



华安策略优选股票型证券投资基金 (原安久证券投资基金转型) 2007 年年度报告

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：二〇〇八年三月二十七日



目 录

| | | |
|----|------------------------------|----|
| 一、 | 重要提示..... | 4 |
| 二、 | 基金产品概况..... | 4 |
| | (一) 基金概况..... | 4 |
| | (二) 基金的投资..... | 5 |
| | (三) 基金管理人..... | 6 |
| | (四) 基金托管人..... | 6 |
| | (五) 信息披露..... | 7 |
| | (六) 其他有关资料..... | 7 |
| 三、 | 主要财务指标和基金净值表现..... | 7 |
| | (一) 主要财务指标..... | 7 |
| | (二) 华安策略优选股票型证券投资基金净值表现..... | 8 |
| | (三) 原安久证券投资基金净值表现..... | 9 |
| | (四) 基金收益分配情况..... | 10 |
| 四、 | 管理人报告..... | 11 |
| | (一) 基金管理人以及基金经理简介..... | 11 |
| | (二) 基金运作合规性声明..... | 11 |
| | (三) 基金经理工作报告..... | 11 |
| | (四) 内部监察报告..... | 12 |
| 五、 | 托管人报告..... | 13 |
| 六、 | 审计报告..... | 13 |
| 七、 | 华安优选基金财务会计报告..... | 16 |
| | (一) 资产负债表..... | 16 |
| | (二) 利润表..... | 17 |
| | (三) 所有者权益变动表..... | 17 |
| | (四) 会计报表附注..... | 18 |
| 八、 | 基金安久财务会计报告..... | 33 |
| | (一) 资产负债表..... | 33 |
| | (二) 利润表..... | 34 |
| | (三) 所有者权益变动表..... | 35 |
| | (四) 会计报表附注..... | 35 |
| 九、 | 华安策略优选股票型证券投资基金投资组合报告..... | 52 |
| | (一) 基金资产组合..... | 52 |
| | (二) 股票投资组合..... | 52 |
| | (三) 基金投资股票明细..... | 53 |
| | (四) 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 56 |
| | (五) 债券投资组合..... | 57 |
| | (六) 基金投资前五名债券明细..... | 57 |
| | (七) 权证投资组合..... | 57 |
| | (八) 资产支持证券投资组合..... | 57 |
| | (九) 投资组合报告附注..... | 57 |
| 十、 | 原安久证券投资基金投资组合报告..... | 58 |
| | (一) 基金资产组合..... | 58 |



| | |
|---------------------------|----|
| (二) 股票投资组合..... | 58 |
| (三) 基金投资股票明细 | 59 |
| (四) 报告期内股票投资组合的重大变动 | 60 |
| (五) 债券投资组合..... | 61 |
| (六) 基金投资前五名债券明细..... | 61 |
| (七) 权证投资组合..... | 61 |
| (八) 资产支持证券投资组合 | 61 |
| (九) 投资组合报告附注 | 61 |
| 十一、 基金份额持有人户数和持有人结构 | 62 |
| (一) 华安策略优选股票型证券投资基金 | 62 |
| (二) 原安久证券投资基金..... | 62 |
| 十二、 开放式基金份额变动..... | 63 |
| 十三、 重大事件..... | 63 |
| 十四、 备查文件目录..... | 71 |



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 2008 年 3 月 26 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。

2007 年 6 月 29 日,华安策略优选股票型证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过,并于 2007 年 7 月 23 日获中国证监会《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)核准。自 2007 年 8 月 2 日起,安久证券投资基金在深圳证券交易所终止上市,由《安久证券投资基金基金合同》修订而成的《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》生效。

本报告会计期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 12 月 31 日止。自 2007 年 8 月 2 日安久证券投资基金终止上市之日起,原安久证券投资基金基金名称变更为华安策略优选股票型证券投资基金。原安久证券投资基金报告期自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日止,华安策略优选股票型证券投资基金报告期自 2007 年 8 月 2 日起至 12 月 31 日止。

二、 基金产品概况

(一) 基金概况

1. 华安策略优选股票型证券投资基金

| | |
|-----------|---------------------|
| 基金名称: | 华安策略优选股票型证券投资基金 |
| 基金简称: | 华安优选 |
| 交易代码: | 040008 |
| 深交所行情代码: | 160408 |
| 基金运作方式: | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2007 年 8 月 2 日 |
| 期末基金份额总额: | 22,282,586,312.15 份 |
| 基金存续期: | 不定期 |



2. 原安久证券投资基金

| | |
|-----------|--|
| 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 |
| 期末基金份额总额: | 5 亿份 |
| 基金存续期: | 15 年(自 1992 年 8 月 31 日至 2007 年 8 月 1 日) |
| 基金上市地点: | 深圳证券交易所 |
| 基金上市日期: | 2001 年 8 月 31 日 |

(二) 基金的投资

1. 华安策略优选股票型证券投资基金

| | |
|---------|--|
| 投资目标: | 以优选股票为主,配合多种投资策略,在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益,实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略: | <p>① 资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,并利用公司研究开发的数量模型工具,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。</p> <p>② 股票投资策略</p> <p>本基金的股票投资策略将采用“自下而上”和“自上而下”相结合的方法,通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票。在构建投资组合时主要以“自下而上”的优选成长策略为主,辅以“自上而下”的主题优选策略、逆势操作策略,优选具有良好投资潜力的个股,力求基金资产的中长期稳定增值。</p> <p>③ 债券投资策略</p> <p>本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。</p> <p>④ 权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略</p> |
| 业绩比较基准: | $80\% \times \text{中信标普 300 指数收益率} + 20\% \times \text{中信标普国债指数收益率}$ |



风险收益特征： 本基金是股票型基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

2. 原安久证券投资基金

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

（三） 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： 俞妙根
 总经理： 俞妙根
 信息披露负责人： 冯颖
 联系电话： 021-38969999
 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： 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

(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

1. 华安策略优选股票型证券投资基金

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

2. 原安久证券投资基金

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：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

(一) 主要财务指标

单位：人民币元

| 序号 | 财务指标 | 转型后 (2007 年 8 月 2 日) | | 2006 年度 | 2005 年度 |
|----|----------------------|----------------------|--------------------|------------------|----------------|
| | | 2007 年 12 月 31 日止期间) | 2007 年 8 月 1 日止期间) | | |
| 1 | 本期利润 | 675,788,257.18 | 681,442,201.65 | 574,617,898.85 | -1,901,593.89 |
| 2 | 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 97,506,591.08 | 586,282,962.30 | 207,563,599.56 | -46,249,351.90 |
| 3 | 加权平均份额本期利润 | 0.0373 | 1.3629 | 1.1492 | -0.0038 |
| 4 | 期末可供分配利润 | 2,845,858,569.84 | 140,709,296.59 | 114,426,334.29 | -93,137,265.27 |
| 5 | 期末可供分配份额利润 | 0.1277 | 0.2814 | 0.2289 | -0.1863 |
| 6 | 期末基金资产净值 | 23,378,518,955.74 | 1,129,381,474.76 | 1,007,939,273.11 | 433,321,374.26 |
| 7 | 期末基金份额净值 | 1.0492 | 2.2588 | 2.0159 | 0.8666 |



| | | | | | |
|----|-----------|--------|---------|---------|---------|
| 8 | 加权平均净值利润率 | 3.56% | 54.10% | 88.34% | -0.45% |
| 9 | 本期份额净值增长率 | 17.81% | 71.86% | 132.62% | -0.44% |
| 10 | 份额累计净值增长率 | 17.81% | 222.11% | 87.43% | -19.43% |

提示：1、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、2007 年 7 月 1 日基金实施新会计准则后，原“基金本期净收益”名称调整为“本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额”，原“加权平均基金份额本期净收益”=第 2 项/(第 1 项/第 3 项)。

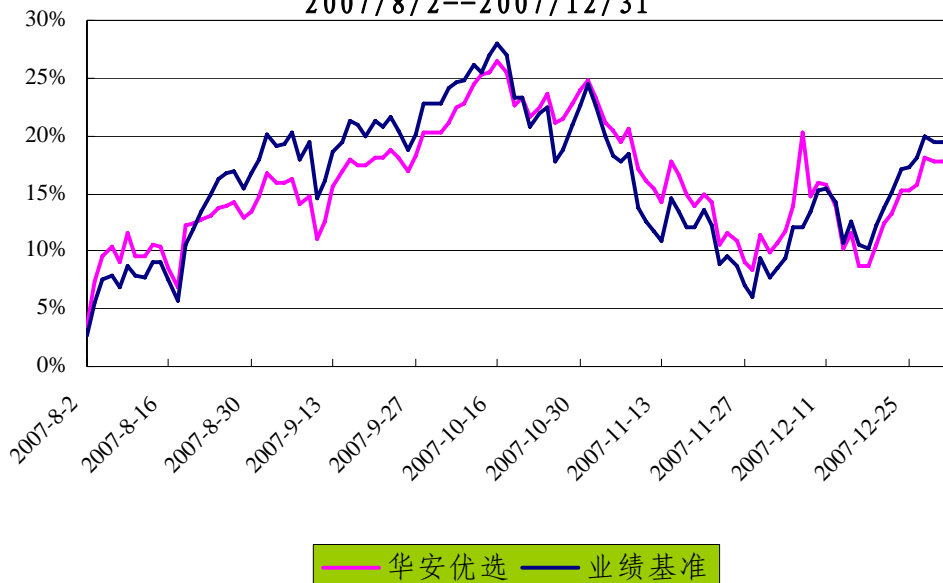
(二) 华安策略优选股票型证券投资基金净值表现

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

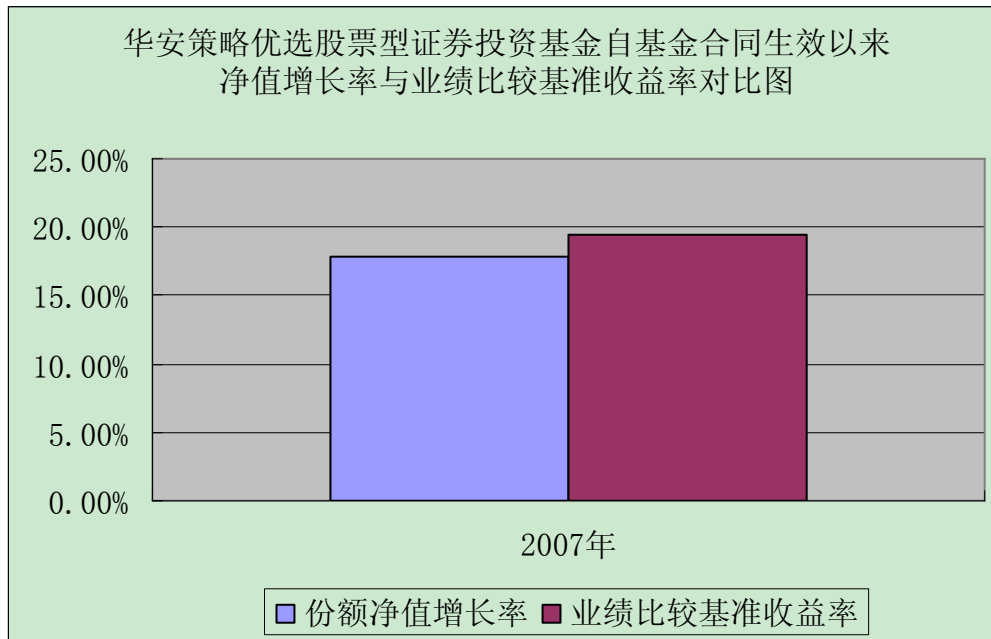
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------------------------|------------|---------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 自基金合同 生效起至今 | -1.99% | 1.67% | -2.80% | 1.53% | 0.81% | 0.14% |
| | 17.81% | 1.47% | 19.42% | 1.52% | -1.61% | -0.05% |

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

华安策略优选股票型证券投资基金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
2007/8/2--2007/12/31



C、图示自基金合同生效以来每年的净值增长率



(三) 原安久证券投资基金净值表现

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

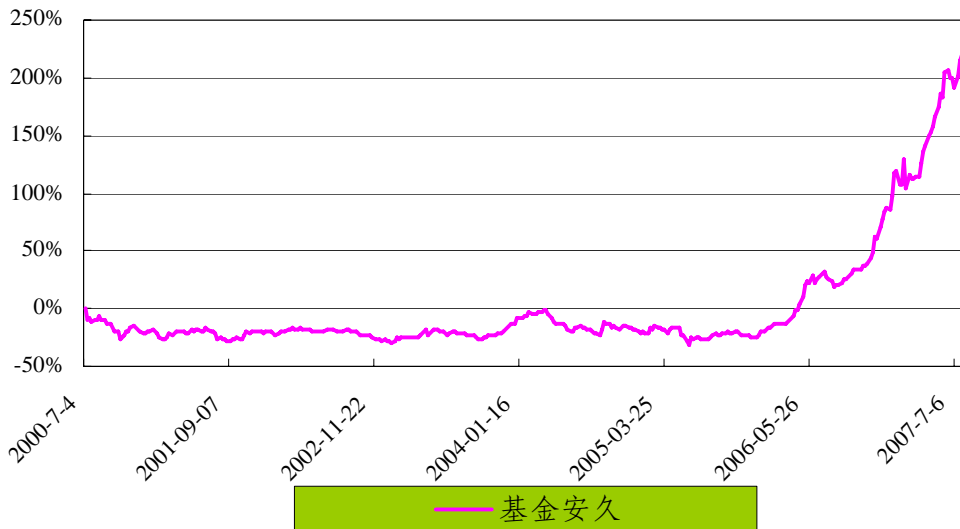
| 阶段 | 净值 增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-------------------------|----------------|---------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|
| 2007年7月1日至 2007年8月1日 | 7.67% | 2.75% | - | - | - | - |
| 2007年1月1日至 2007年8月1日 | 71.86% | 4.17% | - | - | - | - |
| 2005年1月1日至 2007年8月1日 | 298.03% | 3.23% | - | - | - | - |
| 2003年1月1日至 2007年8月1日 | 346.28% | 2.88% | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起 至2007年8月1日 | 222.11% | 2.70% | - | - | - | - |

备注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

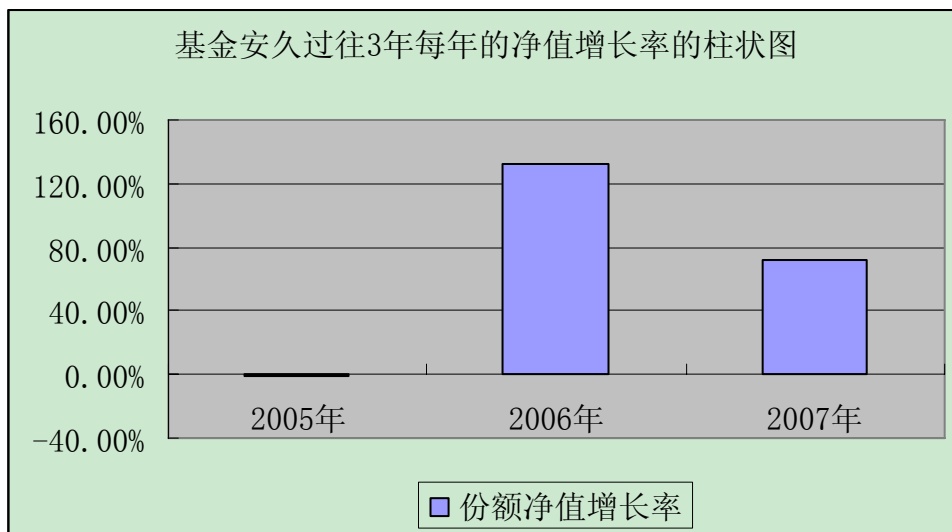
B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现



原安久证券投资基金基金份额累计净值增长率历史走势图
2000/7/4--2007/8/1



C、图示基金过往三年每年的净值增长率



(四) 基金收益分配情况

| | | 单位：元 |
|--------|---------------------------------------|---------------|
| | | 每 10 份基金份额分红数 |
| 2007 年 | 转型后(2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日) | 0.00 |
| | 转型前(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日) | 11.20 |
| | 2006 年 | 0.00 |
| | 2005 年 | 0.00 |
| | 合计 | 11.20 |



四、 管理人报告

(一) 基金管理人以及基金经理简介

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、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至 2007 年 12 月 31 日,公司旗下共管理了基金安信、基金安顺 2 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、上证 180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安国际配置(QDII)等 9 只开放式基金,管理资产规模达到 1074 亿人民币、1.31 亿美元。

张伟先生,硕士,持有基金从业资格证书,7 年证券、基金行业从业经历。曾在平安证券有限公司、天同证券有限公司任职,2004 年 6 月加入华安基金管理公司,曾任研究发展部高级研究员,2008 年 2 月至今担任华安策略优选股票型基金的基金经理。

邓跃辉先生,硕士,持有基金从业资格证书,4 年基金行业从业经历。2003 年 4 月加入华安基金管理公司,曾任研究发展部高级研究员,2008 年 2 月至今担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理。

(二) 基金运作合规性声明

本报告期间,本基金管理人严格遵守有关法律法规及基金合同、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

(1)、行情回顾

2007 年,市场继续着波澜壮阔的牛市行情,沪深 300 指数全年上涨了 161.55%。人民币升值、国民经济高速增长、流动性过剩、储蓄大搬家等诸多有利因素直接推动了指数的大幅上涨。市场上半年围绕资产重组,下半年围绕人民币升值受益、矿产资源等投资主题依次展开。本基金自 2007 年 8 月 2 日开始运作,全年净值上涨 17.81%,建仓初期基金仓位轻而市场表现好,而进入四季度,A 股市场基本处于调整当中,这导致本基金全年业绩表现相对不甚理想。

(2)、操作回顾

本基金运作初期,A 股处于较高点位,三季度基金股票投资比例未提至高位,而四季度的下跌为本基金提高仓位创造了有利条件。四季度单季本基金仓位提升



了 27.44%，期末仓位达到了 76.83% 的水平，建仓的对象更多选择了人民币升值受益的金融地产板块，当然也选择海运、工程机械、医药、家电等一些景气行业的龙头公司进行建仓，考虑到本基金规模偏大的因素，选择对象多为大市值股票，应该说在风格选择的考量上本基金是应该反思的。

(3)、展望

过去两年中，A 股市场累计升幅达到 400%，其强劲表现为全球所瞩目。其中，企业盈利成长与股改的制度变革红利贡献了大约一半的涨幅，流动性溢价与市场乐观预期带来的 PE 提升，则提供了另外的收益。

2008 年宏观经济面临减速运行和通货膨胀压力。发达国家经济增速放缓和人民币加速升值将导致中国出口速度降低，受节能减排和资源瓶颈约束投资也会相对平稳，而随着要素价格的上升，消费增长在 2008 年的经济中则相对乐观。综上，中国经济将逐步结束高增长与低通胀并存期，而天气灾害及紧缩的货币政策将进一步降低上市公司的业绩增速，这些因素均对证券市场有一定的不利影响。

至于资金方面，高企的估值直接引发了上市公司巨大的再融资热情，而顺差的快速减少和大小非的解禁冲动一定程度上扭转了市场资金的供求现状，市场估值水平不排除有进一步下探的可能。

台湾“选举”和北京奥运会将是 2008 年的两个重大事件，我们认为在奥运会前中国保持经济稳定和社会稳定仍然是主基调。同时，股指期货和创业板的推出也是将为市场提供一定的主题投资机会，但具体时间仍有一定的不确定性。

经过两年多的大幅上涨，A 股市场已摆脱了低估状态。同时在全流通与双 Q 背景下，市场效率提升和泡沫消化速度也快于预期。经过前期的调整，我们认为目前市场估值水平逐步趋向合理，但内、外部经济环境的不确定性将使 2008 年的 A 股投资充满波折，机会更多表现为结构性层面的演绎。

中国经济的伟大复兴仍在持续，实体经济中的世界级工业品与消费品企业的长期成长潜力不能低估，消费服务与自主创新是长期主题。08 年的选股还需更多强调自下而上，比如受益于节能减排政策的水泥、造纸及相关设备制造行业，受益于通货膨胀及美元贬值的资源、农产品及新能源行业，受益于资产整合的大集团、小市值的上市公司等，这些都应是我们优中选优的对象。

(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，强化员工的合规意识，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) 积极配合公司管理层推行“主动合规”的管理理念，在制定了“合规政策”的同时，监察稽核部门经常性地组织员工进行法律法规的学习、培训，来强化员工的合规意识；

(2) 根据中国证监会颁布的《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》的精神，组织投资公司投资、研究、交易人员签署了遵守投资管理人员职业道德、坚持基金份额持有人利益优先的“承诺书”；

(3) 按照证监会基金部《关于加强基金结算风险控制有关问题的通知》的要求，组织公司相关部门进行结算风险自查；

(4) 进一步完善投资交易系统控制功能，防范合规风险，提高合规监察效率；

(5) 除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察外，还有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

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，保障基金份额持有人的合法权益。

五、 托管人报告

2007 年，托管人在本基金的托管过程中，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，华安基金管理有限公司在本基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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，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本基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、 审计报告

普华永道中天审字(2008)第 20248 号

华安策略优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安策略优选股票型证券投资基金(以下简称“华安策略优选基金”)的财务报表，包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表、2007 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。



一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华安策略优选基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华安策略优选基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师
薛 竞

中国·上海市

注册会计师
金 毅
2008 年 3 月 27 日

普华永道中天审字(2008)第 20247 号

安久证券投资基金全体基金份额持有人：



我们审计了后附的安久证券投资基金(以下简称“基金安久”)的财务报表,包括 2007 年 8 月 1 日的资产负债表、2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日(基金合同失效前日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《安久证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是基金安久的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;
- (2) 选择和运用恰当的会计政策;
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,我们考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。

我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为,上述财务报表已经按照企业会计准则、《安久证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制,在所有重大方面公允反映了基金安久 2007 年 8 月 1 日的财务状况以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师
薛 竞

中国·上海市

注册会计师
金 毅
2008 年 3 月 25 日



七、 华安优选基金财务会计报告

(一) 资产负债表

二零零七年十二月三十一日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注 | 2007年12月31日 |
|------------|------|--------------------------|
| 资产 | | |
| 银行存款 | | 1,265,538,985.34 |
| 结算备付金 | | 3,366,988,561.88 |
| 存出保证金 | | 6,344,785.63 |
| 交易性金融资产 | 8(1) | 18,898,844,479.33 |
| 其中：股票投资 | | 17,961,613,055.33 |
| 债券投资 | | 937,231,424.00 |
| 衍生金融资产 | 8(2) | 578,286.63 |
| 应收证券清算款 | | 26,173,981.95 |
| 应收利息 | 8(3) | 12,158,911.76 |
| 应收申购款 | | 349,017.67 |
| 资产总计 | | <u>23,576,977,010.19</u> |
| 负债和所有者权益 | | |
| 负债 | | |
| 应付证券清算款 | | 62,284,387.53 |
| 应付赎回款 | | 85,570,301.26 |
| 应付管理人报酬 | | 28,953,381.39 |
| 应付托管费 | | 4,825,563.57 |
| 应付交易费用 | 8(4) | 15,126,985.23 |
| 其他负债 | 8(5) | 1,697,435.47 |
| 负债合计 | | <u>198,458,054.45</u> |
| 所有者权益 | | |
| 实收基金 | 8(6) | 8,785,356,163.71 |
| 未分配利润 | | 14,593,162,792.03 |
| 所有者权益合计 | | <u>23,378,518,955.74</u> |
| 负债和所有者权益总计 | | <u>23,576,977,010.19</u> |
| 基金份额总额(份) | | 22,282,586,312.15 |
| 基金份额净值 | | <u>1.0492</u> |

所附附注为本会计报表的组成部分



(二) 利润表

自二零零七年八月二日(基金合同生效日)至二零零七年十二月三十一日止期间
单位: 人民币元

| 项 目 | 附注 | 2007年8月2日(基金合同生效日) 至2007年12月31日止期间 |
|----------------|-------|---------------------------------------|
| 收入 | | |
| 利息收入 | | 33,642,057.77 |
| 其中: 存款利息收入 | | 26,152,488.72 |
| 债券利息收入 | | 7,462,293.35 |
| 买入返售金融资产收入 | | 27,275.70 |
| 投资收益 | | 293,988,143.10 |
| 其中: 股票投资收益 | 8(7) | 284,383,188.65 |
| 债券投资收益 | 8(8) | 868,060.00 |
| 衍生工具收益 | 8(9) | 7,200,755.97 |
| 股利收益 | | 1,536,138.48 |
| 公允价值变动收益 | 8(10) | 578,281,666.10 |
| 其他收入 | 8(11) | 3,187,347.88 |
| 收入合计 | | <u>909,099,214.85</u> |
| 费用 | | |
| 管理人报酬 | 7(3) | 119,030,238.20 |
| 托管费 | 7(3) | 19,838,373.04 |
| 交易费用 | 8(12) | 86,029,763.58 |
| 利息支出 | | 8,205,994.06 |
| 其中: 卖出回购金融资产支出 | | 8,205,994.06 |
| 其他费用 | 8(13) | 206,588.79 |
| 费用合计 | | <u>233,310,957.67</u> |
| 利润总额 | | <u><u>675,788,257.18</u></u> |

所附附注为本会计报表的组成部分

(三) 所有者权益变动表

自二零零七年八月二日(基金合同生效日)至二零零七年十二月三十一日止期间
单位: 人民币元

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|-------------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 500,000,000.00 | 629,381,474.76 | 1,129,381,474.76 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期净利润) | 0.00 | 675,788,257.18 | 675,788,257.18 |



| | | | |
|--------------------------------|------------------|-------------------|-------------------|
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（减少以“-”填列） | 8,285,356,163.71 | 13,287,993,060.09 | 21,573,349,223.80 |
| 其中：1. 基金申购款 | 9,241,322,110.30 | 14,881,950,451.85 | 24,123,272,562.15 |
| 2. 基金赎回款 | 955,965,946.59 | 1,593,957,391.76 | 2,549,923,338.35 |
| 四、本期向基金持有人分配利润产生的基金净值变动数 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 8,785,356,163.71 | 14,593,162,792.03 | 23,378,518,955.74 |

所附附注为本会计报表的组成部分

（四） 会计报表附注

1. 基金的基本情况

华安策略优选股票型证券投资基金是根据原安久证券投资基金（以下简称“基金安久”）基金份额持有人大会 2007 年 6 月 29 日审议通过的《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2007]210 号《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》核准，由原基金安久转型而来。原基金安久为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限至 2007 年 8 月 30 日止。根据中国证监会批复及深交所深证复[2007]41 号《关于同意安久证券投资基金终止上市的批复》，原基金安久于 2007 年 8 月 1 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 8 月 2 日起，原基金安久终止上市，原基金安久更名为华安策略优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），《安久证券投资基金基金合同》失效的同时《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金安久于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,129,381,474.76 元，已于本基金的合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金于 2007 年 8 月 20 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 2.536335136，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 8 月 15 日开放集中申购，共募集 9,853,567,332.90 元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计 318,719.94 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 111 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 8 月 20 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,853,567,332.90 份基金份额，其中集中申购资金利息折合 318,719.94 份基金份额，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。



其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%；债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益×80%+中信标普国债指数收益率×20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2008年3月27日批准报出。

2. 财务报表的编制基础

本基金以财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 4 所列示的基金行业实务操作的规定编制财务报表。

3. 遵循企业会计准则的声明

本基金 2007 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4. 重要会计政策和会计估计

1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2007 年 8 月 2 日(基金合同生效日) 至 2007 年 12 月 31 日。

2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

3) 金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销



后的净额在资产负债表列示。

4) 基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从权证确认日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最

近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及



重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

(iv) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

5) 证券投资基金成本计价方法：

(i) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，同时按附注 4/5) (i) (3) 所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在债券取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 贷款和应收款项

贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

(iii) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

6) 收入/(损失) 的确认和计量



股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。
债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，确认利息收入。若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7) 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

8) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。基金份额拆分通过调整实收基金科目对应的基金份额数实现，基金份额拆分增加的基金份额数于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

9) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

10) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至多四次，基金收益分配比例每次不低于



可分配收益的 50%；如当年基金成立未满三个月则不需分配收益。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金当期可分配收益先弥补以前年度亏损后方可进行当年收益分配。基金当年亏损则不进行收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

11) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计

无。

12) 重大会计差错的内容和更正金额

无。

5. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2004]78 号《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》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》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、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4) 基金买卖股票按 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税。

6. 资产负债表日后事项

无。

7. 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 | 提取管理费 | 基金合同 |
| | 基金注册登记机构 | 持有本基金 | |
| | 基金销售机构 | | |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人 基金代销机构 | 提取托管费 | 基金合同 |



上海国际信托有限公司 基金管理人的股东
(原名为上海国际信托投资有
限公司)

上海电气(集团)总公司 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

上海沸点投资发展有限公司 基金管理人的股东

上海锦江国际投资管理有限公 基金管理人的股东(2007
司 年 11 月 20 日起)

上海广电(集团)有限公司 基金管理人的原股东
(2007 年 11 月 20 日之前)

根据华安基金管理有限公司于 2007 年 11 月 20 日发布的公告,经公司股东会审议通过,并报经中国证监会证监基金字(2007)282 号文批准,公司股东上海广电(集团)有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 20%股权转让给上海锦江国际投资管理有限公司。

(2). 通过关联方交易单元进行的交易

- ① 本报告期(2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间)通过关联人交易单元的股票成交量:无。
- ② 本报告期(2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间)通过关联人交易单元的债券、回购和权证成交量:无。
- ③ 本报告期(2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间)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,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

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 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间需支付基金管理费 119,030,238.20 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:

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

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 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间需支付基金托管费 19,838,373.04 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 12 月 31 日保管的银行存款余额为 1,265,538,985.34 元。2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 20,066,732.62 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 12 月 31 日的相关余额 3,366,988,561.88 元计入“清算备付金”科目。

(4). 基金管理公司投资本基金的情况：

2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日止期间基金管理公司投资本基金的情况：

| 关联人 | 2007 年 8 月 1 日 | | 买入 | 卖出 | 基金拆分 增加份额(份) | 2007 年 12 月 31 日 | | 适用 费率 |
|----------------|----------------|-------|------|------|-----------------|------------------|-------|----------|
| | 持有份额(份) | 持有比例 | | | | 持有份额(份) | 持有比例 | |
| 华安基金管理 有限公司 | 9,582,100.00 | 1.92% | 0.00 | 0.00 | 14,721,310.95 | 24,303,410.95 | 0.11% | - |

华安基金公司持有本基金的基金份额均由原基金安久的基金份额转换而来。

(5). 基金管理公司主要股东及其控制的机构 2007 年 12 月 31 日未投资本基金。

8. 基金会计报表重要项目的说明

(1). 交易性金融资产明细：

| 明细项目 | 2007 年 12 月 31 日 | | |
|------------|-------------------|-------------------|------------------|
| | 成本 | 市值 | 估值增值 |
| 股票投资 | 16,895,112,336.69 | 17,961,613,055.33 | 1,066,500,718.64 |
| 交易所市场 | 100,797,663.57 | 100,839,424.00 | 41,760.43 |
| 债券投资 银行间市场 | 836,006,540.00 | 836,392,000.00 | 385,460.00 |
| 合计 | 936,804,203.57 | 937,231,424.00 | 427,220.43 |
| 合计 | 17,831,916,540.26 | 18,898,844,479.33 | 1,066,927,939.07 |

(2). 衍生金融资产明细：

| 明细项目 | 2007 年 12 月 31 日 |
|------|------------------|
|------|------------------|

| | 成本 | 市值 | 估值增值 |
|----|------------|------------|-----------|
| 权证 | 552,381.43 | 578,286.63 | 25,905.20 |
| 合计 | 552,381.43 | 578,286.63 | 25,905.20 |

(3). 应收利息明细:

| 明细项目 | 2007 年 12 月 31 日 |
|-----------|----------------------|
| 应收银行存款利息 | 728,582.66 |
| 应收清算备付金利息 | 1,008,030.76 |
| 应收权证保证金利息 | 45.60 |
| 应收债券利息 | 10,421,946.39 |
| 应收申购款利息 | 306.35 |
| 合计 | 12,158,911.76 |

(4). 应付交易费用明细:

| 明细项目 | 2007 年 12 月 31 日 |
|-----------------|----------------------|
| 东方证券股份有限公司 | 2,173,505.34 |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2,146,933.50 |
| 平安证券有限责任公司 | 1,046,831.49 |
| 光大证券股份有限公司 | 1,992,500.10 |
| 应付佣金 方正证券有限责任公司 | 3,639.44 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 868,149.50 |
| 联合证券有限责任公司 | 338,363.04 |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1,511,371.01 |
| 国金证券有限责任公司 | 4,708,383.53 |
| 齐鲁证券有限公司 | 327,169.72 |
| 合计 | 15,116,846.67 |
| 应付银行间结算费用 | 3,370.00 |
| 应付银行间交易费用 | 6,768.56 |
| 合计 | 15,126,985.23 |

(5). 其他负债:

| | 2007 年 12 月 31 日 |
|-----------|---------------------|
| 券商垫付交易保证金 | 1,000,000.00 |
| 应付赎回费 | 317,435.47 |
| 预提信息披露费 | 240,000.00 |
| 预提审计费 | 140,000.00 |
| 合计 | 1,697,435.47 |

(6). 实收基金变动明细:

2007 年 12 月 31 日



| | 基金份额（份） | 金额 |
|--------------------|-------------------|------------------|
| 2007年8月2日(基金合同生效日) | | |
| 及2007年8月20日份额拆分前 | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |
| 基金份额拆分调整(a) | 768,167,568.49 | 0.00 |
| 未领取红利折份额(b) | 4,248,686.26 | 1,675,128.10 |
| 集中申购募集资金本金(c) | 9,853,248,612.96 | 3,884,837,011.21 |
| 集中申购募集资金利息折份额(c) | 318,719.94 | 125,661.60 |
| 基金拆分和集中申购完成后 | 11,125,983,587.65 | 4,386,637,800.91 |
| 本期申购(d) | 13,581,237,522.64 | 5,354,684,309.39 |
| 本期赎回(d) | 2,424,634,798.14 | 955,965,946.59 |
| 2007年12月31日 | 22,282,586,312.15 | 8,785,356,163.71 |

(a) 根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告》，基金管理人华安基金管理有限公司确定2007年8月20日为基金份额拆分日。当日基金资产净值为1,268,167,568.49元，拆分前基金份额总额为500,000,000.00份，拆分前基金份额净值为2.5363元。根据基金份额拆分公式，基金份额拆分比例为1:2.536335136，拆分后基金份额总额为1,268,167,568.49份，拆分后基金份额净值为1.0000元。华安基金管理有限公司已根据上述拆分比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于2007年8月20日进行了变更登记。

(b) 对于原基金安久的基金份额持有人因暂未进行份额托管等原因产生的未领取红利款4,248,686.26元，于2007年8月20日按拆分后基金份额净值1.0000元折算为基金份额4,248,686.26份。

(c) 本基金于2007年8月15日进行集中申购，共募集净有效集中申购资金9,853,248,612.96元。根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金集中申购期内申购资金产生的利息收入318,719.94元在本基金集中申购期结束后折算为基金份额，划入基金份额持有人账户。

(d) 根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2007年8月15日(集中申购期结束后日)至2007年9月16日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回和转换业务自2007年9月17日起开始办理。

(7). 股票投资收益:

| 明细项目 | 2007年 |
|-------------|------------------|
| 卖出股票成交总额 | 3,327,318,457.36 |
| 减: 卖出股票成本总额 | 3,042,935,268.71 |
| 股票投资收益 | 284,383,188.65 |

(8). 债券投资收益:

| 明细项目 | 2007年 |
|------------------|----------------|
| 卖出及到期兑付债券结算金额 | 790,294,681.05 |
| 减: 应收利息总额 | 17,320,901.05 |
| 减: 卖出及到期兑付债券成本总额 | 772,105,720.00 |
| 债券投资收益 | 868,060.00 |

(9). 衍生工具收益:

| 明细项目 | 2007 年 |
|-------------|----------------|
| 卖出权证成交金额 | 298,587,460.78 |
| 减: 卖出权证成本总额 | 291,386,704.81 |
| 衍生工具收益 | 7,200,755.97 |

(10). 公允价值变动收益/损失:

| 明细项目 | 2007 年 |
|---------|----------------|
| 交易性金融资产 | |
| ——股票投资 | 587,119,277.25 |
| ——债券投资 | 556,220.43 |
| 衍生工具 | |
| ——权证投资 | -9,393,831.58 |
| 合计 | 578,281,666.10 |

(11). 其他收入:

| 明细项目 | 2007 年 |
|-------------|--------------|
| 赎回基金补偿收入(a) | 3,106,565.63 |
| 转换基金补偿收入(b) | 80,782.25 |
| 合计 | 3,187,347.88 |

(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减, 赎回费总额的25%归入基金资产。

(b) 基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成, 其中赎回费部分的 25%归入转出基金的基金资产。

(12). 交易费用:

| 明细项目 | 2007 年 |
|-----------|---------------|
| 交易所交易费用 | 86,022,788.58 |
| 银行间市场交易费用 | 6,975.00 |
| 合计 | 86,029,763.58 |

(13). 其他费用:

| 明细项目 | 2007 年 |
|-----------|------------|
| 审计费 | 90,000.00 |
| 信息披露费 | 99,943.98 |
| 银行划款手续费 | 12,044.81 |
| 债券托管账户维护费 | 4,500.00 |
| 其他费用 | 100.00 |
| 合计 | 206,588.79 |



(14). 基金收益分配：无

9. 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：

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。

本基金截至 2007 年 12 月 31 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 可流通日 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|------|------------|------------|--------|-------|--------|-----------|----------------|------------------|
| 601088 | 中国神华 | 2007-09-27 | 2008-01-09 | 新股网下申购 | 36.99 | 65.61 | 9,402,280 | 347,790,337.20 | 616,883,590.80 |
| 601601 | 中国太保 | 2007-12-18 | 2008-03-26 | 新股网下申购 | 30.00 | 49.45 | 2,395,286 | 71,858,580.00 | 118,446,892.70 |
| 601857 | 中国石油 | 2007-10-30 | 2008-02-05 | 新股网下申购 | 16.70 | 30.96 | 7,521,400 | 125,607,380.00 | 232,862,544.00 |
| 601866 | 中海集运 | 2007-12-07 | 2008-03-12 | 新股网下申购 | 6.62 | 12.15 | 5,297,086 | 35,066,709.32 | 64,359,594.90 |
| 601918 | 国投新集 | 2007-12-07 | 2008-03-20 | 新股网下申购 | 5.88 | 15.92 | 445,632 | 2,620,316.16 | 7,094,461.44 |
| 002175 | 广陆数测 | 2007-09-26 | 2008-01-14 | 新股网下申购 | 11.09 | 35.20 | 39,000 | 432,510.00 | 1,372,800.00 |
| 002176 | 江特电机 | 2007-09-26 | 2008-01-14 | 新股网下申购 | 11.80 | 35.08 | 47,222 | 557,219.60 | 1,656,547.76 |
| 002177 | 御银股份 | 2007-10-24 | 2008-02-01 | 新股网下申购 | 13.79 | 68.00 | 10,305 | 142,105.95 | 700,740.00 |
| 002178 | 延华智能 | 2007-10-24 | 2008-02-01 | 新股网下申购 | 7.89 | 23.20 | 10,994 | 86,742.66 | 255,060.80 |
| 002179 | 中航光电 | 2007-10-22 | 2008-02-01 | 新股网下申购 | 16.19 | 45.85 | 17,146 | 277,593.74 | 786,144.10 |
| 002181 | 粤传媒 | 2007-11-07 | 2008-02-18 | 新股网下申购 | 7.49 | 26.68 | 12,421 | 93,033.29 | 331,392.28 |
| 002182 | 云海金属 | 2007-11-02 | 2008-02-13 | 新股网下申购 | 10.79 | 27.93 | 32,956 | 355,595.24 | 920,461.08 |
| 002183 | 怡亚通 | 2007-11-02 | 2008-02-13 | 新股网下申购 | 24.89 | 77.95 | 20,376 | 507,158.64 | 1,588,309.20 |
| 002184 | 海得控制 | 2007-11-07 | 2008-02-18 | 新股网下申购 | 12.90 | 23.01 | 16,852 | 217,390.80 | 387,764.52 |
| 002185 | 华天科技 | 2007-11-08 | 2008-02-20 | 新股网下申购 | 10.55 | 21.44 | 33,697 | 355,503.35 | 722,463.68 |
| 002186 | 全聚德 | 2007-11-07 | 2008-02-20 | 新股网下申购 | 11.39 | 59.03 | 18,259 | 207,970.01 | 1,077,828.77 |
| 002187 | 广百股份 | 2007-11-12 | 2008-02-22 | 新股网下申购 | 11.68 | 42.99 | 19,759 | 230,785.12 | 849,439.41 |
| 002188 | 新嘉联 | 2007-11-12 | 2008-02-22 | 新股网下申购 | 10.07 | 21.46 | 11,180 | 112,582.60 | 239,922.80 |
| 002189 | 利达光电 | 2007-11-19 | 2008-03-03 | 新股网下申购 | 5.10 | 14.70 | 24,710 | 126,021.00 | 363,237.00 |
| 002190 | 成飞集成 | 2007-11-19 | 2008-03-03 | 新股网下申购 | 9.90 | 21.16 | 14,098 | 139,570.20 | 298,313.68 |
| 002194 | 武汉凡谷 | 2007-11-28 | 2008-03-07 | 新股网下申购 | 21.10 | 51.91 | 33,001 | 696,321.10 | 1,713,081.91 |
| 002195 | 海隆软件 | 2007-12-04 | 2008-03-12 | 新股网下申购 | 10.49 | 32.86 | 6,796 | 71,290.04 | 223,316.56 |
| 002196 | 方正电机 | 2007-12-04 | 2008-03-12 | 新股网下申购 | 7.48 | 24.38 | 9,880 | 73,902.40 | 240,874.40 |
| 002199 | 东晶电子 | 2007-12-12 | 2008-03-21 | 新股网下申购 | 8.80 | 25.50 | 9,645 | 84,876.00 | 245,947.50 |
| 002201 | 九鼎新材 | 2007-12-13 | 2008-03-26 | 新股网下申购 | 10.19 | 31.87 | 10,176 | 103,693.44 | 324,309.12 |
| 002202 | 金风科技 | 2007-12-18 | 2008-03-26 | 新股网下申购 | 36.00 | 140.45 | 40,866 | 1,471,176.00 | 5,739,629.70 |
| 002092 | 中泰化学 | 2007-12-20 | 2008-01-07 | 公开增发 | 30.90 | 38.10 | 13,871 | 428,613.90 | 528,485.10 |
| 合计 | | | | | | | | 589,714,977.76 | 1,060,213,153.21 |

截至 2007 年 12 月 31 日，本基金股票投资部分持有以下因将公布的重大事项可



能产生重大影响而被暂时停牌的股票，这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末估值单价 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|------|------------|----------|--------|----------|--------|---------|---------------|---------------|
| 600415 | 小商品城 | 2007-12-11 | 筹划定向增发事宜 | 86.59 | 2008-3-5 | 95.25 | 400,000 | 34,679,911.00 | 34,636,000.00 |
| 合计 | | | | | | | | 34,679,911.00 | 34,636,000.00 |

(2)、本基金截止本报告期末流通受限的债券情况如下：

基金认购新发行分离交易可转债而取得的债券，从债券认购日至债券上市日期间，暂无法流通。本基金截至 2007 年 12 月 31 日止流通受限制的债券情况如下：

| 债券代码 | 债券名称 | 成功认购日期 | 可流通日期 | 单位成本 | 期末估值单价 | 认购数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|--------|----------|----------|-------|--------|--------|--------------|--------------|
| 126008 | 08 上汽债 | 07/12/24 | 08/01/08 | 68.75 | 71.80 | 17,680 | 1,215,463.57 | 1,269,424.00 |
| 合计 | | | | | | | 1,215,463.57 | 1,269,424.00 |

(3)、本基金截止本报告期末流通受限的权证情况如下：

基金认购新发行分离交易可转债而取得的权证，从权证获配日至权证上市日期间，暂无法流通。本基金截至 2007 年 12 月 31 日止流通受限制的权证情况如下：

| 权证代码 | 权证名称 | 成功送配日期 | 可流通日期 | 单位成本 | 期末估值单价 | 送配数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|--------|---------|----------|----------|------|--------|--------|------------|------------|
| 580016 | 上汽 CWB1 | 07/12/24 | 08/01/08 | 8.68 | 9.0857 | 63,648 | 552,381.43 | 578,286.63 |
| 合计 | | | | | | | 552,381.43 | 578,286.63 |

(4)、期末债券正回购交易中作为质押的债券：

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金从事银行间同业市场的债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元，质押债券：无。

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元，质押债券：无。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

(5) 期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金在买断式逆回购交易时收到的、在债券所有人没有违约时就可以出售或在用于质押的债券的公允价值及基金实际再出售或质押情况：无

10. 风险管理

(a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。



本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部和合规监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部和合规监察稽核部对公司总经理负责，并由副总经理和督察长分管。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心、由督察长、合规与风险管理委员会、风险管理部、合规监察稽核部和相关业务部门共同构成的风险管理架构体系。

(b) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(d) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险



市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资组合中，股票投资比例为基金资产的 **60-95%**；债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 **0-40%**；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 **5%**。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

| 2007 年 12 月 31 日 | | |
|------------------|--------------------------|----------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值的比例 |
| 交易性金融资产 | | |
| - 股票投资 | 17,961,613,055.33 | 76.83% |
| - 债券投资 | 937,231,424.00 | 4.01% |
| 衍生金融资产 | 578,286.63 | 0.00% |
| | 18,899,422,765.96 | 80.84% |

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准(80%×中信标普 300 指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率)的公允价值上升 **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 **10.3 亿元**；反之，若本基金业绩比较基准(80%×中信标普 300 指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率)的公允价值下降 **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 **10.3 亿元**。

(ii) 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、存出保证金及债券投资等。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交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

| 2007 年 12 月 31 日 | | | | | | |
|------------------|------------------|----------------|--------------|-------------------|--|-------------------|
| | 6 个月以内 | 6 个月至 1 年 | 5 年以上 | 不计息 | | 合计 |
| 资产 | | | | | | |
| 银行存款 | 1,265,538,985.34 | - | - | - | | 1,265,538,985.34 |
| 结算备付金 | 3,366,988,561.88 | - | - | - | | 3,366,988,561.88 |
| 存出保证金 | 101,282.05 | - | - | 6,243,503.58 | | 6,344,785.63 |
| 交易性金融资产 | 647,542,000.00 | 288,420,000.00 | 1,269,424.00 | 17,961,613,055.33 | | 18,898,844,479.33 |
| 衍生金融资产 | | | - | 578,286.63 | | 578,286.63 |



| | | | |
|-----------|-------------------------|-----------------------|---|
| 应收证券清算款 | - | 26,173,981.95 | 26,173,981.95 |
| 应收利息 | - | 12,158,911.76 | 12,158,911.76 |
| 应收申购款 | - | 349,017.67 | 349,017.67 |
| 资产总计 | 5,280,170,829.27 | 288,420,000.00 | 1,269,424.00 18,007,116,756.92 23,576,977,010.19 |
| 负债 | | | |
| 应付证券清算款 | - | 62,284,387.53 | 62,284,387.53 |
| 应付赎回款 | - | 85,570,301.26 | 85,570,301.26 |
| 应付管理人报酬 | - | 28,953,381.39 | 28,953,381.39 |
| 应付托管费 | - | 4,825,563.57 | 4,825,563.57 |
| 应付交易费用 | - | 15,126,985.23 | 15,126,985.23 |
| 其他负债 | - | 1,697,435.47 | 1,697,435.47 |
| 负债总计 | - | 198,458,054.45 | 198,458,054.45 |
| 利率敏感度缺口 | 5,280,170,829.27 | 288,420,000.00 | 1,269,424.00 17,808,658,702.47 23,378,518,955.74 |

于 2007 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于 5%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

(iii) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

八、 基金安久财务会计报告

(一) 资产负债表

二零零七年八月一日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注 | 2007年8月1日 | 2006年12月31日 |
|----------|------|-------------------------|-------------------------|
| 资产 | | | |
| 银行存款 | | 24,465,878.00 | 29,953,369.94 |
| 结算备付金 | | 6,695,835.31 | 8,648,777.22 |
| 存出保证金 | | 851,282.05 | 859,609.61 |
| 交易性金融资产 | 8(1) | 1,066,577,371.35 | 971,512,497.49 |
| 其中：股票投资 | | 1,036,596,371.35 | 766,462,377.29 |
| 债券投资 | | 29,981,000.00 | 205,050,120.20 |
| 衍生金融资产 | 8(2) | 21,230,000.00 | 27,336,816.00 |
| 应收证券清算款 | | 13,909,446.54 | 5,343,691.99 |
| 应收利息 | 8(3) | 491,306.36 | 1,032,999.96 |
| 应收股利 | | 143,117.19 | - |
| 资产总计 | | 1,134,364,236.80 | 1,044,687,762.21 |
| 负债和所有者权益 | | | |
| 负债 | | | |
| 应付证券清算款 | | - | 33,929,841.86 |
| 应付管理人报酬 | | 1,939,395.19 | 1,170,742.54 |
| 应付托管费 | | 325,006.77 | 195,123.74 |



| | | | |
|------------|------|-------------------------|-------------------------|
| 应付交易费用 | 8(4) | 1,698,304.06 | 572,780.96 |
| 其他负债 | 8(5) | 1,020,056.02 | 880,000.00 |
| 负债合计 | | <u>4,982,762.04</u> | <u>36,748,489.10</u> |
| 所有者权益 | | | |
| 实收基金 | 8(6) | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |
| 未分配利润 | | <u>629,381,474.76</u> | <u>507,939,273.11</u> |
| 所有者权益合计 | | <u>1,129,381,474.76</u> | <u>1,007,939,273.11</u> |
| 负债和所有者权益总计 | | <u>1,134,364,236.80</u> | <u>1,044,687,762.21</u> |
| | | | |
| 基金份额总额(份) | | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |
| 基金份额净值 | | <u>2.2588</u> | <u>2.0159</u> |

所附附注为本会计报表的组成部分

(二) 利润表

自二零零七年一月一日至二零零七年八月一日止期间

单位：人民币元

| 项 目 | 附注 | 2007年1月1日至 2007年8月1日止期间 | 2006年度 |
|-------------|-------|----------------------------|-----------------------|
| 收入 | | | |
| 利息收入 | | 4,451,250.43 | 3,998,517.32 |
| 其中：存款利息收入 | | 461,587.82 | 387,147.20 |
| 债券利息收入 | | 3,989,662.61 | 3,611,370.12 |
| 投资收益 | | 605,635,834.75 | 219,285,460.74 |
| 其中：股票投资收益 | 8(7) | 593,521,257.41 | 200,269,542.08 |
| 债券投资损失 | 8(8) | -1,962,953.69 | -556,862.58 |
| 衍生工具收益 | 8(9) | 9,281,046.48 | 11,966,246.49 |
| 股利收益 | | 4,796,484.55 | 7,606,534.75 |
| 公允价值变动收益 | 8(10) | 95,159,239.35 | 367,054,299.29 |
| 收入合计 | | <u>705,246,324.53</u> | <u>590,338,277.35</u> |
| | | | |
| 费用 | | | |
| 管理人报酬 | 7(3) | 11,006,088.96 | 9,609,918.12 |
| 托管费 | 7(3) | 1,836,122.33 | 1,601,653.02 |
| 交易费用 | 8(11) | 6,052,949.86 | 3,167,503.42 |
| 利息支出 | | 2,959,330.51 | 967,291.03 |
| 其中：卖出回购金融资产 | | | |
| 支出 | | 2,959,330.51 | 967,291.03 |
| 其他费用 | 8(12) | 1,949,631.22 | 374,012.91 |
| 费用合计 | | <u>23,804,122.88</u> | <u>15,720,378.50</u> |

| | | |
|-----------------|----------------|----------------|
| 利润总额 | 681,442,201.65 | 574,617,898.85 |
| 所附附注为本会计报表的组成部分 | | |

(三) 所有者权益变动表

自二零零七年一月一日至二零零七年八月一日止期间

单位：人民币元

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|----------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 一、年初所有者权益(基金净值) | 500,000,000.00 | 507,939,273.11 | 1,007,939,273.11 |
| 二、本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润) | 0.00 | 681,442,201.65 | 681,442,201.65 |
| 三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | 0.00 | 560,000,000.00 | 560,000,000.00 |
| 四、年末所有者权益(基金净值) | 500,000,000.00 | 629,381,474.76 | 1,129,381,474.76 |
| 所附附注为本会计报表的组成部分 | | | |

二零零六年度

单位：人民币元

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|----------------------------|----------------|----------------|------------------|
| 一、年初所有者权益(基金净值) | 500,000,000.00 | -66,678,625.74 | 433,321,374.26 |
| 二、本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润) | 0.00 | 574,617,898.85 | 574,617,898.85 |
| 三、本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 四、年末所有者权益(基金净值) | 500,000,000.00 | 507,939,273.11 | 1,007,939,273.11 |
| 所附附注为本会计报表的组成部分 | | | |

(四) 会计报表附注

1. 基金的基本情况

安久证券投资基金(以下简称“本基金”)是按照《证券投资基金管理暂行办法》、国务院办公厅文件国办发(1999)第28号《国务院办公厅转发证监会原有投资基金清理规范方案的通知》、经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字(2000)第28号《关于四川国信投资基金清理规范方案的批复》、中国证监会证监基金字(2000)第56号《关于同意四川国信投资基金规范为安久证券投资基金并上市、扩募和续期的批复》及其他有关的规定和《安久证券投资基金基金合同》由原四川国信投资基金经规范重组而成。华安基金管理有限公司担



任本基金的基金管理人及基金发起人，基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金为契约型封闭式，发行规模为200,000,020份基金份额，原存续期为1992年8月31日至2002年8月30日。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字(2001)77号文审核同意，本基金于2001年8月31日在深交所挂牌交易。

本基金为契约型封闭式，发行规模为200,000,020份基金份额，原存续期为1992年8月31日至2002年8月30日。经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字(2001)77号文审核同意，本基金于2001年8月31日在深交所挂牌交易。经中国证监会证监基金字(2000)第56号文件批准，本基金于2002年5月21日将基金总份额扩募至5亿份基金份额，存续期限延长5年至2007年8月30日。

根据本基金基金份额持有人大会2007年6月29日审议通过的《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证监会证监基金字(2007)210号文核准，本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于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》，向深交所申请提前终止本基金的上市交易，并获深交所深证复(2007)41号《关于同意安久证券投资基金终止上市的批复》同意。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》、《安久证券投资基金基金合同》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》、中国证监会证监基金字(2007)210号文和《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》等的有关规定，本基金于2007年8月1日进行终止上市权利登记，2007年8月2日终止上市，《安久证券投资基金基金合同》自终止上市日起失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《安久证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。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(基金合同失效前日)，本基金为基金转型作准备而提前调整资产配置比例。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2008年3月27日批准报出。

2. 财务报表的编制基础

本基金原以2006年2月15日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》(以下合称“原会计准则和制度”)、《安久证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自2007年7月1日起，本基金开始执行财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007年1月1日至2007年8月1日(基金合同失效前日)止期间的财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《安久证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制的财务报表。

在编制2007年1月1日至2007年8月1日(基金合同失效前日)止期间财务报表时，2006年度以及2007年1月1日至2007年6月30日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第38号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为



以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，并将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注 11。

经中国证监会批准并经深交所同意，本基金的基金管理人华安基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为华安策略优选股票型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

3. 遵循企业会计准则的声明

本基金 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日(基金合同失效前日)止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2007 年 8 月 1 日的财务状况以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4. 重要会计政策和会计估计

1) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日(基金合同失效前日)。

2) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

3) 金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后



的净额在资产负债表列示。

4) 基金资产的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上

相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

(i) 股票投资

上市交易的股票于 2007 年 7 月 1 日之前按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的以最近交易日的市场交易均价估值；自 2007 年 7 月 1 日起，上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票于 2007 年 7 月 1 日之前按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；自 2007 年 7 月 1 日起，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，2007 年 7 月 1 日前在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价估值；自 2007 年 7 月 1 日起在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债 2007 年 7 月 1 日之前按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值；自 2007 年 7 月 1 日起按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券于 2007 年 7 月 1 日之前按估值日市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价减去债券均价中所含的债券应收利息得到的净价估值；自 2007 年 7 月 1 日起按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环



境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入交易日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资于 2007 年 7 月 1 日之前按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易均价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易均价估值；自 2007 年 7 月 1 日起按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

(iv) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

5) 证券投资基金成本计价方法：

(i) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(2) 债券投资

2007 年 7 月 1 日之前，买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)后的金额确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自 2007 年 7 月 1 日起，买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。2007 年 7 月 1 日之前，卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益/(损失)；自 2007 年 7 月 1 日起，卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007 年 7 月 1 日之前，权证投资成本



按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 贷款和应收款项

2007 年 7 月 1 日之前，贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账，并采用名义利率法确认相关的利息收入；自 2007 年 7 月 1 日起，贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

(iii) 其他金融负债

2007 年 7 月 1 日之前，其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账，并采用名义利率法确认负债相关的利息支出，其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额；自 2007 年 7 月 1 日起，其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

6) 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。自 2007 年 7 月 1 日起，若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7) 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。基金成立三个月后，如持有现金比例高于基金资产净值的 20%(由于卖出回购证券和现金分红的原因造成可以除外)，超过部分不计提管理人报酬。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以直线法逐日确认；自 2007 年 7 月 1 日起，卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额，在回购期内以实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可



采用直线法。

8) 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

9) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金当年收益弥补上一年度亏损后可进行当年收益分配。基金当年亏损则不进行收益分配。基金收益分配采取现金方式，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，年度收益分配比例不低于基金年度可分配收益的 90%。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

10) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计

无。

11) 重大会计差错的内容和更正金额

无。

5. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《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》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》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、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4) 基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3% 的税率缴纳。
- 5) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到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。

6. 资产负债表日后事项

无。



7. 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 |
| 交通银行股份有限公司 | 基金托管人 | 提取托管费 银行间市场 债券买卖 | 基金合同 成交通知 单 |
| 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 | | |
| 上海工业投资(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 | | |
| 上海广电(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). 通过关联方交易单元进行的交易

①本报告期(2007年1月1日至2007年8月1日止期间)通过关联人交易单元的股票成交量：无。

上年度通过关联人交易单元的股票成交量：无。

②本报告期(2007年1月1日至2007年8月1日止期间)通过关联人交易单元的债券、回购和权证成交量：无。

上年度通过关联人交易单元的债券、回购和权证成交量：无。

③本报告期(2007年1月1日至2007年8月1日止期间)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 |
|----------------|--------------|---------------|------------|------|------------|------|
| 交通银行股份 有限公司 | - | 20,235,775.34 | - | - | - | - |

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(扣除本基金持有超出基金资产净值 20%部分的现金资产)的 1.5%的年费率计提，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

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 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日止期间需支付基金管理费 11,006,088.96 元。(上年度: 9,609,918.12 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:

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

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 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日止期间需支付基金托管费 1,836,122.33 元。(上年度: 1,601,653.02 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 8 月 1 日保管的银行存款余额为 24,465,878.00 元(2006 年末: 29,953,369.94)。2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日止期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 260,834.76 元。(2006 年: 197,578.35 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 8 月 1 日的相关余额 6,695,835.31 元计入“清算备付金”科目(2006 年末: 8,648,777.22 元)。

(4). 基金管理公司投资本基金的情况:

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 8 月 1 日止期间基金管理公司投资本基金的情况:

| 关联人 | 期初数 | | 买入 | 卖出 | 期末数 | | 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 | 9,582,100.00 | 1.92% | 0.00 | 0.00 | 9,582,100.00 | 1.92% | - |

2006 年度基金管理公司投资本基金的情况:

| 关联人 | 期初数 | | 买入 | 卖出 | 期末数 | | 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 | 9,582,100.00 | 1.92% | 0.00 | 0.00 | 9,582,100.00 | 1.92% | - |

(5). 基金管理公司主要股东及其控制的机构 2007 年 8 月 1 日及 2006 年 12 月 31 日未投资本基金。



8. 基金会计报表重要项目的说明

(1). 交易性金融资产明细:

| 明细项目 | 2007 年 8 月 1 日 | | |
|------------|----------------|------------------|----------------|
| | 成本 | 市值 | 估值增值 |
| 股票投资 | 557,214,929.96 | 1,036,596,371.35 | 479,381,441.39 |
| 债券投资—银行间市场 | 30,110,000.00 | 29,981,000.00 | -129,000.00 |
| 合计 | 587,324,929.96 | 1,066,577,371.35 | 479,252,441.39 |

| 明细项目 | 2006 年 12 月 31 日 | | |
|------------|------------------|----------------|----------------|
| | 成本 | 市值 | 估值增值 |
| 股票投资 | 382,062,738.96 | 766,462,377.29 | 384,399,638.33 |
| 交易所市场 | 154,733,500.69 | 154,960,120.20 | 226,619.51 |
| 债券投资 银行间市场 | 50,090,000.00 | 50,090,000.00 | 0.00 |
| 合计 | 204,823,500.69 | 205,050,120.20 | 226,619.51 |
| 合计 | 586,886,239.65 | 971,512,497.49 | 384,626,257.84 |

(2). 衍生金融资产明细:

| 明细项目 | 2007 年 8 月 1 日 | | |
|------|----------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 市值 | 估值增值 |
| 权证 | 11,810,263.22 | 21,230,000.00 | 9,419,736.78 |
| 合计 | 11,810,263.22 | 21,230,000.00 | 9,419,736.78 |

| 明细项目 | 2006 年 12 月 31 日 | | |
|------|------------------|---------------|--------------|
| | 成本 | 市值 | 估值增值 |
| 权证 | 18,450,135.02 | 27,336,816.00 | 8,886,680.98 |
| 合计 | 18,450,135.02 | 27,336,816.00 | 8,886,680.98 |

(3). 应收利息明细:

| 明细项目 | 2007 年 8 月 1 日 | 2006 年 12 月 31 日 |
|---------|----------------|------------------|
| 银行存款利息 | 98,447.00 | 15,795.88 |
| 清算备付金利息 | 18,817.61 | 6,652.95 |
| 权证保证金利息 | 186.96 | 49.30 |
| 债券利息 | 373,854.79 | 1,010,501.83 |
| 合计 | 491,306.36 | 1,032,999.96 |

(4). 应付交易费用明细:

| | 2007 年 8 月 1 日 | 2006 年 12 月 31 日 |
|--|----------------|------------------|
| | | |

明细项目

| | | | |
|-----------|--------------|---------------------|-------------------|
| | 东方证券股份有限公司 | 228,888.28 | 152,833.54 |
| | 申银万国证券股份有限公司 | 131,152.72 | 69,926.89 |
| | 平安证券有限责任公司 | 762,216.34 | 128,613.69 |
| | 光大证券股份有限公司 | 354,983.20 | 92,036.98 |
| 应付佣金 | 方正证券有限责任公司 | 3,639.44 | 3,639.44 |
| | 国泰君安证券股份有限公司 | 132,025.21 | 38,911.72 |
| | 联合证券有限责任公司 | 82,130.52 | 86,818.70 |
| | 合计 | 1,695,035.71 | 572,780.96 |
| 应付银行间结算费用 | | 1,500.00 | 0.00 |
| 应付银行间交易费用 | | 1,768.35 | 0.00 |
| 合计 | | 1,698,304.06 | 572,780.96 |

(5). 其他负债明细:
2007 年 8 月 1 日
2006 年 12 月 31 日
明细项目

| | | |
|-----------|---------------------|-------------------|
| 券商垫付交易保证金 | 750,000.00 | 750,000.00 |
| 预提信息披露费 | 220,056.02 | 80,000.00 |
| 预提审计费用 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 合计 | 1,020,056.02 | 880,000.00 |

(6). 实收基金:
2007 年 8 月 1 日
2006 年 12 月 31 日

| 明细项目 | 2007 年 8 月 1 日 | | 2006 年 12 月 31 日 | |
|-------------|-----------------------|-----------------------|-------------------------|-----------------------|
| | 基金份额 (份) | 金额 | 基金份额 (份) | 金额 |
| 发起人持有基金份额 | | | | |
| - 非流通部分 | 2,500,000.00 | 2,500,000.00 | 2,500,000.00 | 2,500,000.00 |
| 发起人持有基金份额 | | | | |
| - 可流通部分 | 7,082,100.00 | 7,082,100.00 | 7,082,100.00 | 7,082,100.00 |
| 社会公众持有基金份额 | 490,417,900.00 | 490,417,900.00 | 490,417,900.00 | 490,417,900.00 |
| 合计 | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 | 500,000,000.00 |

根据中国证监会证监基金字[2000]56 号文以及《安久证券投资基金基金合同》的有关规定,基金发起人在基金扩募时认购基金总规模 1%的基金份额。基金发起人在基金存续期内须持有不少于 0.5%的基金份额。

(7). 股票投资收益:
2007 年 1 月 1 日至 2007
年 8 月 1 日止期间
2006 年

| | | |
|-------------|------------------|----------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,320,663,697.63 | 850,857,435.91 |
| 减: 卖出股票成本总额 | 727,142,440.22 | 650,587,893.83 |
| 股票投资收益 | 593,521,257.41 | 200,269,542.08 |



本基金于本会计期间未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价(2006年: 1,868,676.92元, 已全额冲减股票投资成本)。

(8). 债券投资收益:

| 明细项目 | 2007年1月1日至2007年8月1日止期间 | | 2006年 |
|------------------|------------------------|--|----------------|
| | | | |
| 卖出及到期兑付债券结算金额 | 759,900,977.00 | | 122,238,564.26 |
| 减: 应收利息总额 | 8,907,912.48 | | 2,110,884.32 |
| 减: 卖出及到期兑付债券成本总额 | 752,956,018.21 | | 120,684,542.52 |
| 债券投资收益 | -1,962,953.69 | | -556,862.58 |

(9). 衍生工具收益:

| 明细项目 | 2007年1月1日至2007年8月1日止期间 | | 2006年 |
|------------------|------------------------|--|---------------|
| | | | |
| 卖出权证及行权权证成交金额 | 28,649,860.23 | | 16,942,960.71 |
| 减: 卖出权证及行权权证成本总额 | 19,368,813.75 | | 4,976,714.22 |
| 衍生工具收益 | 9,281,046.48 | | 11,966,246.49 |

(10). 公允价值变动损益:

| 明细项目 | 2007年1月1日至2007年8月1日止期间 | | 2006年 |
|---------|------------------------|--|----------------|
| | | | |
| 交易性金融资产 | | | |
| — 股票投资 | 94,981,803.06 | | 358,131,761.30 |
| — 债券投资 | -355,619.51 | | 35,857.01 |
| 衍生金融资产 | | | |
| — 权证投资 | 533,055.80 | | 8,886,680.98 |
| 合计 | 95,159,239.35 | | 367,054,299.29 |

(11). 交易费用:

| 明细项目 | 2007年1月1日至2007年8月1日止期间 | | 2006年 |
|-----------|------------------------|--|--------------|
| | | | |
| 交易所交易费用 | 6,045,125.36 | | 3,166,603.42 |
| 银行间市场交易费用 | 7,824.50 | | 900.00 |
| | 6,052,949.86 | | 3,167,503.42 |

(12). 其他费用:

| 明细项目 | 2007 年 1 月 1 日至 2007 | |
|------------|----------------------|-------------------|
| | 年 8 月 1 日止期间 | 2006 年 |
| 分红手续费 | 1,663,200.00 | 0.00 |
| 信息披露费 | 140,056.02 | 240,000.00 |
| 审计费用 | 50,000.00 | 50,000.00 |
| 上市年费 | 40,000.00 | 60,000.00 |
| 基金份额持有人会议费 | 39,450.00 | 0.00 |
| 债券托管账户维护费 | 13,500.00 | 18,000.00 |
| 其他费用 | 3,425.20 | 6,012.91 |
| 合计 | 1,949,631.22 | 374,012.91 |

本次安久基金持有人大会费用合计为 39,450.00 元，由安久基金承担。具体

费用明细如下：

| 费用科目 | 金额（元） |
|------------|---------------|
| 场地费 | 17,800 |
| 公证费 | 8,000 |
| 律师费 | 5,000 |
| 资料费 | 8,650 |
| 合 计 | 39,450 |

(13). 基金收益分配：

| | 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 | 2007-3-31 | 2007-4-5 | 2007-4-6 | 2.20 | 110,000,000.00 |
| 本期第 2 次分红 | 2007-7-25 | 2007-7-30 | 2007-7-31 | 9.00 | 450,000,000.00 |

9. 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：

截至 2007 年 8 月 1 日，本基金股票投资部分持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 期末估值单价 | 停牌原因 | 复牌日期 | 复牌开盘单价 | 数量 | 期末成本总额 | 期末估值总额 |
|-----------|------|----------|--------|--------|----------|--------|-----------|----------------------|----------------------|
| 000039 | 中集集团 | 07/07/31 | 29.20 | 公告重大事项 | 07/08/06 | 32.12 | 1,550,000 | 26,170,709.01 | 45,260,000.00 |
| 000061 | 农产品 | 07/04/30 | 21.90 | 公告重大事项 | 07/10/12 | 24.09 | 751,797 | 15,186,344.45 | 16,464,354.30 |
| 合计 | | | | | | | | 41,357,053.46 | 61,724,354.30 |

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限的债券。



(3)、期末债券正回购交易中作为质押的债券：

截至 2007 年 8 月 1 日止，基金从事银行间同业市场的债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元(2006 年：0.00 元)，质押债券：无。

截至 2007 年 8 月 1 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元(2006 年：0.00 元)。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

(4)、期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至 2007 年 8 月 1 日止，基金在买断式逆回购交易时收到的、在债券所有人没有违约时就可以出售或在用于质押的债券的公允价值及基金实际再出售或质押情况如下：无。

2006 年末：无。

10. 风险管理

(a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部和合规监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部和合规监察稽核部对公司总经理负责，并由副总经理和督察长分管。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心、由督察长、合规与风险管理委员会、风险管理部、合规监察稽核部和相关业务部门共同构成的风险管理架构体系。

(b) 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。



本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 9 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的国债资产的公允价值。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

(d) 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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：

| | 2007 年 8 月 1 日 (基金合同失效前) | | 2006 年 12 月 31 日 | |
|----------------|-----------------------------|----------------|-----------------------|----------------|
| | 公允价值 | 占基金资产 净值的比例 | 公允价值 | 占基金资产 净值的比例 |
| 交易性金融资产 | | | | |
| - 股票投资 | 1,036,596,371.35 | 91.78% | 766,462,377.29 | 76.04% |
| - 债券投资 | 29,981,000.00 | 2.65% | 205,050,120.20 | 20.34% |
| 衍生金融资产 | 21,230,000.00 | 1.88% | 27,336,816.00 | 2.71% |
| | 1,087,807,371.35 | 96.32% | 998,849,313.49 | 99.10% |

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(基金合同失效前日)，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)。

(ii) 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。

| 2007 年 8 月 1 日 (基金合同失效前日) | 1 年以内 | 1 年至 5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------------|---------------|----------|-------|------------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 24,465,878.00 | - | - | - | 24,465,878.00 |
| 结算备付金 | 6,695,835.31 | - | - | - | 6,695,835.31 |
| 存出保证金 | 101,282.05 | - | - | 750,000.00 | 851,282.05 |
| 交易性金融资产 | 29,981,000.00 | - | - | 1,036,596,371.35 | 1,066,577,371.35 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | 21,230,000.00 | 21,230,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 13,909,446.54 | 13,909,446.54 |
| 应收利息 | - | - | - | 491,306.36 | 491,306.36 |
| 应收股利 | - | - | - | 143,117.19 | 143,117.19 |
| 资产总计 | 61,243,995.36 | - | - | 1,073,120,241.44 | 1,134,364,236.80 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,939,395.19 | 1,939,395.19 |
| 应付托管费 | - | - | - | 325,006.77 | 325,006.77 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,698,304.06 | 1,698,304.06 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,020,056.02 | 1,020,056.02 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,982,762.04 | 4,982,762.04 |
| 利率敏感度缺口 | 61,243,995.36 | - | - | 1,068,137,479.40 | 1,129,381,474.76 |

| 2006 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1 年至 5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------|----------------|---------------|--------------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 29,953,369.94 | - | - | - | 29,953,369.94 |
| 结算备付金 | 8,648,777.22 | - | - | - | 8,648,777.22 |
| 存出保证金 | 109,609.61 | - | - | 750,000.00 | 859,609.61 |
| 交易性金融资产 | 103,272,507.80 | 99,484,816.40 | 2,292,796.00 | 766,462,377.29 | 971,512,497.49 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | 27,336,816.00 | 27,336,816.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 5,343,691.99 | 5,343,691.99 |
| 应收利息 | - | - | - | 1,032,999.96 | 1,032,999.96 |



| | | | | | |
|----------------|-----------------------|----------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------|
| 资产总计 | 141,984,264.57 | 99,484,816.40 | 2,292,796.00 | 800,925,885.24 | 1,044,687,762.21 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 33,929,841.86 | 33,929,841.86 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,170,742.54 | 1,170,742.54 |
| 应付托管费 | - | - | - | 195,123.74 | 195,123.74 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 572,780.96 | 572,780.96 |
| 其他负债 | - | - | - | 880,000.00 | 880,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 36,748,489.10 | 36,748,489.10 |
| 利率敏感度缺口 | 141,984,264.57 | 99,484,816.40 | 2,292,796.00 | 764,177,396.14 | 1,007,939,273.11 |

于 2007 年 8 月 1 日，若市场利率下降 25 个基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 个基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)。

(iii) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

11. 首次执行企业会计准则

本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

| | 2006 年 1 月 1 日 所有者权益 | 2006 年度 净损益 | 2006 年 12 月 31 日 所有者权益 |
|------------------------|-------------------------|----------------|---------------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额 | 433,321,374.26 | 207,563,599.56 | 1,007,939,273.11 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | - | 367,054,299.29 | - |
| 按企业会计准则列报的金额 | 433,321,374.26 | 574,617,898.85 | 1,007,939,273.11 |

| | 2007 年 1 月 1 日 所有者权益 | 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间净 损益 | 2007 年 6 月 30 日 所有者权益 |
|------------------------|-------------------------|--|--------------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额 | 1,007,939,273.11 | 487,936,850.30 | 1,462,585,810.01 |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | - | 76,709,686.60 | - |
| 按企业会计准则列报的金额 | 1,007,939,273.11 | 564,646,536.90 | 1,462,585,810.01 |



根据上述追溯调整，按原会计准则和制度直接计入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“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于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额，现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”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

| 序号 | 资产组合 | 金额(元) | 占总资产比例 |
|----|------------|-------------------|---------|
| 1 | 股票 | 17,961,613,055.33 | 76.18% |
| 2 | 权证 | 578,286.63 | 0.00% |
| 3 | 债券 | 937,231,424.00 | 3.98% |
| 4 | 银行存款和清算备付金 | 4,632,527,547.22 | 19.65% |
| 5 | 其它资产 | 45,026,697.01 | 0.19% |
| | 合计 | 23,576,977,010.19 | 100.00% |

(二) 股票投资组合

| 行业分类 | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|------------------|-------------------|---------|
| A 农、林、牧、渔业 | 70,253,363.48 | 0.30% |
| B 采掘业 | 1,788,804,791.62 | 7.65% |
| C 制造业 | 5,800,309,112.75 | 24.83% |
| C0 食品、饮料 | 496,972,648.89 | 2.13% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 12,922,908.90 | 0.06% |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 899,179,834.02 | 3.85% |
| C5 电子 | 10,867,524.78 | 0.05% |
| C6 金属、非金属 | 1,532,897,811.26 | 6.56% |
| C7 机械、设备、仪表 | 2,033,082,315.95 | 8.70% |
| C8 医药、生物制品 | 814,386,068.95 | 3.48% |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 99,379,610.04 | 0.43% |
| F 交通运输、仓储业 | 2,125,174,883.04 | 9.09% |
| G 信息技术业 | 298,762,812.59 | 1.28% |
| H 批发和零售贸易 | 251,074,143.67 | 1.07% |
| I 金融、保险业 | 5,040,950,616.56 | 21.56% |
| J 房地产业 | 1,473,919,147.96 | 6.30% |
| K 社会服务业 | 851,604,905.77 | 3.64% |
| L 传播与文化产业 | 331,392.28 | 0.00% |
| M 综合类 | 161,048,275.57 | 0.69% |
| 合计 | 17,961,613,055.33 | 76.83% |

(三) 基金投资股票明细

| 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 | 38,070,980 | 1,508,752,937.40 | 6.45% |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 12,737,630 | 1,137,088,230.10 | 4.86% |
| 3 | 000002 | 万科A | 32,380,272 | 933,847,044.48 | 3.99% |
| 4 | 000069 | 华侨城A | 16,889,228 | 848,683,707.00 | 3.63% |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 15,788,394 | 833,627,203.20 | 3.57% |
| 6 | 601919 | 中国远洋 | 15,754,900 | 672,104,034.00 | 2.87% |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 5,997,277 | 636,311,089.70 | 2.72% |
| 8 | 601088 | 中国神华 | 9,402,280 | 616,883,590.80 | 2.64% |
| 9 | 600276 | 恒瑞医药 | 10,234,162 | 583,756,600.48 | 2.50% |
| 10 | 000157 | 中联重科 | 9,949,914 | 571,622,559.30 | 2.45% |
| 11 | 600009 | 上海机场 | 11,848,657 | 444,561,610.64 | 1.90% |
| 12 | 000060 | 中金岭南 | 9,123,741 | 405,459,050.04 | 1.73% |
| 13 | 000951 | 中国重汽 | 5,730,086 | 379,904,701.80 | 1.63% |
| 14 | 601111 | 中国国航 | 12,449,974 | 341,627,286.56 | 1.46% |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 6,530,774 | 338,685,939.64 | 1.45% |
| 16 | 600309 | 烟台万华 | 8,823,702 | 335,741,861.10 | 1.44% |
| 17 | 000612 | 焦作万方 | 6,733,013 | 301,840,972.79 | 1.29% |
| 18 | 601699 | 潞安环能 | 4,001,020 | 287,153,205.40 | 1.23% |
| 19 | 600348 | 国阳新能 | 5,152,426 | 275,757,839.52 | 1.18% |
| 20 | 600048 | 保利地产 | 4,167,912 | 270,164,055.84 | 1.16% |
| 21 | 601628 | 中国人寿 | 4,307,213 | 249,559,921.22 | 1.07% |
| 22 | 600428 | 中远航运 | 6,352,286 | 247,421,539.70 | 1.06% |
| 23 | 000651 | 格力电器 | 4,961,872 | 244,868,383.20 | 1.05% |
| 24 | 600031 | 三一重工 | 4,086,201 | 233,076,905.04 | 1.00% |
| 25 | 601857 | 中国石油 | 7,521,400 | 232,862,544.00 | 1.00% |
| 26 | 600786 | 东方锅炉 | 2,278,963 | 192,458,425.35 | 0.82% |
| 27 | 601006 | 大秦铁路 | 6,943,738 | 177,898,567.56 | 0.76% |
| 28 | 600718 | 东软股份 | 3,648,500 | 170,056,585.00 | 0.73% |
| 29 | 600875 | 东方电气 | 1,812,879 | 161,346,231.00 | 0.69% |
| 30 | 000717 | 韶钢松山 | 13,806,463 | 159,326,583.02 | 0.68% |
| 31 | 000983 | 西山煤电 | 2,449,025 | 155,439,616.75 | 0.66% |
| 32 | 000338 | 潍柴动力 | 1,725,806 | 149,454,799.60 | 0.64% |
| 33 | 000022 | 深赤湾A | 5,579,748 | 148,756,081.68 | 0.64% |
| 34 | 000635 | 英力特 | 5,069,765 | 145,299,464.90 | 0.62% |
| 35 | 000024 | 招商地产 | 2,387,255 | 141,325,496.00 | 0.60% |
| 36 | 600858 | 银座股份 | 3,362,923 | 126,412,275.57 | 0.54% |
| 37 | 000568 | 泸州老窖 | 1,706,181 | 125,404,303.50 | 0.54% |
| 38 | 600660 | 福耀玻璃 | 3,438,809 | 123,315,690.74 | 0.53% |
| 39 | 601601 | 中国太保 | 2,395,286 | 118,446,892.70 | 0.51% |
| 40 | 600005 | 武钢股份 | 5,844,500 | 115,136,650.00 | 0.49% |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|----------------|-------|
| 41 | 601939 | 建设银行 | 10,778,800 | 106,171,180.00 | 0.45% |
| 42 | 600830 | 大红鹰 | 4,647,902 | 104,810,190.10 | 0.45% |
| 43 | 000895 | 双汇发展 | 1,730,710 | 102,094,582.90 | 0.44% |
| 44 | 000422 | 湖北宜化 | 4,359,576 | 100,313,843.76 | 0.43% |
| 45 | 600050 | 中国联通 | 8,247,870 | 99,634,269.60 | 0.43% |
| 46 | 600315 | 上海家化 | 2,009,800 | 97,214,026.00 | 0.42% |
| 47 | 600409 | 三友化工 | 4,960,351 | 96,578,033.97 | 0.41% |
| 48 | 000039 | 中集集团 | 3,619,638 | 93,676,231.44 | 0.40% |
| 49 | 600600 | 青岛啤酒 | 2,366,842 | 92,638,195.88 | 0.40% |
| 50 | 000898 | 鞍钢股份 | 2,796,477 | 84,397,675.86 | 0.36% |
| 51 | 600547 | 山东黄金 | 475,105 | 80,287,993.95 | 0.34% |
| 52 | 002024 | 苏宁电器 | 1,070,400 | 76,908,240.00 | 0.33% |
| 53 | 600585 | 海螺水泥 | 1,052,652 | 76,654,118.64 | 0.33% |
| 54 | 000608 | 阳光股份 | 4,873,263 | 73,488,806.04 | 0.31% |
| 55 | 600489 | 中金黄金 | 603,040 | 68,837,016.00 | 0.29% |
| 56 | 601398 | 工商银行 | 8,007,300 | 65,099,349.00 | 0.28% |
| 57 | 601866 | 中海集运 | 5,297,086 | 64,359,594.90 | 0.28% |
| 58 | 600519 | 贵州茅台 | 260,074 | 59,817,020.00 | 0.26% |
| 59 | 600150 | 中国船舶 | 236,883 | 59,159,160.42 | 0.25% |
| 60 | 000825 | 太钢不锈 | 2,377,203 | 58,883,318.31 | 0.25% |
| 61 | 600019 | 宝钢股份 | 3,350,000 | 58,424,000.00 | 0.25% |
| 62 | 600887 | 伊利股份 | 1,955,655 | 57,359,361.15 | 0.25% |
| 63 | 600900 | 长江电力 | 2,700,000 | 52,623,000.00 | 0.23% |
| 64 | 000829 | 天音控股 | 1,949,293 | 51,383,363.48 | 0.22% |
| 65 | 600426 | 华鲁恒升 | 1,897,533 | 50,284,624.50 | 0.22% |
| 66 | 000522 | 白云山A | 3,316,132 | 48,349,204.56 | 0.21% |
| 67 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,230,000 | 46,941,500.00 | 0.20% |
| 68 | 000960 | 锡业股份 | 690,534 | 45,616,676.04 | 0.20% |
| 69 | 000792 | 盐湖钾肥 | 542,394 | 42,241,644.72 | 0.18% |
| 70 | 600649 | 原水股份 | 1,972,260 | 39,662,148.60 | 0.17% |
| 71 | 000538 | 云南白药 | 1,063,090 | 36,867,961.20 | 0.16% |
| 72 | 002008 | 华兰生物 | 663,563 | 35,361,272.27 | 0.15% |
| 73 | 600415 | 小商品城 | 400,000 | 34,636,000.00 | 0.15% |
| 74 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,010,380 | 32,897,972.80 | 0.14% |
| 75 | 601169 | 北京银行 | 1,590,760 | 32,387,873.60 | 0.14% |
| 76 | 000501 | 鄂武商A | 1,526,361 | 28,466,632.65 | 0.12% |
| 77 | 600267 | 海正药业 | 1,590,584 | 28,455,547.76 | 0.12% |
| 78 | 600026 | 中海发展 | 768,400 | 28,446,168.00 | 0.12% |
| 79 | 601808 | 中海油服 | 827,000 | 28,399,180.00 | 0.12% |
| 80 | 600383 | 金地集团 | 684,332 | 27,920,745.60 | 0.12% |
| 81 | 600997 | 开滦股份 | 630,908 | 27,696,861.20 | 0.12% |
| 82 | 000063 | 中兴通讯 | 400,000 | 25,476,000.00 | 0.11% |
| 83 | 000513 | 丽珠集团 | 538,050 | 23,028,540.00 | 0.10% |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|---------------|-------|
| 84 | 600332 | 广州药业 | 1,314,953 | 22,459,397.24 | 0.10% |
| 85 | 000527 | 美的电器 | 570,250 | 21,161,977.50 | 0.09% |
| 86 | 600596 | 新安股份 | 300,175 | 20,150,747.75 | 0.09% |
| 87 | 600082 | 海泰发展 | 1,200,000 | 19,176,000.00 | 0.08% |
| 88 | 600075 | 新疆天业 | 1,000,000 | 18,870,000.00 | 0.08% |
| 89 | 601001 | 大同煤业 | 483,967 | 15,486,944.00 | 0.07% |
| 90 | 600631 | 百联股份 | 650,000 | 14,963,000.00 | 0.06% |
| 91 | 600016 | 民生银行 | 1,000,000 | 14,820,000.00 | 0.06% |
| 92 | 002029 | 七匹狼 | 477,565 | 12,922,908.90 | 0.06% |
| 93 | 600327 | 大厦股份 | 802,511 | 11,315,405.10 | 0.05% |
| 94 | 002092 | 中泰化学 | 291,291 | 11,098,187.10 | 0.05% |
| 95 | 000800 | 一汽轿车 | 487,982 | 9,320,456.20 | 0.04% |
| 96 | 000869 | 张裕A | 108,308 | 9,271,164.80 | 0.04% |
| 97 | 600261 | 浙江阳光 | 473,030 | 8,509,809.70 | 0.04% |
| 98 | 600282 | 南钢股份 | 396,107 | 8,215,259.18 | 0.04% |
| 99 | 000667 | 名流置业 | 550,000 | 7,997,000.00 | 0.03% |
| 100 | 601918 | 国投新集 | 445,632 | 7,094,461.44 | 0.03% |
| 101 | 600738 | 兰州民百 | 628,000 | 6,405,600.00 | 0.03% |
| 102 | 600859 | 王府井 | 114,209 | 5,766,412.41 | 0.02% |
| 103 | 002202 | 金风科技 | 40,866 | 5,739,629.70 | 0.02% |
| 104 | 600737 | 中粮屯河 | 180,069 | 3,446,520.66 | 0.01% |
| 105 | 600479 | 千金药业 | 73,412 | 3,209,572.64 | 0.01% |
| 106 | 002194 | 武汉凡谷 | 57,501 | 2,984,876.91 | 0.01% |
| 107 | 002176 | 江特电机 | 47,222 | 1,656,547.76 | 0.01% |
| 108 | 600280 | 南京中商 | 72,800 | 1,589,224.00 | 0.01% |
| 109 | 002183 | 怡亚通 | 20,376 | 1,588,309.20 | 0.01% |
| 110 | 002175 | 广陆数测 | 39,000 | 1,372,800.00 | 0.01% |
| 111 | 002186 | 全聚德 | 18,259 | 1,077,828.77 | 0.00% |
| 112 | 002182 | 云海金属 | 32,956 | 920,461.08 | 0.00% |
| 113 | 002187 | 广百股份 | 19,759 | 849,439.41 | 0.00% |
| 114 | 002179 | 中航光电 | 17,146 | 786,144.10 | 0.00% |
| 115 | 002185 | 华天科技 | 33,697 | 722,463.68 | 0.00% |
| 116 | 002177 | 御银股份 | 10,305 | 700,740.00 | 0.00% |
| 117 | 000680 | 山推股份 | 35,980 | 699,811.00 | 0.00% |
| 118 | 600549 | 厦门钨业 | 20,000 | 563,400.00 | 0.00% |
| 119 | 002201 | 九鼎新材 | 14,676 | 467,724.12 | 0.00% |
| 120 | 002184 | 海得控制 | 16,852 | 387,764.52 | 0.00% |
| 121 | 002189 | 利达光电 | 24,710 | 363,237.00 | 0.00% |
| 122 | 002181 | 粤传媒 | 12,421 | 331,392.28 | 0.00% |
| 123 | 002190 | 成飞集成 | 14,098 | 298,313.68 | 0.00% |
| 124 | 002167 | 东方锆业 | 6,482 | 257,400.22 | 0.00% |
| 125 | 002178 | 延华智能 | 10,994 | 255,060.80 | 0.00% |
| 126 | 002199 | 东晶电子 | 9,645 | 245,947.50 | 0.00% |



| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|------------|-------|
| 127 | 002196 | 方正电机 | 9,880 | 240,874.40 | 0.00% |
| 128 | 002188 | 新嘉联 | 11,180 | 239,922.80 | 0.00% |
| 129 | 002195 | 海隆软件 | 6,796 | 223,316.56 | 0.00% |

(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末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|------------------|--------------|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 1,402,453,884.11 | 6.00% |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 1,400,744,416.49 | 5.99% |
| 3 | 000069 | 华侨城A | 1,024,511,640.26 | 4.38% |
| 4 | 000002 | 万科A | 997,634,835.09 | 4.27% |
| 5 | 601919 | 中国远洋 | 887,268,485.97 | 3.80% |
| 6 | 600000 | 浦发银行 | 802,505,804.82 | 3.43% |
| 7 | 601318 | 中国平安 | 579,761,533.53 | 2.48% |
| 8 | 000060 | 中金岭南 | 479,755,740.90 | 2.05% |
| 9 | 000157 | 中联重科 | 479,339,099.47 | 2.05% |
| 10 | 601166 | 兴业银行 | 446,819,333.86 | 1.91% |
| 11 | 600009 | 上海机场 | 417,852,221.71 | 1.79% |
| 12 | 601111 | 中国国航 | 393,697,368.78 | 1.68% |
| 13 | 600276 | 恒瑞医药 | 378,193,996.67 | 1.62% |
| 14 | 000951 | 中国重汽 | 369,104,464.97 | 1.58% |
| 15 | 600150 | 中国船舶 | 367,956,715.49 | 1.57% |
| 16 | 600348 | 国阳新能 | 363,884,109.52 | 1.56% |
| 17 | 601088 | 中国神华 | 352,525,057.20 | 1.51% |
| 18 | 000878 | 云南铜业 | 343,738,938.87 | 1.47% |
| 19 | 000612 | 焦作万方 | 331,929,685.37 | 1.42% |
| 20 | 601699 | 潞安环能 | 326,426,355.10 | 1.40% |

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期末基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|----------------|--------------|
| 1 | 600150 | 中国船舶 | 374,658,452.60 | 1.60% |
| 2 | 600028 | 中国石化 | 271,669,246.19 | 1.16% |
| 3 | 000878 | 云南铜业 | 256,122,085.08 | 1.10% |
| 4 | 600005 | 武钢股份 | 200,251,653.45 | 0.86% |
| 5 | 600030 | 中信证券 | 184,996,061.53 | 0.79% |
| 6 | 600019 | 宝钢股份 | 160,215,179.50 | 0.69% |
| 7 | 601111 | 中国国航 | 157,391,740.82 | 0.67% |
| 8 | 000338 | 潍柴动力 | 150,078,292.92 | 0.64% |
| 9 | 601919 | 中国远洋 | 114,837,192.59 | 0.49% |
| 10 | 601857 | 中国石油 | 103,327,175.30 | 0.44% |
| 11 | 601166 | 兴业银行 | 98,515,500.15 | 0.42% |
| 12 | 000717 | 韶钢松山 | 97,735,630.80 | 0.42% |



| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 13 | 000898 | 鞍钢股份 | 92,814,093.04 | 0.40% |
| 14 | 000039 | 中集集团 | 88,333,313.01 | 0.38% |
| 15 | 601398 | 工商银行 | 86,906,891.64 | 0.37% |
| 16 | 600036 | 招商银行 | 68,336,150.46 | 0.29% |
| 17 | 600219 | 南山铝业 | 65,267,081.55 | 0.28% |
| 18 | 601001 | 大同煤业 | 63,639,573.79 | 0.27% |
| 19 | 601390 | 中国中铁 | 59,614,324.93 | 0.25% |
| 20 | 000983 | 西山煤电 | 45,723,749.50 | 0.20% |

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 | 19,380,832,675.44 |
| 卖出股票的收入总额 | 3,327,318,457.36 |

(五) 债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|----|------|----------------|---------|
| 1 | 央行票据 | 836,392,000.00 | 3.58% |
| 2 | 国家债券 | 99,570,000.00 | 0.43% |
| 3 | 企业债券 | 1,269,424.00 | 0.01% |
| | 合计 | 937,231,424.00 | 4.01% |

(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 | 0701136 | 07 央票 136 | 3,000,000 | 288,420,000.00 | 1.23% |
| 2 | 0701025 | 07 央票 25 | 2,400,000 | 232,896,000.00 | 1.00% |
| 3 | 0701141 | 07 央票 141 | 2,000,000 | 198,340,000.00 | 0.85% |
| 4 | 0701004 | 07 央票 04 | 1,200,000 | 116,736,000.00 | 0.50% |
| 5 | 010709 | 07 国债 09 | 1,000,000 | 99,570,000.00 | 0.43% |

(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 | 权证数量(份) | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|----|--------|---------|---------|------------|---------|
| 1 | 580016 | 上汽 CWB1 | 63,648 | 578,286.63 | 0.00% |

(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）的市场收盘价计算，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 | 6,243,503.58 |
| 2 | 权证交易保证金 | 101,282.05 |
| 3 | 应收利息 | 12,158,911.76 |
| 4 | 应收证券清算款 | 26,173,981.95 |
| 5 | 应收申购款 | 349,017.67 |
| | 合计 | 45,026,697.01 |

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(份) | 成本总额(元) | 获得途径 |
|----|--------|---------|-----------|----------------|----------|
| 1 | 031001 | 侨城 HQC1 | 4,321,581 | 227,656,763.24 | 二级市场买入 |
| 2 | 580009 | 伊利 CWB1 | 1,955,655 | 51,919,678.35 | 二级市场买入 |
| 3 | 580016 | 上汽 CWB1 | 63,648 | 552,381.43 | 申购上汽转债获赠 |

十、原安久证券投资基金投资组合报告

(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 | 1,036,596,371.35 | 91.38% |
| 2 | 债券 | 29,981,000.00 | 2.64% |
| 3 | 权证 | 21,230,000.00 | 1.87% |
| 4 | 银行存款和清算备付金 | 31,161,713.31 | 2.75% |
| 5 | 其它资产 | 15,395,152.14 | 1.36% |
| | 合计 | 1,134,364,236.80 | 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 | 449,219,501.03 | 39.78% |

| | | | |
|----|-------------|-------------------------|---------------|
| C0 | 食品、饮料 | 37,818,326.22 | 3.35% |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 105,704,200.64 | 9.36% |
| C6 | 金属、非金属 | 119,645,540.00 | 10.59% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 97,991,944.48 | 8.68% |
| C8 | 医药、生物制品 | 88,059,489.69 | 7.80% |
| F | 交通运输、仓储业 | 91,939,934.88 | 8.14% |
| H | 批发和零售贸易 | 71,011,938.30 | 6.29% |
| I | 金融、保险业 | 220,987,316.82 | 19.57% |
| J | 房地产业 | 131,994,117.00 | 11.69% |
| K | 社会服务业 | 21,638,781.20 | 1.92% |
| M | 综合类 | 49,804,782.12 | 4.41% |
| | 合 计 | 1,036,596,371.35 | 91.78% |

(三) 基金投资股票明细

| 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 | 3,864,687 | 112,655,626.05 | 9.98% |
| 2 | 000002 | 万 科A | 3,008,080 | 86,331,896.00 | 7.64% |
| 3 | 600309 | 烟台万华 | 2,063,520 | 77,794,704.00 | 6.89% |
| 4 | 600219 | 南山铝业 | 2,575,900 | 71,094,840.00 | 6.30% |
| 5 | 000951 | 中国重汽 | 1,301,549 | 71,064,575.40 | 6.29% |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,520,517 | 65,382,231.00 | 5.79% |
| 7 | 600009 | 上海机场 | 1,672,152 | 65,280,814.08 | 5.78% |
| 8 | 601318 | 中国平安 | 777,219 | 62,278,558.47 | 5.51% |
| 9 | 002024 | 苏宁电器 | 1,070,400 | 54,547,584.00 | 4.83% |
| 10 | 600858 | 银座股份 | 1,590,191 | 49,804,782.12 | 4.41% |
| 11 | 000039 | 中集集团 | 1,550,000 | 45,260,000.00 | 4.01% |
| 12 | 600519 | 贵州茅台 | 300,074 | 37,818,326.22 | 3.35% |
| 13 | 000024 | 招商地产 | 602,561 | 36,756,221.00 | 3.25% |
| 14 | 601628 | 中国人寿 | 724,710 | 34,155,582.30 | 3.02% |
| 15 | 000792 | 盐湖钾肥 | 723,794 | 27,909,496.64 | 2.47% |
| 16 | 002008 | 华兰生物 | 552,969 | 22,677,258.69 | 2.01% |
| 17 | 000069 | 华侨城A | 430,280 | 21,638,781.20 | 1.92% |
| 18 | 600786 | 东方锅炉 | 310,000 | 19,526,900.00 | 1.73% |
| 19 | 600026 | 中海发展 | 730,000 | 18,359,500.00 | 1.63% |
| 20 | 000061 | 农 产 品 | 751,797 | 16,464,354.30 | 1.46% |
| 21 | 600383 | 金地集团 | 200,000 | 8,906,000.00 | 0.79% |
| 22 | 601006 | 大秦铁路 | 549,280 | 8,299,620.80 | 0.73% |
| 23 | 600000 | 浦发银行 | 150,000 | 6,058,500.00 | 0.54% |
| 24 | 601166 | 兴业银行 | 140,700 | 5,839,050.00 | 0.52% |
| 25 | 600150 | 中国船舶 | 30,000 | 4,646,700.00 | 0.41% |
| 26 | 000878 | 云南铜业 | 70,000 | 3,290,700.00 | 0.29% |
| 27 | 600686 | 金龙汽车 | 84,914 | 2,061,711.92 | 0.18% |
| 28 | 000338 | 潍柴动力 | 8,758 | 692,057.16 | 0.06% |



(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 | 600036 | 招商银行 | 80,986,682.69 | 8.03% |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 79,905,598.91 | 7.93% |
| 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 | 000002 | 万科A | 32,277,396.41 | 3.20% |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 31,894,742.36 | 3.16% |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 31,484,852.10 | 3.12% |
| 11 | 600739 | 辽宁成大 | 30,228,660.41 | 3.00% |
| 12 | 600858 | 银座股份 | 27,048,274.76 | 2.68% |
| 13 | 000623 | 吉林敖东 | 26,348,733.02 | 2.61% |
| 14 | 000039 | 中集集团 | 24,452,682.36 | 2.43% |
| 15 | 600019 | 宝钢股份 | 24,220,875.42 | 2.40% |
| 16 | 000061 | 农产品 | 21,246,362.42 | 2.11% |
| 17 | 000069 | 华侨城A | 20,126,472.07 | 2.00% |
| 18 | 600428 | 中远航运 | 18,514,422.89 | 1.84% |
| 19 | 600519 | 贵州茅台 | 16,066,801.80 | 1.59% |
| 20 | 601166 | 兴业银行 | 14,149,530.77 | 1.40% |

| 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 | 120,674,514.76 | 11.97% |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 111,796,673.86 | 11.09% |
| 3 | 600739 | 辽宁成大 | 76,717,660.09 | 7.61% |
| 4 | 000825 | 太钢不锈 | 75,993,215.64 | 7.54% |
| 5 | 600761 | 安徽合力 | 69,238,447.35 | 6.87% |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 59,290,563.39 | 5.88% |
| 7 | 000951 | 中国重汽 | 58,179,429.22 | 5.77% |
| 8 | 600309 | 烟台万华 | 43,481,265.07 | 4.31% |
| 9 | 601318 | 中国平安 | 42,803,177.49 | 4.25% |
| 10 | 000024 | 招商地产 | 38,805,282.43 | 3.85% |
| 11 | 600271 | 航天信息 | 36,220,829.56 | 3.59% |
| 12 | 000402 | 金融街 | 36,030,353.81 | 3.57% |
| 13 | 000623 | 吉林敖东 | 34,435,404.87 | 3.42% |
| 14 | 600583 | 海油工程 | 34,090,608.94 | 3.38% |
| 15 | 600456 | 宝钛股份 | 30,773,831.27 | 3.05% |
| 16 | 000869 | 张裕A | 28,875,745.91 | 2.86% |



| | | | | |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 17 | 600028 | 中国石化 | 26,151,357.67 | 2.59% |
| 18 | 600019 | 宝钢股份 | 24,692,709.60 | 2.45% |
| 19 | 600276 | 恒瑞医药 | 23,745,570.00 | 2.36% |
| 20 | 000002 | 万科A | 22,180,787.80 | 2.20% |

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 | 902,294,631.22 |
| 卖出股票的收入总额 | 1,320,663,697.63 |

(五) 债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|----|----------|---------------|---------|
| 1 | 国家政策金融债券 | 29,981,000.00 | 2.65% |
| | 合计 | 29,981,000.00 | 2.65% |

(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 | 050415 | 05 农发 15 | 200,000 | 19,948,000.00 | 1.77% |
| 2 | 040217 | 04 国开 17 | 100,000 | 10,033,000.00 | 0.89% |

(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 | 权证数量份) | 市值(元) | 占资产净值比例 |
|----|--------|---------|---------|---------------|---------|
| 1 | 031001 | 侨城 HQC1 | 550,000 | 21,230,000.00 | 1.88% |

(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）的市场收盘价计算，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 | 应收证券清算款 | 13,909,446.54 |
| 4 | 应收利息 | 491,306.36 |
| 5 | 应收股利 | 143,117.19 |
| | 合计 | 15,395,152.14 |

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(份) | 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 |

十一、基金份额持有人户数和持有人结构

(一) 华安策略优选股票型证券投资基金

截至 2007 年 12 月 31 日基金份额持有人户数和持有人结构

| | | |
|---------------------|-------------------|----------------|
| 基金份额持有人户数 | 2,004,440 户 | |
| 平均每户持有基金份额 | 11,116.61 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 | 640,440,151.26 | 2.87% |
| 个人投资者持有的基金份额 | 21,642,146,160.89 | 97.13% |
| 其中： | | |
| 基金管理公司所有从业人员持有的基金份额 | 22,632.47 | 0.00% |

(二) 原安久证券投资基金

截至 2007 年 8 月 1 日基金份额持有人户数和持有人结构

| | | |
|--------------|----------------|----------------|
| 基金份额持有人户数 | 14,983 户 | |
| 平均每户持有基金份额 | 33,371 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 | 292,026,946.00 | 58.41% |



个人投资者持有的基金份额 207,973,054.00 41.59%

前十名持有人的名称

| 序号 | 项目 | 份额(份) | 占总份额的比例 |
|----|-------------------------|------------|---------|
| 1 | 中国太平洋保险(集团)股份有限公司 | 35,125,492 | 7.03% |
| 2 | 中国人寿保险(集团)公司 | 33,045,894 | 6.61% |
| 3 | 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% |
| 4 | 新华人寿保险股份有限公司 | 25,098,135 | 5.02% |
| 5 | 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% |
| 6 | 中国人寿保险股份有限公司 | 17,710,818 | 3.54% |
| 7 | 宝钢集团有限公司 | 13,927,901 | 2.79% |
| 8 | 泰康人寿保险股份有限公司 | 13,854,618 | 2.77% |
| 9 | 民生人寿保险股份有限公司 | 10,801,997 | 2.16% |
| 10 | 华安基金管理有限公司 | 9,582,100 | 1.92% |

十二、开放式基金份额变动

| 序号 | 项目 | 份额(份) |
|----|----------------|-------------------|
| 1 | 基金合同生效日的基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 2 | 期初基金份额总额 | 500,000,000.00 |
| 3 | 加:本期申购基金份额总额 | 24,207,221,110.29 |
| 4 | 其中:基金拆分折算份额总额 | 768,167,568.49 |
| 5 | 申购份额总额 | 23,439,053,541.80 |
| 6 | 减:本期赎回基金份额总额 | 2,424,634,798.14 |
| 7 | 期末基金份额总额 | 22,282,586,312.15 |

十三、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：

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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。

本基金管理人于 2008 年 2 月 13 日发布公告：关于基金经理调整的公告，鲍泓先生不再担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理，聘任张伟先生、邓跃辉先生为华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

基金托管人交通银行于 2007 年 10 月 19 日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》，交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2007 年 10 月 19 日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

2007 年 12 月 21 日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》，谷娜莎同志担任交通银行资产托管部总经理，主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在 2007 年 12 月 21 日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》。

(三) 本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(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。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况: 140,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限: 自 2007 年 6 月 5 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: 无。

(八) 本报告期间租用证券公司交易单元情况如下:

1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

新增交易单元:

| 券商名称 | 上交所交易单元数 | 深交所交易单元数 |
|--------------|----------|----------|
| 齐鲁证券有限公司 | 1 | |
| 国金证券有限责任公司 | 1 | |
| 中银国际证券有限责任公司 | | 1 |

退租交易单元:

| 券商名称 | 上交所交易单元数 | 深交所交易单元数 |
|------|----------|----------|
| | | |

2. 交易成交量及佣金情况:

(1). 华安优选股票交易情况:

| 券商名称 | 租用交易单元数量 | 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 | 2,382,973,150.42 | 11.11% | 1,944,617.06 | 11.23% |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | 2,546,310,347.23 | 11.87% | 1,992,500.10 | 11.51% |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | 1,931,457,641.05 | 9.00% | 1,511,371.01 | 8.73% |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 1,058,721,437.05 | 4.94% | 868,149.50 | 5.01% |
| 平安证券有限责任公司 | 1 | 2,247,155,299.04 | 10.48% | 1,842,665.80 | 10.64% |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | 2,619,955,991.59 | 12.21% | 2,146,933.51 | 12.40% |
| 国金证券有限责任公司 | 1 | 5,741,938,442.59 | 26.77% | 4,708,383.53 | 27.19% |
| 联合证券有限责任公司 | 1 | 2,521,303,900.83 | 11.75% | 1,972,926.69 | 11.39% |
| 齐鲁证券有限公司 | 1 | 398,988,788.61 | 1.86% | 327,169.72 | 1.89% |
| 合计 | 10 | 21,448,804,998.41 | 100.00% | 17,314,716.92 | 100.00% |

(2). 华安优选债券、回购及权证交易情况:



| 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% | 51,919,678.35 | 18.57% |
| 光大证券股份有限公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 7,626,044.30 | 2.73% |
| 中银国际证券有限责任公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 89,347,218.90 | 31.96% |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 平安证券有限责任公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 申银万国证券股份有限公司 | 0.00 | 0.00% | 285,000,000.00 | 100.00% | 0.00 | 0.00% |
| 国金证券有限责任公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 联合证券有限责任公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 130,683,500.04 | 46.74% |
| 齐鲁证券有限公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 0.00 | 0.00% | 285,000,000.00 | 100.00% | 279,576,441.59 | 100.00% |

(3). 基金安久股票交易情况:

| 券商名称 | 租用交易单元数量 | 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 | 5.12% | 88,054.74 | 5.00% |
| 光大证券股份有限公司 | 1 | 468,985,870.69 | 21.34% | 366,983.20 | 20.85% |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 163,066,155.07 | 7.42% | 132,025.21 | 7.50% |
| 平安证券有限责任公司 | 1 | 1,169,470,749.07 | 53.22% | 947,592.76 | 53.84% |
| 申银万国证券股份有限公司 | 1 | 162,964,642.80 | 7.42% | 131,152.72 | 7.45% |
| 联合证券有限责任公司 | 1 | 120,293,750.31 | 5.47% | 94,130.52 | 5.35% |
| 合计 | 7 | 2,197,310,709.59 | 100.00% | 1,759,939.15 | 100.00% |

(4). 基金安久债券、回购及权证交易情况:

| 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 | 1.69% | 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 | 2.05% | 316,000,000.00 | 12.19% | 391,083.40 | 0.84% |
| 平安证券有限责任公司 | 453,209,661.60 | 86.56% | 1,852,600,000.00 | 71.46% | 4,393,073.58 | 9.38% |
| 申银万国证券股份有限公司 | 50,790,718.10 | 9.70% | 423,800,000.00 | 16.35% | 3,538,942.75 | 7.56% |
| 联合证券有限责任公司 | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% | 0.00 | 0.00% |
| 合计 | 523,555,308.20 | 100.00% | 2,592,400,000.00 | 100.00% | 46,833,832.67 | 100.00% |

3. 券商专用交易单元选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构, 选用其专用交易单元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信息服务，并能根据基金投资研究的特定要求，提供专题研究报告。

4. 券商专用交易单元选择程序：

(1) 对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交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部等部门汇总对各候选券商的综合评估结果，择优选出拟新增交易单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总审批

公司分管副总对研究发展部等部门提交的《新增交易单元申请审核表》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《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

(九) 其他重要事项：

1. 股权变动：

公告事项

披露日期

- 1) 经华安基金管理有限公司股东会会议审议通过，并经中国证监会 2007 年 11 月 20 日会审核批准（证监基金字[2007]282 号），本公司原股东上海广电（集团）有限公司将其持有的本公司 20% 股权全部转让给上海锦江国际投资管理有限公司。上述股权转让事宜的工商变更登记手续已办理完毕。
- 2) 接我司股东单位上海国际信托投资有限公司通知，经中国银行 2007 年 11 月 20 日业监督管理委员会批准，“上海国际信托投资有限公司”已更名为“上海国际信托有限公司”。目前，我司股东更名事项已经完成工商变更登记。

2. 修改基金合同：

公告事项

披露日期

- 1) 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。



3. 其他事项:

| | 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 年 5 月 25 日 |
| 2) | 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。 | 2007 年 8 月 16 日 |
| 3) | 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。 | 2007 年 8 月 17 日 |
| 4) | 华安策略优选股票型证券投资基金集中申购结果的公告。 | 2007 年 8 月 21 日 |
| 5) | 关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告。 | 2007 年 8 月 21 日 |
| 6) | 华安策略优选股票型证券投资基金份额“确权”登记指引的提示。 | 2007 年 8 月 22 日 |
| 7) | 关于增加中国光大银行为开放式基金代销机构的公告。 | 2007 年 8 月 28 日 |
| 8) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金开放日常申购赎回与基金转换业务的公告。 | 2007 年 9 月 10 日 |
| 9) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金暂停申购和转入业务的公告。 | 2007 年 9 月 18 日 |
| 10) | 关于新增深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告。 | 2007 年 9 月 19 日 |
| 11) | 关于华安基金管理有限公司在深圳发展银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告。 | 2007 年 9 月 19 日 |
| 12) | 关于参加交通银行基金定期定额申购优惠活动的公告。 | 2007 年 9 月 28 日 |
| 13) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告。 | 2007 年 9 月 29 日 |
| 14) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告。 | 2007 年 10 月 13 日 |
| 15) | 关于新增财富证券有限责任公司为华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金和华安策略优选股票型证券投资基金代销机构的公告。 | 2007 年 10 月 17 日 |
| 16) | 关于新增北京银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 | 2007 年 10 月 25 日 |
| 17) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告 | 2007 年 10 月 27 日 |
| 18) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金部分开通基金定期定额投资业务的公告 | 2007 年 10 月 31 日 |
| 19) | 关于新增中信银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 | 2007 年 11 月 6 日 |
| 20) | 关于新增国都证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 | 2007 年 11 月 8 日 |
| 21) | 关于新增宏源证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 | 2007 年 11 月 8 日 |
| 22) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购(定期定额投资除外)和转入业务的提示性公告 | 2007 年 11 月 10 日 |
| 23) | 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购(定期定额投资除外)和转入业务的提示性公告 | 2007 年 11 月 24 日 |



- | | |
|--|------------------|
| 24) 关于在中国邮政储蓄银行开通定期定额投资计划的公告 | 2007 年 12 月 3 日 |
| 25) 关于增加上海银行办理旗下暂停申购基金定期定额投资业务的公告 | 2007 年 12 月 5 日 |
| 26) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2007 年 12 月 8 日 |
| 27) 关于增加中国邮政储蓄银行办理旗下暂停申购基金定期定额投资业务的公告 | 2007 年 12 月 20 日 |
| 28) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2007 年 12 月 22 日 |
| 29) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2008 年 1 月 5 日 |
| 30) 关于新增中国民生银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 | 2008 年 1 月 15 日 |
| 31) 关于参加中国光大银行基金定投优惠推广活动的公告 | 2008 年 1 月 18 日 |
| 32) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2008 年 1 月 19 日 |
| 33) 关于参加建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 2008 年 1 月 25 日 |
| 34) 关于参加建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 2008 年 1 月 28 日 |
| 35) 关于新增安信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 | 2008 年 1 月 31 日 |
| 36) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2008 年 2 月 2 日 |
| 37) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2008 年 2 月 16 日 |
| 38) 关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告 | 2008 年 2 月 25 日 |
| 39) 关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 | 2008 年 3 月 1 日 |
| 40) 关于旗下部分基金参加上海银行基金定期定额申购业务优惠推广活动的公告 | 2008 年 3 月 12 日 |
| 41) 关于华安策略优选股票型证券投资基金重新开放申购和转入业务的公告 | 2008 年 3 月 15 日 |
| 42) 华安策略优选股票型证券投资基金更新的招募说明书（摘要） | 2008 年 3 月 18 日 |
| 43) 关于华安策略优选股票型证券投资基金重新开放申购和转入业务的提示性公告 | 2008 年 3 月 18 日 |
| 44) 关于增加华安策略优选股票型证券投资基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告 | 2008 年 3 月 19 日 |
| 45) 关于在中国工商银行股份有限公司开通华安策略优选股票型证券投资基金定期定额投资计划的公告 | 2008 年 3 月 19 日 |
| 46) 关于新增深圳平安银行为开放式基金代销机构的公告 | 2008 年 3 月 21 日 |
| 47) 关于新增华泰证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 | 2008 年 3 月 24 日 |
| 48) 关于新增华安证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 | 2008 年 3 月 24 日 |
| 49) 关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告 | 2008 年 3 月 24 日 |



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》上或披露在公司网站 www.huaan.com.cn 上。



十四、备查文件目录

- 1、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安策略优选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《安久证券投资基金基金合同》；
- 5、《安久证券投资基金扩募说明书》；
- 6、《安久证券投资基金托管协议》；
- 7、中国证监会批准安久证券投资基金设立的文件；
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 9、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 10、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
2008 年 3 月 27 日