810.01
期末基金份额净值：	2.9252
基金加权平均净值收益率	39.90%
本期基金份额净值增长率	59.61%
基金份额累计净值增长率	199.16%

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。

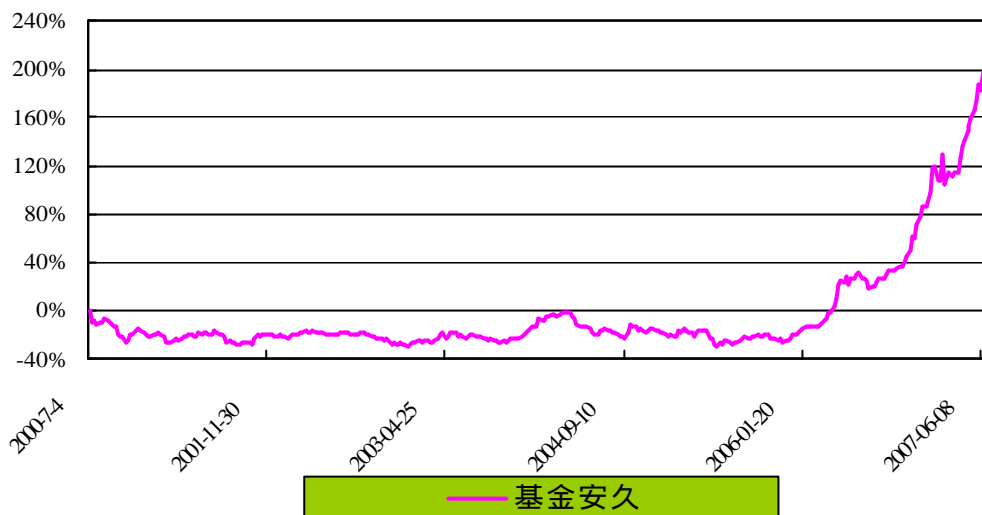
2、净值表现

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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去一个月	8.80%	3.74%	--	--	--	--
过去三个月	39.30%	2.68%	--	--	--	--
过去六个月	59.61%	4.43%	--	--	--	--
过去一年	129.13%	3.70%	--	--	--	--
过去三年	270.31%	3.19%	--	--	--	--
过去五年	264.02%	2.78%	--	--	--	--
自基金合同生效起至今	199.16%	2.70%	--	--	--	--

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金安久份额累计净值增长率历史走势图
2000/7/4--2007/6/30



四、 管理人报告

1、 基金管理人及基金经理情况

(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 2007 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺、基金安久 3 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、华安成长、华安宏利、华安国际配置等 8 只开放式基金，管理人民币资产规模达到 604.36 亿元、美元资产 1.88 亿美元。

(2)、 基金经理

鲍泓先生，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等工作。

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《安久证券投资基金基金合同》、《安久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) 行情回顾

上半年 A 股市场继续呈现出强劲的上扬行情,但在持续大幅上涨后市场波动也有所加剧。上半年市场有几大突出特点:一是宏观数据表现强劲。一季度 GDP 增速达到 11.1%,二季度更上升到 11.9%。其中,投资增速维持高位,净出口继续增长迅速;同时伴随 CPI 上涨,消费增长也有加速迹象,资产价格上涨带来的财富效应也有所显现。二是行业景气度全面好转,上市公司利润同比增速十分显著,一季度增速高达 103%,上半年预计增速也明显超过年初预期,基本面超预期是支持市场走强的最重要理由。三是风格资产表现与 06 年比有一定的变化。上半年价值类股票的表现要明显好于成长股,资产注入类的外延式增长机会也得到了市场的更多关注。四是“5.30”调整洗涤了市场投资理念。在投资的寻宝游戏过程中,市场出现了过大的交易量及局部估值泡沫,并最终促发了一定的政策干预。市场由此在 5 月底走出一轮快速调整行情,蓝筹股表现出抗跌性。

(2) 操作回顾

安久基金上半年净值上涨 59.61%。上半年增持的行业主要有金融保险、交通运输、化工新材料等,减持的行业主要是食品饮料、采掘、IT 等。其中,金融保险、金属、化工、医药、机械、房地产等行业的投资收到了相对良好的效果。上半年操作中存在的问题主要是对价值类公司把握能力明显欠缺。

(3) 展望

权威部门对上半年宏观数据的解读,降低了市场关于短期内严厉的调控政策出台的担心。同时,未来几年上市公司业绩的较高增长能力,在一定程度上消化了市场的估值压力。但由于股价上涨速度持续快于业绩增速,同时证券化率水平已不低,未来指数上涨斜率可能会更为平缓,投资机会的寻找应更有耐心。我们将继续关注消费服务、先进制造、稀缺资源类企业的投资机会,同时在通胀上升背景下,更需重视企业的定价能力。此外,对于节能减排、奥运等投资主题,以及受益于产能调控及行业集中度提升的投资类企业的投资机会也将适当关注。

此外,安久基金正在进行“封转开”工作,即将转型为华安策略优选基金。在此,也特别感谢持有人多年来对我们工作的一贯支持。未来我们将继续秉承稳健的投资理念,努力为持有人在相对较长周期内创造稳定的投资回报。

五、 托管人报告

2007 年上半年，托管人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、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，华安基金管理有限公司在安久证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，由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半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、 财务会计报告（未经审计）

（一）、资产负债表

项 目	附注	单位：人民币元	
		2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		11,082,114.58	29,953,369.94
清算备付金		6,201,474.74	8,648,777.22
交易保证金		851,282.05	859,609.61
应收证券清算款		0.00	5,343,691.99
应收股利		0.00	0.00
应收利息	4(1)	5,117,210.27	1,032,999.96
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		1,142,717,612.05	766,462,377.29
其中：股票投资成本		676,571,773.33	382,062,738.96
债券投资市值		296,298,726.96	205,050,120.20
其中：债券投资成本		296,374,877.04	204,823,500.69
权证投资市值		15,963,200.00	27,336,816.00
其中：权证投资成本		11,810,263.22	18,450,135.02
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		135,569.30	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		1,478,367,189.95	1,044,687,762.21
负债：			
应付证券清算款		11,194,792.68	33,929,841.86
应付管理人报酬		1,779,545.97	1,170,742.54
应付托管费		296,590.96	195,123.74
应付佣金	4(3)	1,506,887.62	572,780.96

应付利息		0.00	0.00
其他应付款	4(4)	750,000.00	750,000.00
卖出回购证券款		0.00	0.00
预提费用	4(5)	253,562.71	130,000.00
负债合计		<u>15,781,379.94</u>	<u>36,748,489.10</u>

所有者权益：

实收基金		500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得		470,222,625.42	393,512,938.82
未分配收益		492,363,184.59	114,426,334.29
持有人权益合计		<u>1,462,585,810.01</u>	<u>1,007,939,273.11</u>
负债和所有者权益合计		<u>1,478,367,189.95</u>	<u>1,044,687,762.21</u>
基金份额净值		<u>2.9252</u>	<u>2.0159</u>

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	单位：人民币元	
		2007 年 1-6 月	2006 年 1-6 月
收入：			
股票差价收入	4(6)	484,846,820.68	115,798,679.55
债券差价收入	4(7)	95,793.48	-508,808.24
权证差价收入	4(8)	9,276,550.06	10,105,239.98
债券利息收入		3,445,027.49	1,485,417.61
存款利息收入		373,036.92	96,169.31
股利收入		2,901,210.05	5,417,185.86
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入	4(9)	0.00	0.00
收入合计		<u>500,938,438.68</u>	<u>132,393,884.07</u>
费用：			
基金管理人报酬	3(3)	9,066,693.77	4,031,517.99
基金托管费	3(3)	1,511,115.56	671,919.63
卖出回购证券支出		2,031,711.15	40,520.45
其他费用	4(10)	392,067.90	183,837.20
其中：上市年费		29,752.78	29,752.78
信息披露费		119,014.74	119,014.74
审计费用		24,795.19	24,795.19
费用合计		<u>13,001,588.38</u>	<u>4,927,795.27</u>
基金净收益		<u>487,936,850.30</u>	<u>127,466,088.80</u>
加：未实现估值增值变动数		76,709,686.60	141,355,372.75
基金经营业绩		<u>564,646,536.90</u>	<u>268,821,461.55</u>

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	单位：人民币元	
		2007 年 1-6 月	2006 年 1-6 月
本期基金净收益		487,936,850.30	127,466,088.80
加：期初未分配收益		114,426,334.29	-93,137,265.27
可供分配基金净收益		<u>602,363,184.59</u>	<u>34,328,823.53</u>
减：本期已分配基金净收益	4(11)	110,000,000.00	0.00
期末基金未分配净收益		<u>492,363,184.59</u>	<u>34,328,823.53</u>

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	单位：人民币元	
		2007 年 1-6 月	2006 年 1-6 月
一、期初基金净值		1,007,939,273.11	433,321,374.26
二、本期经营活动：			
基金净收益		487,936,850.30	127,466,088.80
未实现估值增值变动数		<u>76,709,686.60</u>	<u>141,355,372.75</u>
经营活动产生的基金净值变动数		564,646,536.90	268,821,461.55
三、本期向持有人分配收益	4(11)	110,000,000.00	0.00
四、期末基金净值		<u>1,462,585,810.01</u>	<u>702,142,835.81</u>

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于 2005 年 7 月 1 日起颁布的《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 3 号《半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. 会计政策：

除主要税项外，本半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。

主要税项的变更内容如下：

基金买卖股票按照 3% 的税率征收印花税。从 2007 年 5 月 30 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 3% 的税率缴纳证券（股票）交易印花税。

2. 本报告期重大会计差错：

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	基金管理人 基金发起人	提取管理费	基金合同
交通银行	基金托管人	提取托管费 银行间交易	基金合同 银行间成交单
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		

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。因此基金交易佣金比率是公允的。

(2). 通过关联方席位进行的交易

通过关联人席位的股票及权证成交量：

本基金通过关联人席位 2007 年 1-6 月的股票及权证交易情况：无。

本基金通过关联人席位 2006 年 1-6 月的股票及权证交易情况：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。

通过关联人席位的债券和回购成交量：

本基金通过关联人席位 2007 年 1-6 月的债券及回购交易情况：无。

本基金通过关联人席位 2006 年 1-6 月的债券及回购交易情况：无。

本基金与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：

本基金与关联人于 2007 年 1-6 月进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：无。

本基金与关联人于 2006 年 1-6 月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

基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费，按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提。本基金成立三个月后，若持有现金的比例超过本基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理费。计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值 (扣除本基金持有现金比例超过 20% 部分的基金资产净值)

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 9,066,693.77 元。(上年度的上半年: 4,031,517.99 元)

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:

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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 1,511,115.56 元。(上年度的上半年: 671,919.63 元)

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 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 11,082,114.58 元, 2006 年 6 月 30 日为 6,865,051.62 元。本基金 2007 年度 1-6 月由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 185,904.10 元, 2006 年度 1-6 月为 17,296.83 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 2007 年 6 月 30 日的相关余额 6,201,474.74 元计入“清算备付金”科目(2006 年 6 月 30 日: 43,471,336.54 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:

2007 年度 1-6 月基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	期初数		本期间增		本期间减		期末数		适用费率
	持有份额	持有比例	持份额	持份额	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	1.92%	0.00	0.00	9,582,100	1.92%	-	-	

2006 年度 1-6 月基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	期初数		本期间增		本期间减		期末数		适用费率
	持有份额	持有比例	持份额	持份额	持份额	持份额	持有份额	持有比例	
华安基金管理有 限公司	9,582,100	1.92%	0.00	0.00	9,582,100	1.92%	-		

2、基金管理公司主要股东及其控制的机构在 2006 年上半年末和 2007 年上半年末投资本基金的情况：无。

4. 基金会计报表重要项目的说明：

(1). 应收利息明细：

明细项目	2007 年 6 月 30 日
银行存款利息	23,516.34
清算备付金利息	5,343.29
权证保证金利息	41.04
债券利息	5,088,309.60
买入返售证券利息	0.00
合计	5,117,210.27

(2). 投资估值增值明细：

明细项目	2007 年 6 月 30 日
股票估值增值余额	466,145,838.72
债券估值增值余额	-76,150.08
权证估值增值余额	4,152,936.78
合计	470,222,625.42

(3). 应付佣金明细：

明细项目	2007 年 6 月 30 日
东方证券股份有限公司	240,888.28
申银万国证券股份有限公司	131,152.72
国泰君安证券股份有限公司	132,025.21
平安证券有限责任公司	592,222.44
光大证券股份有限公司	366,983.20
方正证券有限责任公司	3,639.44
联合证券有限责任公司	39,976.33
合计	1,506,887.62

(4). 其他应付款明细：

2007 年 6 月 30 日

券商垫付交易保证金	750,000.00
合计	750,000.00

(5). 预提费用明细：

明细项目	2007 年 6 月 30 日
预提信息披露费	199,014.74
预提审计费	24,795.19
预提上市年费	29,752.78
合计	253,562.71

(6). 卖出股票：

明细项目	2007 年 1-6 月
卖出股票成交总额	1,065,654,433.30
减：佣金	894,286.67
卖出股票成本总额	579,913,325.95
股票差价收入	484,846,820.68

(7). 卖出债券：

明细项目	2007 年 1-6 月
卖出债券成交总额	180,794,091.75
减：卖出债券成本总额	177,815,149.12
应收利息总额	2,883,149.15
债券差价收入	95,793.48

(8). 卖出权证：

明细项目	2007 年 1-6 月
卖出权证成交总额	28,647,117.01
减：卖出权证成本总额	19,370,566.95
权证差价收入	9,276,550.06

(9). 其他收入：

明细项目	2007 年 1-6 月
新股、配股手续费返还	0.00
合计	0.00

(10). 其他费用：

明细项目	2007 年 1-6 月
------	--------------

上市年费	29,752.78
信息披露费	119,014.74
审计费用	24,795.19
帐户维护费	10,700.00
分红手续费	191,130.70
交易所费用	11,062.79
银行间费用	5,611.70
合计	392,067.90

(11). 收益分配：

明细项目	2007 年 1-6 月
第 1 次收益分配金额	110,000,000.00
本期累计收益分配金额	110,000,000.00

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：

无。

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券情况如下：

无。

七、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	1,142,717,612.05	77.30%
2	债券	296,298,726.96	20.04%
3	权证	15,963,200.00	1.08%
4	银行存款和清算备付金	17,283,589.32	1.17%
5	其它资产	6,104,061.62	0.41%
	合计	1,478,367,189.95	100.00%

(二)、股票投资组合

	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
C	制造业	529,718,181.92	36.22%
C0	食品、饮料	42,068,392.58	2.88%

C4	石油、化学、塑胶、塑料	133,807,798.29	9.15%
C5	电子	1,692,928.80	0.12%
C6	金属、非金属	122,846,631.00	8.40%
C7	机械、设备、仪表	115,834,612.94	7.92%
C8	医药、生物制品	113,467,818.31	7.76%
F	交通运输、仓储业	99,449,426.48	6.80%
H	批发和零售贸易	68,749,735.32	4.70%
I	金融、保险业	269,064,842.97	18.40%
J	房地产业	106,019,317.63	7.25%
K	社会服务业	20,761,472.00	1.42%
M	综合类	48,954,635.73	3.35%
	合计	1,142,717,612.05	78.13%

(三)、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	5,088,792	124,929,843.60	8.54%
2	600309	烟台万华	1,809,657	94,988,895.93	6.49%
3	601318	中国平安	1,277,219	91,870,362.67	6.28%
4	600276	恒瑞医药	1,925,517	87,283,685.61	5.97%
5	000951	中国重汽	1,635,949	82,451,829.60	5.64%
6	600009	上海机场	1,922,152	73,406,984.88	5.02%
7	600219	南山铝业	3,025,900	69,868,031.00	4.78%
8	000002	万科A	3,308,080	63,151,247.20	4.32%
9	002024	苏宁电器	1,130,400	52,540,992.00	3.59%
10	000039	中集集团	1,680,000	49,509,600.00	3.39%
11	600858	银座股份	1,630,191	48,954,635.73	3.35%
12	601628	中国人寿	1,074,710	44,890,636.70	3.07%
13	600519	贵州茅台	350,074	42,068,392.58	2.88%
14	000792	盐湖钾肥	863,794	38,818,902.36	2.65%
15	000024	招商地产	740,861	36,028,070.43	2.46%
16	002007	华兰生物	623,135	26,184,132.70	1.79%
17	000069	华侨城A	531,800	20,761,472.00	1.42%
18	600786	东方锅炉	310,000	19,471,100.00	1.33%
19	600026	中海发展	730,000	16,921,400.00	1.16%
20	000061	农产品	751,797	16,208,743.32	1.11%
21	601006	大秦铁路	599,280	9,121,041.60	0.62%
22	600000	浦发银行	200,000	7,374,000.00	0.50%
23	600383	金地集团	200,000	6,840,000.00	0.47%
24	600150	沪东重机	50,000	6,813,500.00	0.47%
25	600686	金龙汽车	191,428	4,751,242.96	0.32%
26	000878	云南铜业	100,000	3,469,000.00	0.24%

27	000338	潍柴动力	28,758	2,346,940.38	0.16%
28	600261	浙江阳光	102,230	1,692,928.80	0.12%

(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	占期初基金资产净值的比例
1	000951	中国重汽	84,101,022.48	8.34%
2	601318	中国平安	78,323,811.01	7.77%
3	600036	招商银行	74,442,553.34	7.39%
4	600219	南山铝业	62,101,070.25	6.16%
5	601628	中国人寿	38,989,946.08	3.87%
6	000024	招商地产	38,097,519.41	3.78%
7	600309	烟台万华	33,786,882.70	3.35%
8	600030	中信证券	31,894,742.36	3.16%
9	600009	上海机场	31,484,852.10	3.12%
10	600739	辽宁成大	30,228,660.41	3.00%
11	000002	万科A	27,349,636.41	2.71%
12	000623	吉林敖东	26,348,733.02	2.61%
13	000039	中集集团	24,452,682.36	2.43%
14	600019	宝钢股份	24,220,875.42	2.40%
15	000061	农产品	21,246,362.42	2.11%
16	000069	华侨城A	20,126,472.07	2.00%
17	600428	中远航运	18,514,422.89	1.84%
18	600858	银座股份	18,319,124.01	1.82%
19	600519	贵州茅台	16,066,801.80	1.59%
20	000792	盐湖钾肥	13,132,123.16	1.30%

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	600030	中信证券	120,430,631.65	11.95%
2	600739	辽宁成大	76,516,471.83	7.59%
3	000825	太钢不锈	75,870,934.56	7.53%
4	600761	安徽合力	69,157,352.97	6.86%
5	600036	招商银行	68,760,061.15	6.82%
6	600519	贵州茅台	53,047,391.43	5.26%
7	000951	中国重汽	41,883,268.92	4.16%

8	600271	航天信息	36,166,842.93	3.59%
9	000402	金融街	35,987,566.94	3.57%
10	000623	吉林敖东	34,394,512.59	3.41%
11	600583	海油工程	34,050,931.11	3.38%
12	600456	宝钛股份	30,715,352.40	3.05%
13	000024	招商地产	30,448,945.56	3.02%
14	000869	张裕 A	28,841,455.87	2.86%
15	600028	中国石化	26,119,889.11	2.59%
16	600309	烟台万华	26,026,401.37	2.58%
17	600019	宝钢股份	24,613,827.15	2.44%
18	600308	华泰股份	21,783,766.62	2.16%
19	600428	中远航运	19,767,255.63	1.96%
20	000157	中联重科	19,089,618.29	1.89%

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：	874,422,360.32
卖出股票的收入总额：	1,065,654,433.30

(五)、债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国债投资	187,002,960.80	12.79%
2	金融债	80,082,360.00	5.48%
3	央票债券	29,213,406.16	2.00%
	合计	296,298,726.96	20.26%

2、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	926,000	93,072,260.00	6.36%
2	010214	02 国债	562,600	56,406,276.00	3.86%
3	010010	20 国债	330,000	33,174,900.00	2.27%
4	0601051	06 央票 51	300,000	29,213,406.16	2.00%
5	050415	05 农发 15	200,000	19,990,000.00	1.37%

(六)、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(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	031001	侨城 HQC1	550,000	15,963,200.00	1.09%

(七)、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。

(八)、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。

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	深交所交易保证金	750,000.00
2	权证交易保证金	101,282.05
3	应收利息	5,117,210.27
4	待摊费用	135,569.30
	合计	6,104,061.62

4、处于转股期的可转换债券明细

本报告期末处于转股期的可转换债券情况：无。

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(张)	成本总额(元)	获得途径
1	580005	万华 HXB1	92,000	2,904,880.23	二级市场买入
2	031001	侨城 HQC1	795,000	15,280,845.41	二级市场买入

八、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	平均每户持有基金份额
9,508	52,587.29

持有人类型	份额(份)	占总份额的比例
机构投资者持有的基金份额	363,565,593	72.71%
个人投资者持有的基金份额	136,434,407	27.29%

截止 2007 年 6 月 30 日，前十名持有人名称、持有份额及占总份额的比例

如下:

序号	持有人名称	份额(份)	占总份额的比例
1	中国人寿保险股份有限公司	41,554,414	8.31%
2	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	35,125,492	7.03%
3	中国人寿保险(集团)公司	33,045,894	6.61%
4	招商证券-招行-招商证券基金宝集合资产管理计划	31,320,294	6.26%
5	新华人寿保险股份有限公司	25,098,135	5.02%
6	生命人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	22,490,121	4.50%
7	国泰君安-花旗-DEUTSCHE BANK AKTIENGESELLSCHAFT	15,162,551	3.03%
8	宝钢集团有限公司	13,927,901	2.79%
9	泰康人寿保险股份有限公司	13,854,618	2.77%
10	申银万国-渣打-BARCLAYS BANK PLC	11,499,439	2.30%

注:上述有关持有人数据是根据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司传送的截止 2007 年 6 月 30 日基金安久全部持有人名册汇总统计而来。

九、 重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议:

本基金管理人于 2007 年 5 月 29 日,发布安久证券投资基金召开基金份额持有人大会公告,提请审议《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》。

本基金管理人于 2007 年 6 月 30 日,发布关于安久证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告,《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》获全票通过。

本基金管理人于 2007 年 7 月 25 日,发布关于安久证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告,中国证券监督管理委员会于 2007 年 7 月 23 日下发了《关于核准安久证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]210 号),同意安久证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。

本基金管理人于 2007 年 7 月 27 日,发布安久证券投资基金终止上市公告,本基金于 2007 年 8 月 2 日终止上市,自基金安久终止上市之日起,基金名称变更为华安策略优选股票型证券投资基金,《安久证券投资基金基金合同》修订为《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》,基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》为准。

本基金管理人于 2007 年 8 月 10 日,发布《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》、《华安策略优选股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》、《华安策略优选股票型证券投资基金份额“确权”登记指引》

(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:

本基金管理人于 2007 年 3 月 22 日发布关于董事变更的公告:关于董事变更

的公告,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。

本基金管理人于 2007 年 5 月 11 日发布关于变更公司董事长的公告:关于高管人员变动的公告,经华安基金管理有限公司董事会审议通过,同意姚毓林先生由于个人原因辞去华安基金管理有限公司副总经理职务。

本基金管理人于 2007 年 7 月 26 日发布公告:关于聘任总经理、副总经理的公告,经华安基金管理有限公司第三届董事会审议通过,决定聘请俞妙根先生担任公司总经理职务,聘请韩勇先生担任副总经理职务。

(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:

	权益登记日	除息日 红利发放日	每10份基金份额收 益分配金额
本年度第1次分红	2007-4-5	2007-4-6	2.20 元
本年度第2次分红	2007-7-30	2007-7-31	9.00 元

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

本基金管理人于 2007 年 6 月 5 日,发布关于更换旗下部分基金会计师事务所的公告,本基金的会计师事务所由立信会计师事务所有限公司(原上海立信长江会计师事务所有限公司)更换为普华永道中天会计师事务所有限公司。上述事项已经基金托管人交通银行股份有限公司同意,并报中国证监会备案。

(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)、本报告期间租用证券公司席位情况如下:

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
-	-	-

退租席位:

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
-	-	-

2. 交易成交量及佣金情况:

(1). 股票交易情况:

券商名称	租用席位数量	成交量	占总成交量比例	佣金	占总佣金比例
东方证券股份有限公司	2	112,529,541.65	5.87%	88,054.74	5.73%
光大证券股份有限公司	1	468,985,870.69	24.48%	366,983.20	23.90%
国泰君安证券股份有限公司	1	163,066,155.07	8.51%	132,025.21	8.60%
平安证券有限责任公司	1	956,975,397.10	49.96%	777,598.86	50.63%
申银万国证券股份有限公司	1	162,964,642.80	8.51%	131,152.72	8.54%
联合证券有限责任公司	1	51,087,849.47	2.67%	39,976.33	2.60%
合计		1,915,609,456.78	100.00%	1,535,791.06	100.00%

(2). 债券及回购交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交量比例	回购成交量	占总成交量比例	权证成交量	占总成交量比例
东方证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	3,470,235.14	7.41%
光大证券股份有限公司	8,822,441.10	3.19%	0.00	0.00%	35,040,497.80	74.82%
国泰君安证券股份有限公司	10,732,487.40	3.88%	316,000,000.00	14.23%	391,083.40	0.84%
平安证券有限责任公司	206,220,519.60	74.56%	1,480,600,000.00	66.68%	4,393,073.58	9.38%
申银万国证券股份有限公司	50,790,718.10	18.36%	423,800,000.00	19.09%	3,538,942.75	7.56%
合计	276,566,166.20	100.00%	2,220,400,000.00	100.00%	46,833,832.67	100.00%

(九)、其他重大事项：

- | 公告事项 | 披露日期 |
|--|------------|
| 1) 关于总机变更的公告，华安基金管理有限公司的电话总机自 2007 年 5 月 28 日起由(021)58881111 变更为(021)38969999。 | 2007-05-25 |
| 2) 关于证券投资基金实施新的会计准则的公告，根据中国证监会的相关规定，我公司管理的所有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后，基金将全面采用公允价值进行会计计量，请投资者关注相关法规的规定。实施新会计准则后，基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。 | 2007-07-02 |
| 3) 华安策略优选股票型证券投资基金提前结束集中申购的公告，华安策略优选股票型证券投资基金于 2007 年 8 月 15 日起向全社会进行集中申购，原定集中申购截止日为 2007 年 8 月 28 日。鉴于广大投资者申购踊跃，根据初步统计，截至 2007 年 8 月 15 日，本基金累计申购申请金额（不包括利息）已超过本次集中申购发售规模的上限 100 亿元。为保护基金份额持有人的利益，适度控制基金规模，本基金管理人决定提前结束本基金的集中申购，自 2007 年 8 月 16 日起不再接受申购申请。 | 2007-08-16 |
| 4) 华安策略优选股票型证券投资基金集中申购期末日申购确认比例公告，经本基金管理人统计，本基金有效申购申请金额为人民币 76,821,405,912.01 元（不包括利息），已超过《华安策略优 | 2007-08-17 |



选股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告》(以下简称“《发售公告》”)规定的 100 亿元(不包括利息)规模上限。根据《发售公告》,本基金管理人对于最后一个集中申购日,即 2007 年 8 月 15 日的有效申购申请采用“末日比例确认”的原则予以确认,确认比例为 13.0172051%(保留到小数点后七位)。

- 5) 关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告,本基金管理人按照 1:2.536335136 的折算比例将原基金安久的基金份额进行了折算。折算后,基金份额净值转换为 1.0000 元,原基金安久的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,268,167,568.49 份。 2007-08-21
- 6) 华安策略优选股票型证券投资基金集中申购结果的公告,经普华永道中天会计师事务所验资,本次华安策略优选股票型证券投资基金集中申购的有效申购申请金额为 76,821,405,912.01 元人民币(不包括利息)华安策略优选股票型证券投资基金基金总份额由 500,000,000 份变更为 11,125,983,587.65 份。 2007-08-21

上述作为临时公告披露的重大事项均刊登于《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》或基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn> 上。

十、 备查文件目录

- 1、《安久证券投资基金基金合同》
- 2、《安久证券投资基金扩募说明书》
- 3、《安久证券投资基金托管协议》
- 4、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。
- 5、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 8 月 28 日