

兴和证券投资基金 2006 年年度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二 七年三月三十一日

重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 3 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料经审计，德勤华永会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。本报告期自 2006 年 1 月 1 日起至 2006 年 12 月 31 日止。

目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况.....	2
(一) 主要财务指标.....	3
(二) 基金净值表现及收益分配情况.....	3
三、管理人报告.....	5
四、托管人报告.....	10
五、审计报告.....	10
六、财务会计报告.....	12
(一) 基金会计报表.....	12
(二) 会计报表附注.....	14
七、投资组合报告.....	28
(一) 报告期末基金资产组合情况.....	28
(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	28
(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	30
(四) 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合.....	50
(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细.....	51
(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细.....	51
(八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证证明细.....	51
(九) 投资组合报告附注.....	51
八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	52
(一) 持有人户数.....	52
(二) 持有人结构.....	52
(三) 前十名持有人.....	52
九、重大事件揭示.....	53
十、备查文件目录.....	56

一、基金简介

(一) 基金基本情况

基金名称：兴和证券投资基金

基金简称：基金兴和

交易代码：500018

基金运作方式：契约型封闭式

基金合同生效日：1999 年 7 月 14 日

报告期末基金份额总额：3,000,000,000 份

基金合同存续期：15 年

基金份额上市交易所：上海证券交易所

基金上市日：1999 年 7 月 30 日

(二) 基金产品说明

基金投资目标：通过指数化投资和积极投资的有机结合，力求基金收益率超越我国证券市场的指数增长率（以沪市综合指数为参考），谋求基金资产长期增值。

基金投资策略：本基金资产在指数化投资、积极投资、债券投资中进行适当分配，谋求较低风险下的稳定收益。

(三) 基金管理人有关情况

基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码：100032

法定代表人：凌新源

信息披露负责人：张弘弢

联系电话：(010) 88066688

传真：(010) 88066566

国际互联网址：<http://www.ChinaAMC.com>

电子邮箱：chinaamc@ChinaAMC.com

(四) 基金托管人有关情况

基金托管人名称：中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）

注册地址：北京市金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

信息披露负责人：尹东

联系电话：(010) 67595104

传真：(010) 66275853

国际互联网址：<http://www.ccb.com>

电子邮箱：yindong@ccb.cn

(五) 信息披露事宜

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 查阅本报告。

本报告在基金管理人和基金托管人的住所有置备，投资者可要求查阅、复制。

(六) 聘请的会计师事务所

法定名称：德勤华永会计师事务所有限公司

注册地址：上海市延安东路 222 号外滩中心 30 楼（邮编:200002）

办公地址：北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层（邮编:100738）

(七) 注册登记机构

注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司

办公地址：上海浦东新区陆家嘴东路 166 号中国保险大厦 36 楼

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

重要提示：下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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一) 主要财务指标

项目	2006 年	2005 年	2004 年
基金本期净收益	1,012,062,273.23 元	-141,131,312.98 元	148,372,667.49 元
基金份额本期净收益	0.3374 元	-0.0470 元	0.0495 元
期末可供分配基金收益	1,050,685,305.01 元	-169,134,195.00 元	-83,520,922.60 元
期末可供分配基金份额收益	0.3502 元	-0.0564 元	-0.0278 元
期末基金资产净值	5,595,229,105.60 元	2,830,865,805.00 元	2,916,479,077.40 元
期末基金份额净值	1.8651 元	0.9436 元	0.9722 元
基金加权平均净值收益率	25.72%	-5.07%	4.53%
本期基金份额净值增长率	97.66%	-2.94%	-7.39%
基金份额累计净值增长率	160.23%	31.66%	35.65%

(二) 基金净值表现及收益分配情况

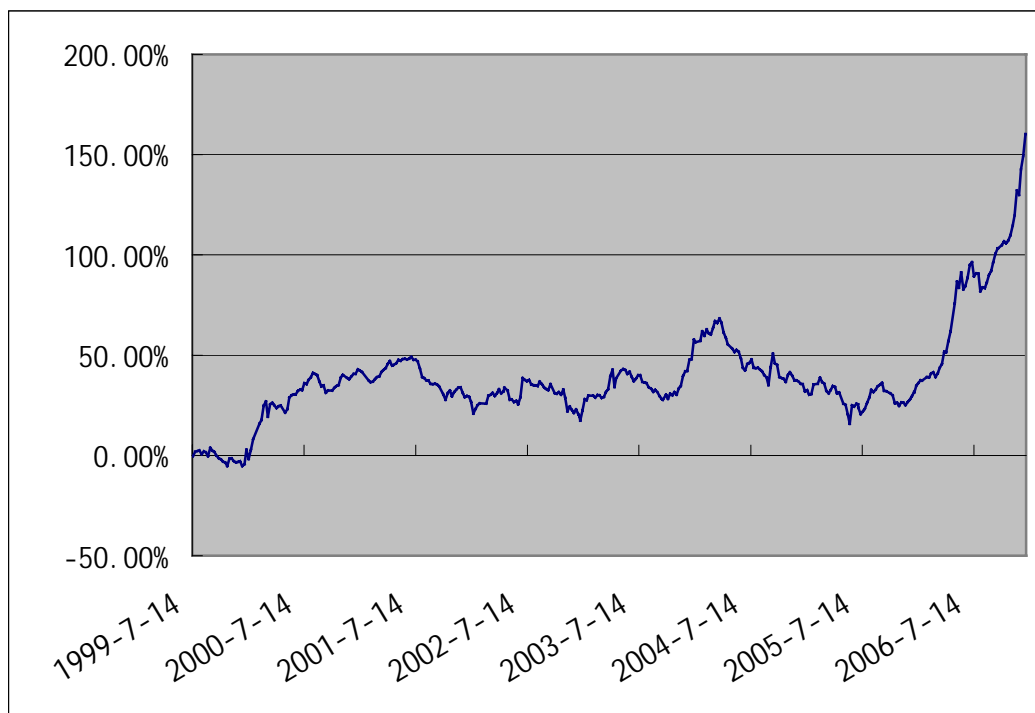
1、基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率	份额净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	-	-
过去三个月	28.01%	2.17%	-	-	-	-
过去六个月	33.51%	2.25%	-	-	-	-
过去一年	97.66%	2.45%	-	-	-	-
过去三年	77.66%	2.36%	-	-	-	-
过去五年	99.81%	2.25%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	160.23%	2.18%	-	-	-	-

2、自基金合同生效以来基金份额净值的变动情况

兴和证券投资基金累计份额净值增长率历史走势图

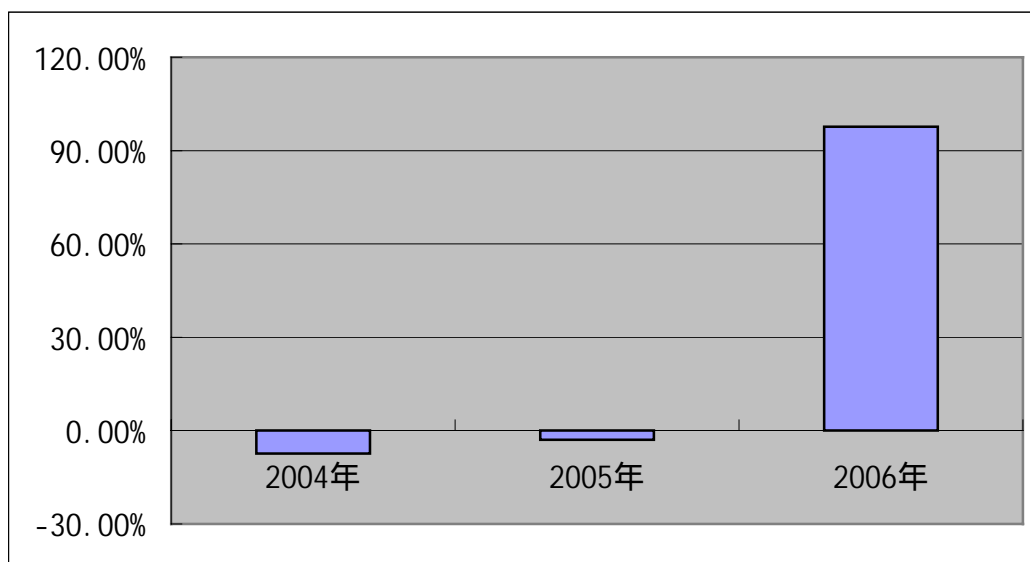
(1999 年 7 月 14 日至 2006 年 12 月 31 日)



注：本基金无业绩比较基准。

3、过往三年基金每年净值增长率的柱形图

兴和证券投资基金过往三年每年净值增长率的柱形图



注：本基金无业绩比较基准。

4、过往三年基金每年的收益分配情况

单位：元

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2006 年	-	-
2005 年	-	-

2004 年	0.960	分配 2003 年度收益
合计	0.960	

三、管理人报告

(一) 基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司。华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准的首批全国性基金管理公司之一，注册资本 13800 万元。公司总部设在北京，在北京、上海和深圳设有分公司。

截至 2006 年 12 月，公司管理资产规模 792 亿元人民币，管理着基金兴华、基金兴和、基金兴科、基金兴安 4 只封闭式基金，华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板 ETF、华夏稳增、华夏回报二号、华夏优势增长 11 只开放式基金，以及亚洲债券基金二期中国子基金和全国社保基金投资组合，是国内管理基金数目最多的基金管理公司，也是管理资产规模最大的基金管理公司之一。

2、基金经理简介

郭树强先生，经济学硕士。1998 年加入华夏基金管理有限公司，历任交易员、兴和证券投资基金基金经理助理（1999 年 7 月至 2000 年 6 月期间）、交易主管和基金评估小组组长、兴华证券投资基金基金经理（2004 年 2 月至 2005 年 4 月期间）。现任兴和证券投资基金基金经理（2002 年 1 月起任职）。

(二) 报告期内基金运作的遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有损害基金持有人利益的行为。

(三) 报告期内基金的业绩表现和投资策略

1、本基金业绩表现

截至 2006 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.8651 元，本报告期份额净值增长率为 97.66%，同期上证综指上涨 130.43%，深圳成指上涨 132.12%。

2、行情回顾及运作分析

2006 年在良好的宏观经济形势和大量新增资金入市的情况下，我国股市出现了历史上罕见的波澜壮阔的牛市行情，使那些长期以来坚持股票投资的投资人获得了丰厚的回报。

2006 年我国经济发展形势良好，众多行业再现了收入、利润快速增长的局面。这是股市走强、走好的坚实基础。由于同样的原因，债券市场表现差强人意，只有可转债有着较好的收益。2006 年温和的宏观经济收缩政策时有出台，但没有使宏观经济和市场行情发生重大改变。

纵观全年，几大类投资机会在不同时期引领行情发展：

(1) 年初最为迅猛的有色股行情。相关企业的利润在价格大幅上涨的带领下成倍增长，前些年被投资者不断抛售的股票大幅反转。

(2) 新生行业变得景气，包括军工、太阳能、电力设备等。以前投资者对这类行业关注较少，突然发现景气度良好，大量资金涌入，股价出现惊人的上涨。

(3) 食品饮料、消费品、旅游、商业等行业的长期成长股持续上涨。得益于经济成长，人们收入水平明显增加，消费升级带动此类行业多年景气。食品饮料行业是消费升级典型受益的行业，品牌创造的壁垒又使企业远离竞争，企业具有不断提升价格的产品定价权。这一行业是近年最具有持续增长能力的行业。

(4) 金融、地产行业快速发展，成为人民币升值直接收益的投资品种，工商银行、中国银行等大市值股票在短时期内价格翻倍，成为了年末靓丽的风景线。其中证券行业更是从地狱中反转，涨幅最为惊人。对于银行股，再融资后提高净资产、按 PB 定价、股价不断提高是背后最主要的“理论支持”。房地产行业在国家不断出台调控政策的同时房价持续大幅上涨，资产价值和利润的大幅上升也就带动了股价的大幅上升。

(5) 钢铁、石化、水泥、机械等周期性行业出现明显转机，股票重新估值，其中包含多只大盘股。在出口不断增长的带动下，本来产能有一定过剩的钢铁、水泥、工程机械等行业产品价格 3、4 季度停止下跌，并有所上升，3 季度的盈利也大幅回升，证券市场也充分反映了这一变化。4 季度钢铁、水泥等周期性行业的公司股价都飞速上涨，成了新一波上涨最主要的力量。

众所周知，在基本面因素之外，充裕的资金面也是 2006 年市场鲜明的特点。顺差带来的外汇盈余继续大幅增长，市场资金充裕。在股票市场持续上涨的情况下，投资者不断把资金投入市场，深沪两市成交量也创下新高。

基金兴和在上半年进行了积极的运作，持续保持了较高股票投资比例，并根据最新的经济形势对行业结构、重点投资对象进行了较大调整。主要增持了商业、电子信息、传媒、医药、食品饮料、服装、有色、机械、军工、房地产等行业，主要减持的行业有交通运输、电力等行业。

下半年基金兴和的操作相对较少，对核心组合稳定持股，保持了在商业、信息技术、医药、传媒、建筑等行业的投资力度，并抓住了一些新的投资机会。少量减持了房地产、机械以及其它一些发展不顺利、收入和利润不如预期的企业。

全年来看，基金兴和在抓住了很多投资机会的同时也有不少遗憾。主要不足体现在年初对宏观经济调控结果估计不足，而持有的稳定类行业过多，付出了较大的机会成本。全年对金融、地产、食品饮料三个重点行业的投资力度不够。下半年对周期性行业的反转也没能大量参与。前者因为过度考虑估值，后者对企业的盈利模式要求过于严格，不够灵活。

3、市场展望和投资策略

在整个经济运行良好，投资者情绪高涨的情况下，2007 年市场仍然有较多机会，同时由于 2006 年的大涨和投资者情绪亢奋，面临的风险也不容小视。

对于具有核心竞争力、管理良好、发展前景广阔、能够不断成长的优秀企业，基金兴和会继续作为核心持有。此外将保持相当的投资力度，仍然看好医药、商业、信息传媒、品牌消费品等行业的长期投资机会。

除了对具有核心竞争力的企业进行长期投资，分享其成长之外，2007 年市场还会有各种灵活的投资机会，包括：

一是管理层激励顺利完成带来的投资机会。在管理者和投资者利益机制更加协调的情况下，企业的管理水平可能提升，由此带来企业更好的发展，超过原有预期。

二是资产重组带来的投资机会。股权分置完成后，大股东有动力整合所有资源，将相关资产通过定向增发等形式注入上市公司。一些股价多倍上涨的成功案例更会刺激投资者的神经，对这种机会全心向往。这类机会当然也包括借壳上市

的情况。

三是每年都会发生的新兴事物所带来的投资机会。其中包括以前市场没有足够重视的行业出现了新的景气成长（例如炸药、软件外包行业），新的行业进入资本市场（例如信托、保险行业），国家实施新的重大产业政策导致的行业形势发生变化（如燃油税、营业税、土地增值税、物业税、所得税的可能变化），原有行业景气程度发生明显变化（如汽车）等。

最后是在市场总体大幅上涨的情况下，由于投资者的偏好，总有一些行业和企业被低估。这些行业的数据如果继续保持良好或者有事件催化，就会有相当的收益，如 2006 年表现较弱的交通运输行业。

风险控制是基金兴和 2007 年的重要任务。在不断上涨的行情中，赚钱效应使投资者热情高涨。在大量资金推动下，众多股票的价格已经出现严重高估，风险在不断积累，一些股票估值已远远高于长期的合理价值，无论是长期投资回报率还是与国际估值水平相比都是如此。在累积涨幅很高的情况下，如果企业的发展和投资者预期相差较远，会出现业绩和估值双双下降。对过度高估的股票，基金兴和会择机减持。同时继续严格考察企业的盈利变化和竞争能力，通过企业选择来尽量回避可能的波动。

基金兴和将继续遵循华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的宗旨，以持有人利益为第一位，诚实守信，勤奋工作，力争可持续地为投资者获得良好收益。

（四）内部监察报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金持有人利益出发，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内，本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面：

- 1、根据《证券投资基金法》及其配套法规的内容，结合公司实际情况，对监察制度进行了充实和修订，使其内容更全面、具体，更具操作性。
- 2、通过一线部门预警控制，监察部门定期检查、不定期抽查等工作方法，保证了公司所管理的所有基金合法合规运作，未出现重大违规事件，为公司业务

开拓奠定了良好的基础。

3、根据中国证监会颁布的货币市场基金投资短期融资券的有关规定，进一步加强了货币市场基金监察力度，完善了货币市场基金有关控制制度。

4、根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的监督报告，报督察长及证监会。

5、对投资制度执行情况进行了专项稽核，对有关投资管理制度进行了修订。

6、对新《公司法》、《证券法》进行宣传、培训，增强员工合规意识。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，保障了基金持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

（五）为投资人提供的服务

1、向投资者发放普及性基金知识宣传材料

本基金管理人组织专业人员撰写并印制了介绍基金理财知识的宣传资料，并通过销售机构向投资者发放。为了方便投资者，本基金管理人互联网站专门设立知识课堂，供投资者浏览阅读有关普及基金知识的电子文档。另外，为了保证宣传活动的覆盖面，本基金管理人每季度在为投资者邮寄基金账户对账单的同时寄送“客户服务问答”等资料，总结常见的问题，向投资者介绍基金投资业务规则等基本知识。

2、开展“理财 365 活动”，进行面对面的宣传普及工作

本基金管理人与代销机构合作，在全国范围内开展了“理财 365 活动”，截止到 2006 年 12 月 31 日共组织报告会 221 场，活动期间向投资者讲解正确的基金投资理念和基本的基金理财知识，引导投资者树立长期投资理念，帮助投资者选择适合自己风险承受能力的基金产品。此外，本基金管理人还于每月开展网络嘉宾聊天活动，由基金经理在网上与投资者直接沟通、宣传成熟的基金投资理念等。

3、公开风险提示

本基金管理人通过电视台专访、全国 30 余家重点平面媒体宣传、在各门户网站刊登宣传文章等形式，在行业内较早的对投资者进行了风险提示，并在本基金管理人各直销网点专门设置了风险提示公告。

通过上述宣传活动,本基金管理人加强了对投资者的教育,普及了基金知识,对提高投资者的风险意识达到了良好的效果。

四、托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《兴和证券投资基金基金合同》和《兴和证券投资基金托管协议》,托管兴和证券投资基金(以下简称基金兴和)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在基金兴和的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期,按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人-华夏基金管理有限公司在基金兴和投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,发现部分监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整,对基金份额持有人利益未造成损害。

由基金兴和管理人-华夏基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

五、审计报告

德师报(审)(07)第 PB0010 号

兴和证券投资基金全体持有人:

我们审计了后附的兴和证券投资基金(以下简称“兴和基金”)财务报表,包括 2006 年 12 月 31 日的资产负债表,2006 年度的经营业绩表、基金净值变动表和基金收益分配表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《兴和证券投资基金基金合同》编制财务报表是兴和基金的基金管理人华夏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基金管理人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，兴和基金财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《兴和证券投资基金基金合同》编制，在所有重大方面公允反映了兴和基金 2006 年 12 月 31 日的财务状况以及 2006 年度的经营成果、基金净值变动和收益分配情况。

德勤华永会计师事务所有限公司

中国注册会计师

景宜青 罗雪

2007 年 3 月 21 日

六、财务会计报告

(一) 基金会计报表

兴和证券投资基金
2006 年 12 月 31 日资产负债表
(除特别注明外, 金额单位为人民币元)
2006 年 12 月 31 日 2005 年 12 月 31 日

资产	附注	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
银行存款	6a	720,501,697.99	21,865,408.27
清算备付金	6b	19,648,006.69	2,966,788.30
交易保证金	6b	573,546.92	1,118,164.58
应收证券清算款		10,101,895.73	44,549,654.01
应收股利		3,387.83	-
应收利息	6c	8,751,099.13	12,510,730.97
其他应收款	6d	11,281,200.00	80,000.00
股票投资市值		4,426,920,234.67	2,059,975,415.34
其中: 股票投资成本		2,900,361,726.03	2,284,207,543.06
债券投资市值		1,138,032,304.10	695,589,463.74
其中: 债券投资成本		1,121,396,040.19	679,114,562.80
权证投资市值		1,349,028.04	-
其中: 权证投资成本		-	-
资产总计		6,337,162,401.10	2,838,655,625.21
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		276,791,584.76	-
应付管理人报酬		5,531,519.03	2,911,594.70
应付托管费		1,106,303.81	582,318.95
应付佣金	6e	8,966,580.96	3,019,583.88
应付利息		771,664.26	-
其他应付款	6f	1,680,642.68	1,176,322.68
卖出回购证券款		447,000,000.00	-
预提费用	6g	85,000.00	100,000.00
负债合计		741,933,295.50	7,789,820.21
持有人权益			
实收基金	6h	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未实现利得/(损失)	6i	1,544,543,800.59	(207,757,226.78)
未分配收益		1,050,685,305.01	38,623,031.78

持有人权益合计	5,595,229,105.60	2,830,865,805.00
(2006 年末每份基金份额净值：1.8651 元)		
(2005 年末每份基金份额净值：0.9436 元)		
负债及持有人权益总计	6,337,162,401.10	2,838,655,625.21

兴和证券投资基金

2006 年度经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

	附注	2006 年度	2005 年度
收入/(损失)			
股票差价收入/(损失)	6j	904,650,209.82	(182,768,430.26)
债券差价收入	6k	7,084,439.58	9,465,348.50
权证差价收入	6l	87,661,592.87	9,540,540.45
债券利息收入		22,503,281.61	17,855,580.56
存款利息收入		2,178,097.69	1,028,621.14
股利收入		54,590,111.73	46,055,120.36
其他收入	6m	295,983.08	159,204.30
收入/(损失) 合计		1,078,963,716.38	(98,664,014.95)
费用			
基金管理人报酬		(48,564,211.93)	(34,842,810.86)
基金托管费		(9,712,842.36)	(6,968,562.35)
卖出回购证券支出		(8,116,137.13)	(220,906.81)
其他费用	6n	(508,251.73)	(435,018.01)
其中：上市年费		(60,000.00)	(60,000.00)
信息披露费		(240,000.00)	(240,000.00)
审计费用		(85,000.00)	(100,000.00)
费用合计		(66,901,443.15)	(42,467,298.03)
基金净收益/(损失)		1,012,062,273.23	(141,131,312.98)
加：未实现估值增值变动数		1,752,301,027.37	55,518,040.58
基金经营业绩		2,764,363,300.60	(85,613,272.40)
本期基金净收益/(损失)		1,012,062,273.23	(141,131,312.98)
加：年初基金净收益		38,623,031.78	179,754,344.76
可供分配基金净收益		1,050,685,305.01	38,623,031.78
年末未分配基金净收益		1,050,685,305.01	38,623,031.78

兴和证券投资基金
2006 年度基金净值变动表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

	2006 年度	2005 年度
年初基金净值	2,830,865,805.00	2,916,479,077.40
本年经营活动		
基金净收益/(损失)	1,012,062,273.23	(141,131,312.98)
未实现利得	1,752,301,027.37	55,518,040.58
经营活动产生的基金净值变动数	2,764,363,300.60	(85,613,272.40)
本年向基金持有人分配收益	-	-
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	-	-
年末基金净值	5,595,229,105.60	2,830,865,805.00

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 会计报表附注

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

1、基金基本情况

兴和证券投资基金(以下简称“本基金”)是由中信建投证券有限责任公司(原华夏证券股份有限公司)、北京证券有限责任公司、华夏基金管理有限公司共三家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》(于 2004 年 9 月 16 日被废止, 由 2004 年 6 月 1 日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》取代)及其他有关的规定和《兴和证券投资基金基金契约》(于 2004 年 10 月 16 日改为《兴和证券投资基金基金合同》)发起, 经中国证券监督管理委员会证监基金字 1999[19]号文《关于同意设立兴和证券投资基金的批复》批准, 于 1999 年 7 月 14 日发起成立。本基金为契约型封闭式, 存续期为 15 年, 发行规模为 30 亿份基金份额。有关基金设立等文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(99)第 51 号文审核同意, 于 1999 年 7 月 30 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证券监督管理委员会证监基

金字[1999]19 号批文的规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，主要投资于国内依法公开发行、上市的股票、国债。本基金为优化型指数基金。基金的投资分为指数化股票投资、积极股票投资和债券投资三大部分，其中，指数化股票投资部分采用完全复制法以总股本为权重，模拟上证 A 股综合指数，占基金资产的 30% 至 50%；积极股票投资主要投资于成长性好，业绩优良、价格合适的股票。

2、主要会计政策

会计准则及制度

本基金的财务报表按照中华人民共和国颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《兴和证券投资基金基金合同》及适用于基金行业实务操作的会计政策编制。

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。

记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、权证投资和债券投资按附注所述估值原则计价外，其他报表项目均以历史成本计价。

基金资产的估值原则

(1) 上市交易的股票、权证以估值日证券交易所挂牌的该股票、权证均价估值，该日无交易的，以最近交易日均价计算；

(2) 未上市的属于配股、增发的股票以估值日证券交易所提供的同一股票的均价估值，该日无交易的，以最近交易均价计算；未上市的属于首次公开发行的股票、债券以其成本价计算；2006 年 11 月 13 日之前由非公开发行形成的暂时流通受限股票，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；2006 年 11 月 13 日起由非公开发行形成的暂时流通受限股票，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价低于非公开发行股票的成本，按市场交易均价估值，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易均价高于非公开发行股票的初始成本，按两者差价在非公开发行股票锁定期的摊销金额与初始成本之和估

值。

(3) 未上市权证采用公允价值估值；已上市权证以估值日证券交易所提供的该权证均价估值，该日无交易的，以最近交易日均价计算；

(4) 配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按均价高于配股价的差额估值；如果收盘价低于配股价，则估值增值额为零；

(5) 银行间市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值；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。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；

(6) 可分离债中签所获得的债券和权证，在所配权证到账日前，债券按成本估值，权证不予估值；权证到账后至债券与权证上市前，债券和权证以经中国证监会认可的外部独立估值结果进行估值；债券和权证上市后，债券按证券交易所市场流通的债券相同的估值方法估值，权证以估值日证券交易所提供的该权证市场交易均价估值，该日无交易的，以最近交易日市场交易均价计算；

(7) 如有确凿证据表明按上述原则不能客观反映基金资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况，在与基金托管人商议后，按最能反映基金资产公允价值的方法估值；

(8) 实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

(9) 如有新增事项或变更事项，按国家最新规定估值。

证券投资基金成本计价方法

股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出股票于成交日确认股票差价收入。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；债券投资按成交日应

支付的全部价款入账,如果应支付的全部价款中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,不构成债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入。卖出债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

买入银行间市场交易债券于实际支付价款日按实际支付的全部价款入账。如果实际支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日的利息,应作为应收利息单独核算,不构成债券成本。

认购新发行的分离交易可转债于成交日先按支付的全部价款确认为债券投资,后于权证实际取得日按本会计报表附注权证投资中所示的方法单独核算权证成本,并相应调整债券投资成本。

卖出银行间市场交易的债券应于实际收到全部价款时确认债券差价收入。卖出债券的成本按移动加权平均法于成交日结转。

买入央行票据和零息债券视同到期一次还本付息的附息债券。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,按上述会计处理方法核算。

权证投资

被动持有权证

股权分置改革被动持有的获赠权证(不包括配股权证)于确认日记录所获分配的权证数量。

主动投资权证

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交应支付的全部价款入账;卖出权证于成交日确认权证差价收入。出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在实际取得日,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成本。

现金对价

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价冲减该股票投资成本。

收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用

的差额确认。权证差价收入于卖出权证成交日确定，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

股利收入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于除息日确认。

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

费用的确认和计量

基金管理人报酬

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.25% 的年费率逐日计提。基金成立三个月后，如果由于卖出回购证券和现金分红以外的原因造成基金持有现金比例超过基金资产净值的 20%，超过部分不计提基金管理人报酬。

基金托管费

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。

卖出回购证券支出

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为 1.00 元。

未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)。

基金收益分配

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用现金方式，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%，基金当期收益先弥补上一年度亏损后，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，每份基金份额净值不能低于面值。

经宣告的基金分配收益于分红除权日从持有人权益转出。

3、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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[2005]107 号《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项规定如下：

营业税

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。

基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税。

所得税

基金买卖股票、债券的差价收入，自 2004 年 1 月 1 日起继续免征企业所得税；

基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入，由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日起基金从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定代扣代缴个人所得税；

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税和个人所得税。

印花税

自 2005 年 1 月 24 日起，基金买卖股票按照 0.1% 的税率征收印花税。

自 2005 年 6 月 13 日起股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

4、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

5、重大关联方关系及关联交易

(1) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人
中信建投证券有限责任公司(“中信建投”)	基金发起人
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东
北京证券有限责任公司(“北京证券”)	基金发起人、基金管理人的股东
西南证券有限责任公司(“西南证券”)	基金管理人的股东
中国科技证券有限责任公司	基金管理人的股东
北京市国有资产经营有限责任公司	基金管理人的原股东

华夏基金管理有限公司股东及持股比例如下：

持股单位	权益比例
中信证券股份有限公司	40.725%
西南证券有限责任公司	35.725%
北京证券有限责任公司	20%
中国科技证券有限责任公司	3.55%
合计	100%

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

2006 年度

	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		买卖权证成交量		佣金	
	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	佣金	占全年佣金
	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	总量的比例
中信建投	2,488,757,043.84	22.94%	180,718,275.00	13.07%	1,442,100,000.00	13.37%	22,272,251.34	20.32%	2,009,488.63	23.05%
西南证券	1,732,613,406.69	15.97%	-	-	-	-	-	-	1,355,785.16	15.55%
北京证券	-	-	36,490,034.50	2.64%	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,295,657,586.84	11.94%	225,497,475.10	16.31%	5,532,300,000.00	51.28%	25,215,247.41	23.00%	1,039,984.06	11.93%
合计	5,517,028,037.37	50.85%	442,705,784.60	32.02%	6,974,400,000.00	64.65%	47,487,498.75	43.32%	4,405,257.85	50.53%

2005 年度

	买卖股票成交量		买卖债券成交量		债券回购成交量		买卖权证成交量		佣金	
	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	成交量	占全年成交	佣金	占全年佣金
	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	量的比例	人民币元	总量的比例
中信建投	658,108,748.36	12.12%	-	-	-	-	-	-	538,470.08	12.30%
西南证券	614,956,329.01	11.33%	139,662,703.16	7.68%	-	-	-	-	481,212.89	10.99%
北京证券	98,078,972.90	1.81%	197,027,828.40	10.83%	-	-	2,804,291.77	29.39%	78,999.26	1.80%
合计	1,371,144,050.27	25.26%	336,690,531.56	18.51%	-	-	2,804,291.77	29.39%	1,098,682.23	25.09%

上述佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.25% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.25% / 当年天数。

本年本基金的基金管理人报酬情况如下:

	<u>本年累计数</u>
	人民币元
年初余额	2,911,594.70
本年计提数	48,564,211.93
本年支付数	(45,944,287.60)
年末余额	5,531,519.03

2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日止期间本基金需要支付的基金管理费为 34,842,810.86 元。

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

本年本基金的基金托管人报酬情况如下:

	<u>本年累计数</u>
	人民币元
年初余额	582,318.95
本年计提数	9,712,842.36
本年支付数	(9,188,857.50)
年末余额	1,106,303.81

2005 年 1 月 1 日至 2005 年 12 月 31 日止期间本基金需要支付的基金托管费为 6,968,562.35 元。

(5) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，并按银行同业利率计息。基金托管人于 2006 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 720,501,697.99 元(2005 年 12 月 31 日 : 21,865,408.27 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 1,995,745.38 元(2005 年 : 975,509.66 元)。

(6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易

本基金在本年度与基金托管人中国建设银行通过银行间同业市场进行的含回购交易如下：

	2006 年度	2005 年度
卖出回购证券结算金额	736,800,000.00	-
卖出回购证券利息支出	311,810.90	-

(7) 关联方及基金管理公司主要股东的控制机构持有的基金份额

	2006 年 12 月 31 日			
	基金份额数 (份)	占基金总份额比	本期买入份额 (份)	本期卖出份额 (份)
华夏基金管理有限公司	18,328,419	0.61%	8,328,419	-
中信建投证券有限责任公司	10,000,000	0.33%	-	-
北京证券有限责任公司	-	-	-	-
合计	28,328,419	0.94%	8,328,419	-
	2005 年 12 月 31 日			
	基金份额数 (份)	占基金总份额比	本期买入份额 (份)	本期卖出份额 (份)
华夏基金管理有限公司	10,000,000	0.33%	-	-
中信建投证券有限责任公司	10,000,000	0.33%	-	-
北京证券有限责任公司	5,000,000	0.17%	-	-
合计	25,000,000	0.83%	-	-

6、基金会计报表重要项目说明

a、银行存款

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
活期存款	720,501,697.99	21,865,408.27
定期存款	-	-
合计	720,501,697.99	21,865,408.27

b、清算备付金和交易保证金

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
清算备付金		
交易所清算备付金	19,648,006.69	2,966,788.30
合计	19,648,006.69	2,966,788.30

交易保证金		
深圳交易保证金	432,805.92	977,423.58
权证交易保证金	140,741.00	140,741.00
合计	573,546.92	1,118,164.58

c、应收利息

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收债券利息	8,557,375.02	12,496,543.40
应收银行存款利息	183,928.72	12,649.32
应收清算备付金利息	9,725.76	1,468.61
应收权证保证金利息	69.63	69.64
合计	8,751,099.13	12,510,730.97

d、其他应收款

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应收上交所新股申购款	5,711,200.00	-
应收深交所新股申购款	5,565,000.00	-
应收券商费用	5,000.00	5,000.00
应收其他	-	75,000.00
合计	11,281,200.00	80,000.00

e、应付佣金

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
中信建投证券有限责任公司	3,236,292.37	1,226,803.74
西南证券有限责任公司	1,812,998.05	469,212.89
华泰证券有限责任公司	950,006.42	-
国泰君安证券股份有限公司	878,283.23	-
光大证券有限责任公司	876,188.54	-
中信证券股份有限公司	484,915.52	-
兴业证券股份有限公司	362,615.82	89,130.16
国联证券有限责任公司	87,000.95	-
招商证券有限责任公司	78,999.26	78,999.26
南方证券有限责任公司	68,968.57	80,968.57
第一创业证券有限公司	58,903.17	58,903.17
中银国际证券有限公司	36,836.38	-
天同证券有限责任公司	34,572.68	46,572.68
申银万国证券股份有限公司	-	787,870.02
平安证券有限责任公司	-	181,123.39
合计	8,966,580.96	3,019,583.88

f、其他应付款

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
应付股利收入的个人所得税	651,029.68	651,029.68
应付债券利息收入的个人所得税	279,613.00	275,293.00
应付券商席位保证金	750,000.00	250,000.00
合计	1,680,642.68	1,176,322.68

g、预提费用

	2006 年 12 月 31 日	2005 年 12 月 31 日
审计费用	85,000.00	100,000.00
合计	85,000.00	100,000.00

h、实收基金

	2006 年 12 月 31 日	
	基金份额数(份)	基金面值
发起人持有基金份额-非流通部分	10,000,000	10,000,000.00
发起人持有基金份额-可流通部分	18,328,419	18,328,419.00
社会公众持有基金份额	2,971,671,581	2,971,671,581.00
合计	3,000,000,000	3,000,000,000.00
	2005 年 12 月 31 日	
	基金份额数(份)	基金面值
发起人持有基金份额-非流通部分	15,000,000	15,000,000.00
发起人持有基金份额-可流通部分	10,000,000	10,000,000.00
社会公众持有基金份额	2,975,000,000	2,975,000,000.00
合计	3,000,000,000	3,000,000,000.00

根据中国证券监督管理委员会证监基金字[1999]19 号文《关于同意设立兴和证券投资基金的批复》及《兴和证券投资基金基金合同》的规定，基金发起人认购的基金份额，自基金成立之日起一年内不得转让。基金发起人在基金存续期内须持有不少于 1500 万份基金份额，占基金发行规模的 0.5%。

i、未实现利得/(损失)

	股票投资的未实现 估值增值/(减值)	债券投资的未实现 估值增值/(减值)	权证投资未实现 估值增值/(减值)	合计
2005 年 12 月 31 日	(224,232,127.72)	16,474,900.94	-	(207,757,226.78)
本年净变动数	1,750,790,636.36	161,362.97	1,349,028.04	1,752,301,027.37
2006 年 12 月 31 日	1,526,558,508.64	16,636,263.91	1,349,028.04	1,544,543,800.59

j、股票差价收入/(损失)

	2006 年度	2005 年度
卖出股票成交总额	5,737,372,482.84	2,732,563,746.21
减：应付佣金总额	(4,821,523.21)	(2,295,957.62)
减：卖出股票成本总额	(4,827,900,749.81)	(2,913,036,218.85)
股票差价收入/(损失)	904,650,209.82	(182,768,430.26)

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 7,826,731.12 元(2005 年：10,987,383.09 元)，已全额冲减股票投资成本。

k、债券差价收入

	2006 年度	2005 年度
卖出及到期兑付债券结算金额	992,401,287.02	1,367,866,046.63
减：应收利息总额	(19,053,296.03)	(18,015,392.82)
减：卖出及到期兑付债券成本总额	(966,263,551.41)	(1,340,385,305.31)
债券差价收入	7,084,439.58	9,465,348.50

l、权证差价收入

	2006 年度	2005 年度
卖出权证成交总额	109,610,944.71	9,540,540.45
减：卖出权证成本总额	(21,949,351.84)	-
权证差价收入	87,661,592.87	9,540,540.45

m、其他收入

	2006 年度	2005 年度
债券认购手续费返还	290,000.00	115,000.00
印花税返还	5,487.70	21,466.63
新股申购手续费返还	-	16,463.40
配股手续费返还	495.38	-
其他	-	6,274.27
合计	295,983.08	159,204.30

n、其他费用

	2006 年度	2005 年度
信息披露费	240,000.00	240,000.00
审计费用	85,000.00	100,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行费用	38,456.79	9,322.28
交易所回购交易费用	62,684.94	3,225.73
分红手续费	-	-
其他	22,110.00	22,470.00
合计	508,251.73	435,018.01

7、收益分配

本基金 2006 年度及 2005 年度无收益分配事项。

8、流通受限制不能自由转让的基金资产

(1) 流通受限制不能自由转让的股票

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

a、非指数投资部分

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	年末估值总额
000423	S 阿 胶	2006-12-4	13.72	-	-	2,180,000	29,909,600.00
000852	S 江 钻	2006-10-31	12.33	2007-2-27	12.92	7,880,778	97,169,992.74
合计							127,079,592.74

b、指数投资部分

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	年末估值总额
600003	S 东北高	2006-12-18	3.73	2007-1-16	4.03	441,777	1,692,005.91
600039	S 川路桥	2006-11-24	4.92	2007-1-8	3.49	52,632	258,949.44
600081	S 东风科	2006-12-12	3.80	2007-1-10	3.22	26	98.80
600102	S 莱钢	2006-9-20	6.18	2007-1-18	10.00	278,698	1,722,353.64
600115	S 东航	2006-12-8	3.68	2007-1-12	4.22	985	3,624.80
600131	S 岷电	206-12-22	5.05	2007-1-18	4.50	115,873	585,158.65
600133	S 东湖新	2006-12-29	5.19	2007-1-10	5.41	67,630	350,999.70
600157	S 鲁润	2006-12-6	6.09	-	-	41,210	250,968.90
600158	S 中体产	2006-12-15	16.48	2007-2-1	16.90	67,078	1,105,445.44
600211	S 藏药业	2006-12-25	17.20	2007-1-8	17.62	37,503	645,051.60
600239	S 红河	2006-12-28	5.56	-	-	44,357	246,624.92
600258	S 首旅	2006-12-21	18.88	2007-1-18	18.80	79,204	1,495,371.52
600272	S 开开	2006-12-18	4.58	2007-1-10	4.83	56,713	259,745.54
600290	S 苏福马	2006-12-15	15.41	2007-2-1	22.01	48,042	740,327.22
600466	S 迪康	2006-12-28	6.45	2007-1-23	4.90	24,732	159,521.40
600582	S 天地	2006-12-14	25.34	2007-1-15	30.00	61,144	1,549,388.96
600599	S 花炮	2006-9-25	6.03	2007-1-15	6.5	33,547	202,288.41
600644	乐山电力	2006-12-8	5.54	2007-1-5	3.52	57,872	320,610.88
600667	S 太极	2006-12-1	4.03	2007-1-8	3.39	64,802	261,152.06
600701	S 工大新	2006-12-11	3.95	2007-1-8	4.08	57,199	225,936.05
600712	南宁百货	2006-11-23	5.82	2007-1-5	5.10	28,653	166,760.46
600733	S 前锋	2006-11-22	6.38	2007-2-6	6.93	43,798	279,431.24
600757	S 华源发	2006-12-18	2.95	2007-1-10	3.14	84,273	248,605.35
600786	S 东锅	2006-12-20	28.53	2007-2-13	30.35	140,000	3,994,200.00
600806	S 交科技	2006-12-14	7.97	2007-3-7	9.90	42,824	341,307.28
600988	S 宝龙	2006-12-18	4.82	2007-1-19	5.09	1,255	6,049.10
合计							17,111,977.27

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止持有的因获配新股流通受限制股票情况如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数(股)	成本	市值	市值占净值比
公开发行股票									
德棉股份	2006-9-22	2006-10-18	2007-1-18	3.24	5.03	187,094	606,184.56	941,082.82	0.02%
东源电器	2006-9-27	2006-10-18	2007-1-18	7.88	14.05	42,423	334,293.24	596,043.15	0.01%

高新张铜	2006-10-12	2006-10-25	2007-1-25	4.25	9.44	159,378	677,356.50	1,504,528.32	0.03%
雪 莱 特	2006-10-12	2006-10-25	2007-1-25	6.86	18.79	32,558	223,347.88	611,764.82	0.01%
大港股份	2006-11-1	2006-11-16	2007-2-16	5.30	8.64	131,651	697,750.30	1,137,464.64	0.02%
苏州固锔	2006-11-1	2006-11-16	2007-2-16	6.39	10.26	53,560	342,248.40	549,525.60	0.01%
中材科技	2006-11-7	2006-11-20	2007-2-26	8.98	19.52	50,455	453,085.90	984,881.60	0.02%
金 螳 螂	2006-11-6	2006-11-20	2007-2-26	12.80	24.08	36,846	471,628.80	887,251.68	0.02%
栋梁新材	2006-11-7	2006-11-20	2007-2-26	6.36	12.43	64,597	410,836.92	802,940.71	0.01%
孚日股份	2006-11-14	2006-11-24	2007-2-26	6.69	8.62	212,747	1,423,277.43	1,833,879.14	0.03%
海鸥卫浴	2006-11-14	2006-11-24	2007-2-26	8.03	22.42	71,104	570,965.12	1,594,151.68	0.03%
万丰奥威	2006-11-15	2006-11-28	2007-2-28	5.66	7.30	216,380	1,224,710.80	1,579,574.00	0.03%
东方海洋	2006-11-14	2006-11-28	2007-2-28	7.49	11.66	66,640	499,133.60	777,022.40	0.01%
新野纺织	2006-11-21	2006-11-30	2007-3-1	5.19	6.12	376,415	1,953,593.85	2,303,659.80	0.04%
鲁阳股份	2006-11-21	2006-11-30	2007-2-28	11.00	26.95	38,917	428,087.00	1,048,813.15	0.02%
新 海 宜	2006-11-21	2006-11-30	2007-2-28	8.66	13.47	47,619	412,380.54	641,427.93	0.01%
金智科技	2006-11-28	2006-12-8	2007-3-8	14.20	22.16	27,174	385,870.80	602,175.84	0.01%
江苏国泰	2006-11-28	2006-12-8	2007-3-8	8.00	12.08	82,965	663,720.00	1,002,217.20	0.02%
中泰化学	2006-11-28	2006-12-8	2007-3-8	6.60	10.91	206,972	1,366,015.20	2,258,064.52	0.04%
国脉科技	2006-12-6	2006-12-15	2007-3-15	10.10	20.27	21,815	220,331.50	442,190.05	0.01%
网盛科技	2006-12-6	2006-12-15	2007-3-15	14.09	55.84	17,772	250,407.48	992,388.48	0.02%
山河智能	2006-12-12	2006-12-22	2007-3-22	10.00	32.57	51,885	518,850.00	1,689,894.45	0.03%
浔兴股份	2006-12-12	2006-12-22	2007-3-22	5.35	11.98	132,000	706,200.00	1,581,360.00	0.03%
海翔药业	2006-12-13	2006-12-26	2007-3-26	11.56	15.96	81,657	943,954.92	1,303,245.72	0.02%
天康生物	2006-12-13	2006-12-26	2007-3-26	10.86	18.96	40,410	438,852.60	766,173.60	0.01%
广东鸿图	2006-12-20	2006-12-29	2007-3-29	11.41	19.28	34,425	392,789.25	663,714.00	0.01%
冠福家用	2006-12-20	2006-12-29	2007-3-29	5.96	10.85	58,384	347,968.64	633,466.40	0.01%
日照港	2006-9-28	2006-10-17	2007-1-18	4.70	7.18	510,679	2,400,191.30	3,666,675.22	0.07%
大秦铁路	2006-7-26	2006-8-1	2007-2-1	4.95	8.09	2,479,900	12,275,505.00	20,062,391.00	0.36%
工商银行	2006-10-23	2006-10-27	2007-1-29	3.12	6.03	15,983,800	49,869,456.00	96,382,314.00	1.72%
北辰实业	2006-9-28	2006-10-16	2007-1-16	2.40	6.74	2,157,090	5,177,016.00	14,538,786.60	0.26%
中国人寿	2006-12-28	2007-1-9	2007-4-9	18.88	18.88	1,213,750	22,915,600.00	22,915,600.00	0.41%
平煤天安	2006-11-10	2006-11-23	2007-2-26	8.16	10.72	1,265,737	10,328,413.92	13,568,700.64	0.24%
招商轮船	2006-11-23	2006-12-1	2007-3-1	3.71	8.00	2,401,300	8,908,823.00	19,210,400.00	0.34%
中国银行	2006-6-28	2006-7-5	2007-1-5	3.08	5.27	4,843,028	14,916,526.24	25,522,757.56	0.46%
大唐发电	2006-12-12	2006-12-20	2007-3-21	6.68	10.30	243,000	1,623,240.00	2,502,900.00	0.04%
非公开发行股票									
苏宁电器	2006-6-22	2006-6-23	2007-6-21	24.00	44.48	3,000,000	72,000,000.00	133,440,000.00	2.38%
宝新能源	2006-12-28	2006-12-28	2007-12-29	9.50	9.54	1,120,000	10,640,000.00	10,684,800.00	0.19%
合计							228,018,612.69	392,224,226.72	7.00%

(2) 流通受限制不能自由转让的债券：

本基金截至 2006 年 12 月 31 日止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 447,000,000.00 元，于 2007 年 1 月 4 日到期。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，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。

9、资产负债表日后事项

本基金于 2007 年 1 月 12 日发布收益分配公告，以截至 2006 年 12 月 20 日本基金的可分配收益为 990,245,578.05 元为准，向基金持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 1.00 元进行收益分配。

本基金管理人拟定的 2006 年度的末期分红为 648,000,000.00 元，每 10 份基金份额可获得分配收益 2.16 元，年度总收益分配比例为 90.23%。

七、投资组合报告

(一) 报告期末基金资产组合情况

	金额(元)	占总资产比例
股票	4,426,920,234.67	69.86%
债券	1,138,032,304.10	17.96%
权证	1,349,028.04	0.02%
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	740,149,704.68	11.68%
其他资产	30,711,129.61	0.48%
合计	6,337,162,401.10	100.00%

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

1、积极投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	85,936,211.48	1.54%
B	采掘业	88,939,845.89	1.59%
C	制造业	835,718,400.63	14.94%
C0	其中：食品、饮料	142,481,564.83	2.55%
C1	纺织、服装、皮毛	99,901,126.02	1.79%
C2	木材、家具	45,920,000.00	0.82%
C3	造纸、印刷	1,120,035.94	0.02%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	7,666,076.32	0.14%
C5	电子	17,424,505.17	0.31%
C6	金属、非金属	45,914,200.80	0.82%
C7	机械、设备、仪表	150,690,655.38	2.69%
C8	医药、生物制品	323,018,876.17	5.77%

C99	其他制造业	1,581,360.00	0.03%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	34,245,352.80	0.61%
E	建筑业	154,310,370.48	2.76%
F	交通运输、仓储业	108,102,000.00	1.93%
G	信息技术业	369,933,856.79	6.61%
H	批发和零售贸易	506,324,859.02	9.05%
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	26,160,184.20	0.47%
L	传播与文化产业	4,875,097.94	0.09%
M	综合类	456,819,505.36	8.16%
	合计	2,671,365,684.59	47.74%

2、指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	9,676,989.75	0.17%
B	采掘业	252,614,724.23	4.51%
C	制造业	349,715,549.44	6.25%
C0	其中：食品、饮料	42,692,621.39	0.76%
C1	纺织、服装、皮毛	13,568,032.92	0.24%
C2	木材、家具	1,747,163.15	0.03%
C3	造纸、印刷	5,618,490.74	0.10%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	43,050,320.81	0.77%
C5	电子	11,693,025.78	0.21%
C6	金属、非金属	115,978,163.54	2.07%
C7	机械、设备、仪表	82,279,260.54	1.47%
C8	医药、生物制品	28,165,231.53	0.50%
C99	其他制造业	4,923,239.04	0.09%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	92,119,672.65	1.65%
E	建筑业	12,714,499.04	0.23%
F	交通运输、仓储业	162,953,702.47	2.91%
G	信息技术业	39,996,409.61	0.71%
H	批发和零售贸易	37,587,227.28	0.67%
I	金融、保险业	705,653,989.27	12.61%
J	房地产业	40,805,862.94	0.73%
K	社会服务业	21,406,838.74	0.38%
L	传播与文化产业	6,563,692.93	0.12%
M	综合类	23,745,391.73	0.42%
	合计	1,755,554,550.08	31.38%

(三) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

1、积极投资按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占净值比例
1	600271	航天信息	6,883,235	240,982,057.35	4.31%
2	000793	华闻传媒	22,000,000	196,900,000.00	3.52%
3	600694	大商股份	5,752,952	169,827,143.04	3.04%
4	002024	苏宁电器	3,400,000	151,232,000.00	2.70%
5	600895	张江高科	20,672,707	143,882,040.72	2.57%
6	600970	中材国际	4,854,292	140,677,382.16	2.51%
7	000848	承德露露	8,799,099	138,761,791.23	2.48%
8	000538	云南白药	5,400,000	134,730,000.00	2.41%
9	600415	小商品城	1,500,000	114,900,000.00	2.05%
10	600718	东软股份	4,704,211	111,960,221.80	2.00%
11	600269	赣粤高速	12,900,000	108,102,000.00	1.93%
12	000852	S 江 钻	7,880,778	97,169,992.74	1.74%
13	002029	七 匹 狼	4,827,138	93,308,577.54	1.67%
14	600697	欧亚集团	7,877,619	83,266,432.83	1.49%
15	600467	好当家	8,999,948	73,799,573.60	1.32%
16	600062	双鹤药业	8,842,840	68,355,153.20	1.22%
17	600557	康缘药业	7,251,253	67,364,140.37	1.20%
18	600631	百联股份	6,816,435	64,960,625.55	1.16%
19	600337	美克股份	4,000,000	45,920,000.00	0.82%
20	000759	武汉中百	3,906,568	35,354,440.40	0.63%
21	000423	S 阿 胶	2,180,000	29,909,600.00	0.53%
22	000690	宝新能源	2,419,978	29,339,484.30	0.52%
23	600007	中国国贸	2,544,765	26,160,184.20	0.47%
24	002022	科华生物	1,219,688	21,356,736.88	0.38%
25	000983	西山煤电	1,999,936	17,879,427.84	0.32%
26	000550	江铃汽车	1,458,990	17,872,627.50	0.32%
27	600028	中国石化	1,900,000	17,347,000.00	0.31%
28	000937	金牛能源	2,900,000	17,284,000.00	0.31%
29	002076	雪 莱 特	898,083	16,874,979.57	0.30%
30	002085	万丰奥威	2,179,104	15,907,459.20	0.28%
31	600123	兰花科创	776,230	15,408,165.50	0.28%
32	600005	武钢股份	2,350,000	14,969,500.00	0.27%
33	002028	思源电气	468,266	13,809,164.34	0.25%
34	002063	远光软件	1,061,183	13,774,155.34	0.25%
35	002081	金 螳 螂	566,154	13,632,988.32	0.24%
36	600348	国阳新能	755,129	11,153,255.33	0.20%

37	002084	海鸥卫浴	473,611	10,618,358.62	0.19%
38	002088	鲁阳股份	344,917	9,295,513.15	0.17%
39	000860	顺鑫农业	1,128,000	8,730,720.00	0.16%
40	000807	云铝股份	647,300	6,757,812.00	0.12%
41	000933	神火股份	460,270	5,173,434.80	0.09%
42	600900	长江电力	503,166	4,905,868.50	0.09%
43	600037	歌华有线	199,963	4,875,097.94	0.09%
44	000792	盐湖钾肥	199,980	4,781,521.80	0.09%
45	600997	开滦股份	462,378	3,648,162.42	0.07%
46	002097	山河智能	105,885	3,448,674.45	0.06%
47	000858	五粮液	130,000	2,953,600.00	0.05%
48	002069	獐子岛	35,188	2,628,895.48	0.05%
49	002087	新野纺织	376,415	2,303,659.80	0.04%
50	002092	中泰化学	206,972	2,258,064.52	0.04%
51	002083	孚日股份	212,747	1,833,879.14	0.03%
52	002098	浔兴股份	132,000	1,581,360.00	0.03%
53	600177	雅戈尔	175,223	1,513,926.72	0.03%
54	002075	高新张铜	159,378	1,504,528.32	0.03%
55	002099	海翔药业	81,657	1,303,245.72	0.02%
56	002077	大港股份	131,651	1,137,464.64	0.02%
57	600963	岳阳纸业	99,914	1,120,035.94	0.02%
58	600583	海油工程	30,000	1,046,400.00	0.02%
59	002091	江苏国泰	82,965	1,002,217.20	0.02%
60	002095	网盛科技	17,772	992,388.48	0.02%
61	002080	中材科技	50,455	984,881.60	0.02%
62	002102	冠福家用	90,384	980,666.40	0.02%
63	002101	广东鸿图	50,425	972,194.00	0.02%
64	002072	德棉股份	187,094	941,082.82	0.02%
65	600550	天威保变	50,000	914,500.00	0.02%
66	002082	栋梁新材	64,597	802,940.71	0.01%
67	002086	东方海洋	66,640	777,022.40	0.01%
68	002100	天康生物	40,410	766,173.60	0.01%
69	000987	广州友谊	40,000	682,000.00	0.01%
70	002089	新海宜	47,619	641,427.93	0.01%
71	002090	金智科技	27,174	602,175.84	0.01%
72	002074	东源电器	42,423	596,043.15	0.01%
73	000822	山东海化	120,000	578,400.00	0.01%
74	002079	苏州固锝	53,560	549,525.60	0.01%
75	002052	同洲电子	26,000	539,240.00	0.01%
76	002093	国脉科技	21,815	442,190.05	0.01%
77	600096	云天化	3,500	48,090.00	0.00%

2、指数投资按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末市值(元)	占净值比例
1	600016	民生银行	21,513,072	217,712,288.64	3.89%
2	600028	中国石化	22,394,664	204,463,282.32	3.65%
3	601988	中国银行	30,686,056	161,715,515.12	2.89%
4	600036	招商银行	7,717,904	125,261,581.92	2.24%
5	601398	工商银行	19,383,800	116,884,314.00	2.09%
6	600000	浦发银行	2,200,923	46,175,364.54	0.83%
7	600900	长江电力	4,253,499	41,471,615.25	0.74%
8	601111	中国国航	8,000,000	40,880,000.00	0.73%
9	600019	宝钢股份	4,728,749	40,288,941.48	0.72%
10	601006	大秦铁路	3,352,467	27,121,458.03	0.48%
11	601628	中国人寿	1,213,750	22,915,600.00	0.41%
12	600519	贵州茅台	254,899	22,380,132.20	0.40%
13	600018	上港集团	3,220,474	22,092,451.64	0.39%
14	601872	招商轮船	2,401,300	19,210,400.00	0.34%
15	600050	中国联通	3,600,000	16,812,000.00	0.30%
16	600005	武钢股份	2,442,495	15,558,693.15	0.28%
17	600011	华能国际	2,375,086	15,224,301.26	0.27%
18	601588	北辰实业	2,157,090	14,538,786.60	0.26%
19	600015	华夏银行	1,901,830	13,997,468.80	0.25%
20	601666	平煤天安	1,265,737	13,568,700.64	0.24%
21	600009	上海机场	506,998	9,709,011.70	0.17%
22	600688	S 上石化	1,292,851	7,951,033.65	0.14%
23	601699	潞安环能	478,137	7,702,787.07	0.14%
24	600583	海油工程	206,078	7,188,000.64	0.13%
25	600320	振华港机	586,009	6,914,906.20	0.12%
26	600585	海螺水泥	220,863	6,619,264.11	0.12%
27	600104	上海汽车	802,924	6,535,801.36	0.12%
28	600642	申能股份	818,667	5,976,269.10	0.11%
29	600188	兖州煤业	816,849	5,799,627.90	0.10%
30	600832	东方明珠	495,952	5,673,690.88	0.10%
31	600808	马钢股份	1,198,736	5,370,337.28	0.10%
32	600026	中海发展	520,368	5,302,549.92	0.09%
33	600795	国电电力	825,320	5,100,477.60	0.09%
34	600663	陆家嘴	347,854	4,782,992.50	0.09%
35	600377	宁沪高速	909,367	4,710,521.06	0.08%
36	600362	江西铜业	387,711	4,485,816.27	0.08%
37	600037	歌华有线	174,756	4,260,551.28	0.08%
38	600031	三一重工	126,837	4,093,029.99	0.07%
39	600660	福耀玻璃	276,321	4,050,865.86	0.07%

40	600786	S 东锅	140,000	3,994,200.00	0.07%
41	600694	大商股份	127,515	3,764,242.80	0.07%
42	600970	中材国际	129,522	3,753,547.56	0.07%
43	600177	雅戈尔	430,834	3,722,405.76	0.07%
44	600017	日照港	510,679	3,666,675.22	0.07%
45	600350	山东高速	837,586	3,635,123.24	0.06%
46	600809	山西汾酒	113,940	3,552,649.20	0.06%
47	600309	烟台万华	146,839	3,537,351.51	0.06%
48	600887	伊利股份	128,605	3,444,041.90	0.06%
49	600383	金地集团	177,152	3,279,083.52	0.06%
50	600143	金发科技	77,496	3,172,686.24	0.06%
51	600456	宝钛股份	100,308	3,107,541.84	0.06%
52	600717	天津港	353,698	3,101,931.46	0.06%
53	600008	首创股份	544,388	3,075,792.20	0.05%
54	600001	邯郸钢铁	697,257	3,047,013.09	0.05%
55	600271	航天信息	82,709	2,895,642.09	0.05%
56	600098	广州控股	505,797	2,837,521.17	0.05%
57	600718	东软股份	118,731	2,825,797.80	0.05%
58	600690	青岛海尔	303,468	2,785,836.24	0.05%
59	600007	中国国贸	266,904	2,743,773.12	0.05%
60	600276	恒瑞医药	83,109	2,679,434.16	0.05%
61	600497	驰宏锌锗	47,301	2,664,938.34	0.05%
62	600631	百联股份	272,679	2,598,630.87	0.05%
63	600875	东方电机	96,293	2,597,022.21	0.05%
64	600649	原水股份	456,200	2,591,216.00	0.05%
65	600010	包钢股份	829,147	2,586,938.64	0.05%
66	600761	安徽合力	115,262	2,585,326.66	0.05%
67	600895	张江高科	359,877	2,504,743.92	0.04%
68	601991	大唐发电	243,000	2,502,900.00	0.04%
69	600598	北大荒	401,016	2,382,035.04	0.04%
70	600415	小商品城	30,921	2,368,548.60	0.04%
71	600269	赣粤高速	282,165	2,364,542.70	0.04%
72	600859	王府井	96,307	2,333,518.61	0.04%
73	600871	S 仪化	594,963	2,320,355.70	0.04%
74	600205	S 山东铝	101,055	2,275,758.60	0.04%
75	600739	辽宁成大	124,843	2,265,900.45	0.04%
76	600022	济南钢铁	283,677	2,181,476.13	0.04%
77	600500	中化国际	312,032	2,128,058.24	0.04%
78	600361	华联综超	90,456	2,094,960.96	0.04%
79	600096	云天化	149,053	2,047,988.22	0.04%
80	600308	华泰股份	151,747	2,027,339.92	0.04%
81	600664	S 哈药	304,441	2,015,399.42	0.04%

82	600549	厦门钨业	115,848	1,999,536.48	0.04%
83	600839	四川长虹	463,377	1,960,084.71	0.04%
84	601001	大同煤业	205,256	1,917,091.04	0.03%
85	600811	东方集团	219,591	1,892,874.42	0.03%
86	600627	上电股份	126,298	1,880,577.22	0.03%
87	600600	青岛啤酒	134,886	1,873,566.54	0.03%
88	600150	沪东重机	58,933	1,870,533.42	0.03%
89	600021	上海电力	385,669	1,870,494.65	0.03%
90	600183	生益科技	225,864	1,867,895.28	0.03%
91	600033	福建高速	360,896	1,844,178.56	0.03%
92	600879	火箭股份	119,700	1,829,016.00	0.03%
93	600123	兰花科创	91,816	1,822,547.60	0.03%
94	600236	桂冠电力	338,621	1,808,236.14	0.03%
95	600296	S 兰铝	139,214	1,800,037.02	0.03%
96	600161	天坛生物	86,623	1,800,025.94	0.03%
97	600020	中原高速	386,878	1,798,982.70	0.03%
98	600428	中远航运	159,467	1,742,974.31	0.03%
99	600548	深高速	351,451	1,739,682.45	0.03%
100	600270	外运发展	220,732	1,739,368.16	0.03%
101	600102	莱钢股份	278,698	1,722,353.64	0.03%
102	600639	浦东金桥	146,817	1,719,227.07	0.03%
103	600797	浙大网新	258,606	1,704,213.54	0.03%
104	600003	S 东北高	441,777	1,692,005.91	0.03%
105	600012	皖通高速	288,005	1,687,709.30	0.03%
106	600588	用友软件	55,960	1,682,157.60	0.03%
107	600066	宇通客车	128,104	1,678,162.40	0.03%
108	600675	中华企业	151,640	1,663,490.80	0.03%
109	600266	北京城建	146,734	1,658,094.20	0.03%
110	600348	国阳新能	110,236	1,628,185.72	0.03%
111	600597	光明乳业	253,959	1,622,798.01	0.03%
112	600006	东风汽车	500,307	1,615,991.61	0.03%
113	600550	天威保变	88,285	1,614,732.65	0.03%
114	600835	上海机电	168,280	1,603,708.40	0.03%
115	600299	星新材料	88,066	1,600,159.22	0.03%
116	600881	亚泰集团	237,997	1,570,780.20	0.03%
117	600151	航天机电	182,411	1,555,965.83	0.03%
118	600779	水井坊	118,714	1,555,153.40	0.03%
119	600582	S 天地	61,144	1,549,388.96	0.03%
120	600748	上实发展	128,555	1,522,091.20	0.03%
121	600004	白云机场	199,104	1,505,226.24	0.03%
122	600058	五矿发展	204,316	1,497,636.28	0.03%
123	600258	S 首旅	79,204	1,495,371.52	0.03%

124	600089	特变电工	99,070	1,493,975.60	0.03%
125	600085	同仁堂	85,777	1,468,502.24	0.03%
126	600886	国投电力	198,092	1,436,167.00	0.03%
127	600569	安阳钢铁	504,520	1,402,565.60	0.03%
128	600312	平高电气	92,057	1,377,172.72	0.02%
129	600685	广船国际	76,641	1,364,976.21	0.02%
130	600062	双鹤药业	174,961	1,352,448.53	0.02%
131	600169	太原重工	161,170	1,336,099.30	0.02%
132	600655	豫园商城	114,099	1,336,099.29	0.02%
133	600196	复星医药	211,808	1,306,855.36	0.02%
134	600100	同方股份	119,531	1,286,153.56	0.02%
135	600489	中金黄金	68,504	1,285,820.08	0.02%
136	600316	洪都航空	61,488	1,283,254.56	0.02%
137	600628	新世界	120,881	1,278,920.98	0.02%
138	600508	上海能源	177,292	1,274,729.48	0.02%
139	600027	华电国际	416,000	1,272,960.00	0.02%
140	600331	宏达股份	81,146	1,254,517.16	0.02%
141	600596	新安股份	67,502	1,248,787.00	0.02%
142	600547	山东黄金	39,643	1,246,772.35	0.02%
143	600153	建发股份	151,897	1,245,555.40	0.02%
144	600219	南山铝业	138,523	1,231,469.47	0.02%
145	600616	第一食品	88,669	1,229,839.03	0.02%
146	600125	铁龙物流	146,839	1,201,143.02	0.02%
147	600256	广汇股份	213,668	1,192,267.44	0.02%
148	600863	内蒙华电	427,647	1,180,305.72	0.02%
149	600978	宜华木业	87,991	1,179,959.31	0.02%
150	600357	承德钒钛	240,997	1,168,835.45	0.02%
151	600467	好当家	142,482	1,168,352.40	0.02%
152	600438	通威股份	84,037	1,119,372.84	0.02%
153	600776	东方通信	233,625	1,112,055.00	0.02%
154	600158	S 中体产	67,078	1,105,445.44	0.02%
155	600997	开滦股份	139,424	1,100,055.36	0.02%
156	600528	中铁二局	155,742	1,085,521.74	0.02%
157	600868	梅雁水电	467,954	1,080,973.74	0.02%
158	600038	哈飞股份	83,359	1,051,990.58	0.02%
159	600111	稀土高科	91,068	1,033,621.80	0.02%
160	600535	天士力	66,198	1,027,392.96	0.02%
161	600410	华胜天成	40,516	1,014,925.80	0.02%
162	600533	栖霞建设	88,469	1,004,123.15	0.02%
163	600332	广州药业	128,904	997,716.96	0.02%
164	600643	S 爱建	113,355	991,856.25	0.02%
165	600611	大众交通	136,035	990,334.80	0.02%

166	600307	酒钢宏兴	218,895	985,027.50	0.02%
167	600787	中储股份	153,228	962,271.84	0.02%
168	600059	古越龙山	58,195	951,488.25	0.02%
169	600426	华鲁恒升	81,157	947,913.76	0.02%
170	600210	紫江企业	354,418	939,207.70	0.02%
171	600035	楚天高速	223,978	936,228.04	0.02%
172	600170	上海建工	176,335	927,522.10	0.02%
173	600874	创业环保	242,720	927,190.40	0.02%
174	600686	金龙汽车	55,710	927,014.40	0.02%
175	600501	航天晨光	75,635	919,721.60	0.02%
176	600754	锦江股份	80,061	911,894.79	0.02%
177	600648	外高桥	134,856	908,929.44	0.02%
178	600325	华发股份	64,875	903,708.75	0.02%
179	600190	锦州港	215,143	903,600.60	0.02%
180	600460	士兰微	100,833	898,422.03	0.02%
181	600386	北京巴士	100,142	888,259.54	0.02%
182	600282	南钢股份	229,778	886,943.08	0.02%
183	600068	葛洲坝	259,326	884,301.66	0.02%
184	600289	亿阳信通	60,355	875,751.05	0.02%
185	600088	中视传媒	58,512	871,243.68	0.02%
186	600591	上海航空	246,507	870,169.71	0.02%
187	600360	华微电子	59,179	869,931.30	0.02%
188	600138	中青旅	66,705	858,493.35	0.02%
189	600741	巴士股份	236,830	852,588.00	0.02%
190	600176	中国玻纤	107,966	832,417.86	0.01%
191	600618	氯碱化工	184,426	828,072.74	0.01%
192	600054	黄山旅游	73,727	827,216.94	0.01%
193	600220	江苏阳光	203,012	824,228.72	0.01%
194	600650	锦江投资	97,653	824,191.32	0.01%
195	600635	大众公用	232,394	815,702.94	0.01%
196	600880	博瑞传播	45,207	800,615.97	0.01%
197	600171	上海贝岭	149,039	798,849.04	0.01%
198	600638	新黄浦	136,484	797,066.56	0.01%
199	600315	上海家化	42,788	789,866.48	0.01%
200	600849	上海医药	115,499	787,703.18	0.01%
201	600867	通化东宝	90,595	782,740.80	0.01%
202	600060	海信电器	121,708	782,582.44	0.01%
203	600770	综艺股份	65,441	781,365.54	0.01%
204	600380	健康元	145,257	774,219.81	0.01%
205	600521	华海药业	57,063	771,491.76	0.01%
206	600439	瑞贝卡	46,345	767,473.20	0.01%
207	600208	中宝股份	104,500	767,030.00	0.01%

208	600641	万业企业	112,991	763,819.16	0.01%
209	600825	新华传媒	63,931	761,418.21	0.01%
210	600963	岳阳纸业	67,284	754,253.64	0.01%
211	600755	厦门国贸	111,162	749,231.88	0.01%
212	600290	S 苏福马	48,042	740,327.22	0.01%
213	600075	新疆天业	105,016	738,262.48	0.01%
214	600064	南京高科	83,670	728,765.70	0.01%
215	600584	长电科技	71,766	725,554.26	0.01%
216	600820	隧道股份	144,948	724,740.00	0.01%
217	600517	置信电气	47,695	713,994.15	0.01%
218	600108	亚盛集团	341,552	713,843.68	0.01%
219	600826	兰生股份	70,135	699,947.30	0.01%
220	600327	大厦股份	79,442	699,884.02	0.01%
221	600086	东方金钰	88,247	697,151.30	0.01%
222	600087	南京水运	125,611	697,141.05	0.01%
223	600117	西宁特钢	171,933	696,328.65	0.01%
224	600160	巨化股份	134,372	694,703.24	0.01%
225	600578	京能热电	141,058	691,184.20	0.01%
226	600436	片仔癀	32,580	690,044.40	0.01%
227	600729	重庆百货	49,459	687,480.10	0.01%
228	600865	S 百大	67,193	686,040.53	0.01%
229	600166	福田汽车	198,696	679,540.32	0.01%
230	600726	华电能源	222,911	673,191.22	0.01%
231	600491	龙元建设	95,523	672,481.92	0.01%
232	600563	法拉电子	54,701	670,087.25	0.01%
233	600300	维维股份	146,120	669,229.60	0.01%
234	600298	安琪酵母	30,373	668,813.46	0.01%
235	600231	凌钢股份	130,928	665,114.24	0.01%
236	600186	S 莲花味	232,471	662,542.35	0.01%
237	600677	航天通信	89,763	657,962.79	0.01%
238	600067	冠城大通	89,760	657,940.80	0.01%
239	600888	新疆众和	35,249	656,688.87	0.01%
240	600110	中科英华	81,212	654,568.72	0.01%
241	600126	杭钢股份	160,039	652,959.12	0.01%
242	600263	路桥建设	92,335	652,808.45	0.01%
243	600834	申通地铁	113,329	652,775.04	0.01%
244	600682	S 宁新百	57,277	647,802.87	0.01%
245	600211	S 藏药业	37,503	645,051.60	0.01%
246	600525	长园新材	23,758	643,366.64	0.01%
247	600665	天地源	144,749	642,685.56	0.01%
248	600295	鄂尔多斯	140,800	640,640.00	0.01%
249	600352	浙江龙盛	142,413	636,586.11	0.01%

250	600130	波导股份	187,149	636,306.60	0.01%
251	600662	强生控股	155,953	636,288.24	0.01%
252	600607	上实医药	92,686	633,045.38	0.01%
253	600640	中卫国脉	87,800	631,282.00	0.01%
254	600416	湘电股份	59,264	626,420.48	0.01%
255	600581	八一钢铁	144,922	624,613.82	0.01%
256	600637	广电信息	160,480	624,267.20	0.01%
257	600052	S 浙广厦	113,571	623,504.79	0.01%
258	600858	银座股份	30,759	623,177.34	0.01%
259	600736	苏州高新	112,157	622,471.35	0.01%
260	600824	益民百货	105,328	620,381.92	0.01%
261	600189	吉林森工	72,594	619,952.76	0.01%
262	600653	申华控股	208,420	619,007.40	0.01%
263	600197	伊力特	106,451	618,480.31	0.01%
264	600330	天通股份	106,509	616,687.11	0.01%
265	600084	新天国际	114,667	615,761.79	0.01%
266	600475	华光股份	58,810	605,154.90	0.01%
267	600636	三爱富	72,554	599,296.04	0.01%
268	600812	华北制药	248,270	595,848.00	0.01%
269	600432	吉恩镍业	34,661	595,822.59	0.01%
270	600498	烽火通信	81,030	595,570.50	0.01%
271	600122	宏图高科	77,687	591,198.07	0.01%
272	600897	厦门空港	72,912	586,941.60	0.01%
273	600267	海正药业	109,084	586,871.92	0.01%
274	600823	世茂股份	115,998	585,789.90	0.01%
275	600322	天房发展	102,737	585,600.90	0.01%
276	600131	S 岷电	115,873	585,158.65	0.01%
277	600240	华业地产	85,814	583,535.20	0.01%
278	600518	康美药业	53,694	576,136.62	0.01%
279	600078	澄星股份	98,563	573,636.66	0.01%
280	600409	三友化工	133,557	568,952.82	0.01%
281	600337	美克股份	49,408	567,203.84	0.01%
282	600961	株冶火炬	61,700	562,087.00	0.01%
283	600418	江淮汽车	114,366	560,393.40	0.01%
284	600747	大显股份	241,611	555,705.30	0.01%
285	600580	卧龙电气	64,298	552,962.80	0.01%
286	600971	恒源煤电	45,897	551,222.97	0.01%
287	600215	长春经开	105,188	548,029.48	0.01%
288	600317	营口港	62,763	544,782.84	0.01%
289	600815	厦工股份	130,304	542,064.64	0.01%
290	600570	恒生电子	57,382	541,112.26	0.01%
291	600861	北京城乡	72,285	526,234.80	0.01%

292	600495	晋西车轴	25,460	525,494.40	0.01%
293	600790	轻纺城	92,227	524,771.63	0.01%
294	600511	国药股份	29,691	523,155.42	0.01%
295	600121	郑州煤电	128,932	519,595.96	0.01%
296	600744	华银电力	173,237	517,978.63	0.01%
297	600103	青山纸业	224,109	517,691.79	0.01%
298	600589	广东榕泰	61,107	516,965.22	0.01%
299	600072	江南重工	88,260	516,321.00	0.01%
300	600827	友谊股份	65,024	514,990.08	0.01%
301	600481	双良股份	76,042	510,241.82	0.01%
302	600884	杉杉股份	95,631	499,193.82	0.01%
303	600396	金山股份	64,434	498,719.16	0.01%
304	600623	轮胎橡胶	85,283	489,524.42	0.01%
305	600302	标准股份	77,400	489,168.00	0.01%
306	600750	江中药业	36,318	488,477.10	0.01%
307	600555	九龙山	75,541	485,728.63	0.01%
308	600590	泰豪科技	51,068	485,656.68	0.01%
309	600073	上海梅林	71,058	485,326.14	0.01%
310	600855	航天长峰	71,877	484,450.98	0.01%
311	600216	浙江医药	109,670	482,548.00	0.01%
312	600991	长丰汽车	100,487	482,337.60	0.01%
313	600606	金丰投资	59,890	480,317.80	0.01%
314	600509	天富热电	63,030	479,028.00	0.01%
315	600973	宝胜股份	37,854	478,096.02	0.01%
316	600536	中国软件	38,785	477,055.50	0.01%
317	600702	沱牌曲酒	82,054	474,272.12	0.01%
318	600723	西单商场	98,669	471,637.82	0.01%
319	600819	耀皮玻璃	118,067	471,087.33	0.01%
320	600051	宁波联合	70,548	470,555.16	0.01%
321	600854	春兰股份	127,546	468,093.82	0.01%
322	600178	东安动力	112,965	465,415.80	0.01%
323	600488	天药股份	113,517	457,473.51	0.01%
324	600841	上柴股份	58,163	457,161.18	0.01%
325	600191	华资实业	76,601	454,243.93	0.01%
326	600268	国电南自	42,983	452,181.16	0.01%
327	600601	方正科技	104,743	451,442.33	0.01%
328	600423	柳化股份	40,405	450,515.75	0.01%
329	600693	东百集团	33,453	448,939.26	0.01%
330	600592	龙溪股份	31,053	448,405.32	0.01%
331	600358	国旅联合	106,630	441,448.20	0.01%
332	600840	新湖创业	47,883	440,523.60	0.01%
333	600894	广钢股份	157,280	440,384.00	0.01%

334	600487	亨通光电	40,544	439,902.40	0.01%
335	600510	黑牡丹	108,021	439,645.47	0.01%
336	600323	南海发展	51,506	438,316.06	0.01%
337	600621	上海金陵	122,072	438,238.48	0.01%
338	600529	山东药玻	54,982	436,007.26	0.01%
339	600828	成商集团	48,529	434,819.84	0.01%
340	600408	安泰集团	95,559	434,793.45	0.01%
341	600724	宁波富达	109,658	434,245.68	0.01%
342	600595	中孚实业	56,690	434,245.40	0.01%
343	600303	曙光股份	54,551	430,407.39	0.01%
344	600602	广电电子	138,443	429,173.30	0.01%
345	600485	中创信测	33,228	426,647.52	0.01%
346	600697	欧亚集团	40,195	424,861.15	0.01%
347	600246	万通先锋	15,222	423,476.04	0.01%
348	600379	S 宝光	39,104	422,323.20	0.01%
349	600366	宁波韵升	89,968	421,949.92	0.01%
350	600966	博汇纸业	69,380	418,361.40	0.01%
351	600388	龙净环保	38,792	418,177.76	0.01%
352	600674	川投能源	95,305	417,435.90	0.01%
353	600399	抚顺特钢	129,433	416,774.26	0.01%
354	600822	上海物贸	45,143	415,767.03	0.01%
355	600056	中技贸易	59,394	415,164.06	0.01%
356	600798	宁波海运	113,552	412,193.76	0.01%
357	600458	时代新材	50,298	406,910.82	0.01%
358	600804	鹏博士	35,011	405,777.49	0.01%
359	600319	亚星化学	77,693	405,557.46	0.01%
360	600206	有研硅股	36,418	405,332.34	0.01%
361	600626	申达股份	116,073	405,094.77	0.01%
362	600654	飞乐股份	176,591	404,393.39	0.01%
363	600281	太化股份	116,937	402,263.28	0.01%
364	600395	盘江股份	91,544	400,962.72	0.01%
365	600704	中大股份	93,238	400,923.40	0.01%
366	600780	通宝能源	135,154	400,055.84	0.01%
367	600459	贵研铂业	20,120	398,979.60	0.01%
368	600531	豫光金铅	56,178	398,302.02	0.01%
369	600872	中炬高新	133,581	396,735.57	0.01%
370	600278	东方创业	80,516	395,333.56	0.01%
371	600382	广东明珠	39,982	394,222.52	0.01%
372	600479	千金药业	31,106	392,868.78	0.01%
373	600708	海博股份	88,082	392,845.72	0.01%
374	600371	华冠科技	39,347	392,683.06	0.01%
375	600376	天鸿宝业	63,381	392,328.39	0.01%

376	600283	钱江水利	81,918	390,748.86	0.01%
377	600775	南京熊猫	70,912	388,597.76	0.01%
378	600074	中达股份	151,078	388,270.46	0.01%
379	600261	浙江阳光	30,475	388,251.50	0.01%
380	600864	岁宝热电	30,720	387,993.60	0.01%
381	600127	金健米业	135,419	387,298.34	0.01%
382	600814	杭州解百	76,557	385,847.28	0.01%
383	600069	银鸽投资	90,969	384,798.87	0.01%
384	600280	南京中商	35,383	384,259.38	0.01%
385	600251	冠农股份	45,276	383,940.48	0.01%
386	600106	重庆路桥	77,397	383,889.12	0.01%
387	600764	中电广通	81,609	381,930.12	0.01%
388	600877	中国嘉陵	168,718	379,615.50	0.01%
389	600328	兰太实业	88,461	376,843.86	0.01%
390	600995	文山电力	54,485	374,856.80	0.01%
391	600230	沧州大化	63,801	372,597.84	0.01%
392	600249	两面针	37,901	371,050.79	0.01%
393	600727	鲁北化工	87,018	370,696.68	0.01%
394	600713	南京医药	56,259	370,184.22	0.01%
395	600343	航天动力	45,631	368,242.17	0.01%
396	600326	西藏天路	45,019	367,805.23	0.01%
397	600368	五洲交通	110,249	367,129.17	0.01%
398	600291	西水股份	41,377	367,013.99	0.01%
399	600363	联创光电	92,445	365,157.75	0.01%
400	600305	恒顺醋业	32,068	363,651.12	0.01%
401	600288	大恒科技	84,392	362,885.60	0.01%
402	600801	华新水泥	40,855	361,566.75	0.01%
403	600557	康缘药业	38,717	359,680.93	0.01%
404	600192	长城电工	68,378	357,616.94	0.01%
405	600201	金宇集团	66,873	357,101.82	0.01%
406	600129	太极集团	62,068	356,891.00	0.01%
407	600805	悦达投资	115,450	354,431.50	0.01%
408	600262	北方股份	41,999	351,111.64	0.01%
409	600133	S 东湖新	67,630	350,999.70	0.01%
410	600523	贵航股份	42,078	350,088.96	0.01%
411	600630	龙头股份	104,102	349,782.72	0.01%
412	600883	博闻科技	59,347	348,366.89	0.01%
413	600275	武昌鱼	117,229	348,170.13	0.01%
414	600896	中海海盛	87,691	348,133.27	0.01%
415	600168	武汉控股	90,783	347,698.89	0.01%
416	600260	凯乐科技	50,109	347,255.37	0.01%
417	600676	交运股份	95,429	346,407.27	0.01%

418	600406	国电南瑞	15,351	346,318.56	0.01%
419	600329	中新药业	66,373	345,803.33	0.01%
420	600135	S 乐凯	71,090	345,497.40	0.01%
421	600496	长江精工	49,289	345,023.00	0.01%
422	600345	长江通信	49,566	343,492.38	0.01%
423	600482	风帆股份	54,502	343,362.60	0.01%
424	600806	S 交科技	42,824	341,307.28	0.01%
425	600333	长春燃气	80,412	340,142.76	0.01%
426	600367	红星发展	72,308	339,847.60	0.01%
427	600573	惠泉啤酒	61,768	337,870.96	0.01%
428	600821	津劝业	101,058	336,523.14	0.01%
429	600777	新潮实业	85,693	333,345.77	0.01%
430	600391	成发科技	32,489	333,337.14	0.01%
431	600310	桂东电力	32,436	330,522.84	0.01%
432	600469	风神股份	62,315	328,400.05	0.01%
433	600838	上海九百	97,853	325,850.49	0.01%
434	600232	金鹰股份	54,407	325,353.86	0.01%
435	600527	江南高纤	52,625	324,696.25	0.01%
436	600710	常林股份	81,041	323,353.59	0.01%
437	600505	S 西昌电	76,104	321,919.92	0.01%
438	600644	S 乐电	57,872	320,610.88	0.01%
439	600202	哈空调	48,144	319,676.16	0.01%
440	600993	马应龙	10,067	318,922.56	0.01%
441	600530	交大昂立	59,856	317,236.80	0.01%
442	600179	黑化股份	98,179	317,118.17	0.01%
443	600292	九龙电力	82,512	316,846.08	0.01%
444	600771	东盛科技	48,921	316,518.87	0.01%
445	600546	中油化建	63,313	315,931.87	0.01%
446	600162	香江控股	68,695	311,875.30	0.01%
447	600172	黄河旋风	65,904	311,725.92	0.01%
448	600227	赤天化	33,202	311,434.76	0.01%
449	600071	凤凰光学	58,759	311,422.70	0.01%
450	600612	第一铅笔	32,528	311,292.96	0.01%
451	600836	界龙实业	48,152	309,617.36	0.01%
452	600586	金晶科技	56,040	309,340.80	0.01%
453	600101	S 明星电	56,843	308,657.49	0.01%
454	600661	交大南洋	42,677	308,554.71	0.01%
455	600740	山西焦化	36,564	308,234.52	0.01%
456	600091	明天科技	71,586	307,103.94	0.01%
457	600284	浦东建设	57,160	306,949.20	0.01%
458	600470	六国化工	46,129	306,757.85	0.01%
459	600063	皖维高新	55,771	305,067.37	0.01%

460	600789	鲁抗医药	101,483	304,449.00	0.01%
461	600180	九发股份	62,668	303,939.80	0.01%
462	600561	江西长运	48,130	302,737.70	0.01%
463	600619	海立股份	58,265	301,812.70	0.01%
464	600720	祁连山	97,082	299,983.38	0.01%
465	600480	凌云股份	76,326	299,961.18	0.01%
466	600785	新华百货	30,367	299,418.62	0.01%
467	600398	凯诺科技	58,615	298,936.50	0.01%
468	600468	百利电气	64,058	296,588.54	0.01%
469	600226	升华拜克	66,429	296,273.34	0.01%
470	600359	新农开发	78,704	295,927.04	0.01%
471	600156	华升股份	100,347	295,020.18	0.01%
472	600221	海南航空	80,876	293,579.88	0.01%
473	600522	中天科技	60,558	293,100.72	0.01%
474	600860	北人股份	80,464	292,084.32	0.01%
475	600605	轻工机械	36,882	290,630.16	0.01%
476	600141	兴发集团	40,705	290,226.65	0.01%
477	600105	永鼎光缆	66,857	289,490.81	0.01%
478	600212	江泉实业	112,098	289,212.84	0.01%
479	600987	航民股份	81,346	287,964.84	0.01%
480	600565	迪马股份	39,382	287,488.60	0.01%
481	600253	天方药业	87,289	287,180.81	0.01%
482	600567	山鹰纸业	88,111	284,598.53	0.01%
483	600318	S 巢东	47,897	282,113.33	0.01%
484	600732	上海新梅	61,158	280,715.22	0.01%
485	600387	海越股份	49,164	280,234.80	0.01%
486	600733	S 前锋	43,798	279,431.24	0.00%
487	600866	星湖科技	120,312	279,123.84	0.00%
488	600223	万杰高科	130,919	278,857.47	0.00%
489	600372	昌河股份	89,978	277,132.24	0.00%
490	600765	力源液压	26,820	276,514.20	0.00%
491	600279	重庆港九	56,216	274,334.08	0.00%
492	600725	云维股份	41,142	274,005.72	0.00%
493	600962	国投中鲁	40,874	272,220.84	0.00%
494	600255	鑫科材料	30,629	271,985.52	0.00%
495	600370	三房巷	70,365	270,905.25	0.00%
496	600393	东华实业	65,421	268,226.10	0.00%
497	600707	彩虹股份	93,810	267,358.50	0.00%
498	600422	昆明制药	76,901	265,308.45	0.00%
499	600336	澳柯玛	81,966	263,110.86	0.00%
500	600152	维科精华	72,259	263,022.76	0.00%
501	600120	浙江东方	84,103	261,560.33	0.00%

502	600667	S 太极	64,802	261,152.06	0.00%
503	600272	S 开开	56,713	259,745.54	0.00%
504	600594	益佰制药	29,414	259,137.34	0.00%
505	600039	S 川路桥	52,632	258,949.44	0.00%
506	600222	太龙药业	54,996	258,481.20	0.00%
507	600604	二纺机	81,276	257,644.92	0.00%
508	600247	物华股份	79,532	256,888.36	0.00%
509	600446	金证股份	25,227	256,306.32	0.00%
510	600321	国栋建设	56,194	256,244.64	0.00%
511	600652	爱使股份	66,082	253,754.88	0.00%
512	600843	上工申贝	51,030	253,619.10	0.00%
513	600107	S 美尔雅	61,587	251,890.83	0.00%
514	600620	天宸股份	65,228	251,780.08	0.00%
515	600157	S 鲁润	41,210	250,968.90	0.00%
516	600553	太行水泥	78,259	250,428.80	0.00%
517	600229	青岛碱业	67,263	249,545.73	0.00%
518	600486	扬农化工	25,470	248,841.90	0.00%
519	600757	S 华源发	84,273	248,605.35	0.00%
520	600400	红豆股份	81,339	248,083.95	0.00%
521	600354	敦煌种业	46,413	247,845.42	0.00%
522	600239	S 红河	44,357	246,624.92	0.00%
523	600730	中国高科	59,653	239,805.06	0.00%
524	600155	宝硕股份	100,683	239,625.54	0.00%
525	600392	太工天成	26,437	239,519.22	0.00%
526	600976	武汉健民	37,709	239,452.15	0.00%
527	600673	阳之光	30,865	237,660.50	0.00%
528	600981	江苏开元	68,798	236,665.12	0.00%
529	600365	通葡股份	34,421	234,751.22	0.00%
530	600145	四维瓷业	78,083	231,906.51	0.00%
531	600692	亚通股份	64,503	230,920.74	0.00%
532	600163	福建南纸	68,623	229,200.82	0.00%
533	600094	S 华源	48,546	229,137.12	0.00%
534	600257	洞庭水殖	55,106	227,587.78	0.00%
535	600252	中恒集团	54,268	226,840.24	0.00%
536	600435	北方天鸟	36,069	226,152.63	0.00%
537	600277	亿利科技	43,156	226,137.44	0.00%
538	600701	S 工大新	57,199	225,936.05	0.00%
539	600114	宁波东睦	48,225	224,246.25	0.00%
540	600696	多伦股份	84,582	224,142.30	0.00%
541	600624	复旦复华	65,448	223,832.16	0.00%
542	600378	天科股份	59,676	222,591.48	0.00%
543	600356	恒丰纸业	34,652	221,079.76	0.00%

544	600965	福成五丰	67,182	220,356.96	0.00%
545	600116	三峡水利	58,690	219,500.60	0.00%
546	600512	腾达建设	61,407	219,222.99	0.00%
547	600061	中纺投资	80,509	218,179.39	0.00%
548	600983	合肥三洋	67,355	217,556.65	0.00%
549	600746	江苏索普	69,915	217,435.65	0.00%
550	600560	金自天正	25,400	216,154.00	0.00%
551	600095	哈高科	71,851	214,834.49	0.00%
552	600577	精达股份	31,743	214,582.68	0.00%
553	600389	江山股份	48,685	214,214.00	0.00%
554	600079	人福科技	43,678	213,585.42	0.00%
555	600293	三峡新材	84,758	212,742.58	0.00%
556	600218	全柴动力	70,295	212,290.90	0.00%
557	600802	福建水泥	70,643	211,222.57	0.00%
558	600716	耀华玻璃	89,020	210,977.40	0.00%
559	600397	安源股份	65,208	209,317.68	0.00%
560	600684	珠江实业	45,502	209,309.20	0.00%
561	600969	郴电国际	52,004	209,056.08	0.00%
562	600238	海南椰岛	41,057	208,980.13	0.00%
563	600722	沧州化工	105,366	208,624.68	0.00%
564	600960	滨州活塞	26,870	208,511.20	0.00%
565	600128	弘业股份	48,555	208,300.95	0.00%
566	600297	美罗药业	34,267	207,315.35	0.00%
567	600375	星马汽车	46,254	207,217.92	0.00%
568	600539	S 狮头	46,016	207,072.00	0.00%
569	600287	江苏舜天	80,147	206,779.26	0.00%
570	600540	新赛股份	44,165	206,692.20	0.00%
571	600401	江苏申龙	63,650	206,226.00	0.00%
572	600967	北方创业	32,672	204,200.00	0.00%
573	600499	科达机电	36,122	203,728.08	0.00%
574	600449	赛马实业	35,976	203,624.16	0.00%
575	600719	大连热电	50,566	203,275.32	0.00%
576	600556	北生药业	73,886	203,186.50	0.00%
577	600599	浏阳花炮	33,547	202,288.41	0.00%
578	600355	精伦电子	61,869	200,455.56	0.00%
579	600195	中牧股份	16,946	200,301.72	0.00%
580	600425	青松建化	42,363	199,529.73	0.00%
581	600477	杭萧钢构	60,679	198,420.33	0.00%
582	600558	大西洋	29,608	197,781.44	0.00%
583	600782	新华股份	48,940	197,717.60	0.00%
584	600979	广安爱众	41,426	197,187.76	0.00%
585	600803	威远生化	55,057	197,104.06	0.00%

586	600796	钱江生化	50,693	196,688.84	0.00%
587	600207	安彩高科	71,062	196,131.12	0.00%
588	600543	莫高股份	34,264	193,591.60	0.00%
589	600390	金瑞科技	26,981	193,453.77	0.00%
590	600405	动力源	26,170	193,396.30	0.00%
591	600184	新华光	16,996	192,394.72	0.00%
592	600301	南化股份	47,596	190,859.96	0.00%
593	600742	一汽四环	51,867	190,351.89	0.00%
594	600381	贤成实业	74,976	188,939.52	0.00%
595	600507	长力股份	64,152	186,682.32	0.00%
596	600526	菲达环保	34,125	186,663.75	0.00%
597	600575	芜湖港	29,269	183,809.32	0.00%
598	600433	冠豪高新	39,327	183,263.82	0.00%
599	600791	天创置业	31,574	183,129.20	0.00%
600	600579	黄海股份	60,721	182,770.21	0.00%
601	600992	贵绳股份	40,708	182,371.84	0.00%
602	600237	铜峰电子	56,224	182,165.76	0.00%
603	600476	湘邮科技	25,671	181,493.97	0.00%
604	600420	现代制药	29,952	181,209.60	0.00%
605	600452	涪陵电力	39,461	181,125.99	0.00%
606	600055	万东医疗	35,587	180,070.22	0.00%
607	600571	信雅达	47,396	179,156.88	0.00%
608	600537	海通集团	53,960	179,147.20	0.00%
609	600250	南纺股份	48,416	178,170.88	0.00%
610	600714	金瑞矿业	36,913	177,551.53	0.00%
611	600149	S 华夏通	52,286	177,249.54	0.00%
612	600119	长江投资	58,652	177,129.04	0.00%
613	600080	金花股份	62,555	177,030.65	0.00%
614	600731	湖南海利	62,660	175,448.00	0.00%
615	600856	长百集团	57,393	174,474.72	0.00%
616	600671	天目药业	30,186	173,267.64	0.00%
617	600774	汉商集团	42,945	172,638.90	0.00%
618	600311	荣华实业	60,637	172,209.08	0.00%
619	600502	安徽水利	38,401	171,652.47	0.00%
620	600975	新五丰	25,215	171,462.00	0.00%
621	600587	新华医疗	21,171	169,579.71	0.00%
622	600461	洪城水业	34,610	169,242.90	0.00%
623	600846	同济科技	54,508	168,429.72	0.00%
624	600228	昌九生化	59,167	168,034.28	0.00%
625	600351	亚宝药业	30,876	167,965.44	0.00%
626	600712	S 南百	28,653	166,760.46	0.00%
627	600478	S 力元	27,972	166,433.40	0.00%

628	600783	鲁信高新	48,334	165,785.62	0.00%
629	600306	商业城	42,789	165,593.43	0.00%
630	600493	凤竹纺织	42,411	164,978.79	0.00%
631	600185	海星科技	52,482	164,793.48	0.00%
632	600666	西南药业	35,546	164,222.52	0.00%
633	600448	华纺股份	64,780	163,893.40	0.00%
634	600778	友好集团	57,823	163,639.09	0.00%
635	600175	美都控股	38,858	163,203.60	0.00%
636	600982	宁波热电	41,379	162,619.47	0.00%
637	600889	南京化纤	44,300	162,581.00	0.00%
638	600668	尖峰集团	72,622	161,947.06	0.00%
639	600885	力诺太阳	38,693	161,736.74	0.00%
640	600466	S 迪康	24,732	159,521.40	0.00%
641	600990	四创电子	14,593	159,355.56	0.00%
642	600833	第一医药	39,084	157,899.36	0.00%
643	600986	科达股份	35,296	157,067.20	0.00%
644	600193	创兴科技	36,991	155,732.11	0.00%
645	600882	大成股份	51,062	154,207.24	0.00%
646	600113	浙江东日	29,127	153,208.02	0.00%
647	600243	青海华鼎	38,498	152,837.06	0.00%
648	600683	银泰股份	43,896	151,880.16	0.00%
649	600794	保税科技	37,668	151,802.04	0.00%
650	600233	大杨创世	40,464	151,740.00	0.00%
651	600545	新疆城建	39,568	150,358.40	0.00%
652	600148	长春一东	35,724	148,254.60	0.00%
653	600559	裕丰股份	34,203	147,414.93	0.00%
654	600850	华东电脑	41,704	146,381.04	0.00%
655	600273	华芳纺织	50,430	142,212.60	0.00%
656	600538	北海国发	57,270	142,029.60	0.00%
657	600285	羚锐股份	24,780	140,502.60	0.00%
658	600165	宁夏恒力	45,996	140,287.80	0.00%
659	600241	辽宁时代	26,467	140,275.10	0.00%
660	600265	景谷林业	32,033	139,663.88	0.00%
661	600608	S 沪科技	40,586	133,933.80	0.00%
662	600857	工大首创	43,013	130,759.52	0.00%
663	600678	四川金顶	46,683	130,245.57	0.00%
664	600483	福建南纺	50,410	130,057.80	0.00%
665	600689	上海三毛	33,957	129,715.74	0.00%
666	600658	兆维科技	40,570	127,795.50	0.00%
667	600353	旭光股份	27,615	127,305.15	0.00%
668	600097	华立科技	28,046	125,365.62	0.00%
669	600572	康恩贝	15,156	124,430.76	0.00%

670	600985	雷鸣科化	22,418	123,971.54	0.00%
671	600566	洪城股份	26,512	122,750.56	0.00%
672	600462	S 石纸	23,148	121,295.52	0.00%
673	600340	国祥股份	35,929	120,721.44	0.00%
674	600984	建设机械	34,846	117,779.48	0.00%
675	600506	香梨股份	36,562	117,364.02	0.00%
676	600070	浙江富润	35,153	117,059.49	0.00%
677	600099	林海股份	37,190	115,289.00	0.00%
678	600490	中科合臣	21,780	112,167.00	0.00%
679	600593	大连圣亚	22,972	108,657.56	0.00%
680	600444	国通管业	17,293	107,562.46	0.00%
681	600568	潜江制药	28,635	107,381.25	0.00%
682	600346	大橡塑	25,657	107,246.26	0.00%
683	600551	科大创新	18,446	106,064.50	0.00%
684	600634	海鸟发展	21,558	103,693.98	0.00%
685	600532	华阳科技	25,851	101,852.94	0.00%
686	600562	高淳陶瓷	20,607	98,707.53	0.00%
687	600699	辽源得亨	44,634	97,748.46	0.00%
688	600520	三佳科技	24,304	97,216.00	0.00%
689	600810	神马实业	21,602	94,184.72	0.00%
690	600373	鑫新股份	27,340	90,222.00	0.00%
691	600552	方兴科技	24,787	83,036.45	0.00%
692	600463	空港股份	12,124	81,352.04	0.00%
693	600980	北矿磁材	14,723	79,504.20	0.00%
694	600421	国药科技	19,544	71,726.48	0.00%
695	600403	欣网视讯	4,610	27,060.70	0.00%
696	600687	华盛达	4,456	20,408.48	0.00%
697	600455	交大博通	2,646	20,136.06	0.00%
698	600235	民丰特纸	4,207	15,187.27	0.00%
699	600988	S 宝龙	1,255	6,049.10	0.00%
700	600029	S 南航	1,260	5,103.00	0.00%
701	600115	S 东航	985	3,624.80	0.00%
702	600513	联环药业	135	984.15	0.00%
703	600829	三精制药	45	525.60	0.00%
704	600132	重庆啤酒	21	525.21	0.00%
705	600830	大红鹰	126	415.80	0.00%
706	600200	江苏吴中	113	337.87	0.00%
707	600851	海欣股份	84	324.24	0.00%
708	600339	天利高新	75	314.25	0.00%
709	600817	宏盛科技	33	276.87	0.00%
710	600680	上海普天	16	137.76	0.00%
711	600217	秦岭水泥	57	112.86	0.00%

712	600081	S 东风科	26	98.80	0.00%
713	600706	长安信息	14	58.10	0.00%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600900	长江电力	257,864,826.96	9.11%
2	600016	民生银行	219,331,889.98	7.75%
3	600271	航天信息	176,910,114.12	6.25%
4	600895	张江高科	167,599,335.97	5.92%
5	600036	招商银行	164,854,717.37	5.82%
6	000538	云南白药	162,424,663.19	5.74%
7	600269	赣粤高速	158,936,773.27	5.61%
8	600050	中国联通	154,024,933.67	5.44%
9	600694	大商股份	149,961,534.32	5.30%
10	600415	小商品城	142,808,030.88	5.04%
11	000793	华闻传媒	128,319,349.26	4.53%
12	601988	中国银行	113,772,743.09	4.02%
13	000852	S 江 钻	102,732,210.70	3.63%
14	601006	大秦铁路	100,148,629.79	3.54%
15	600970	中材国际	95,379,379.49	3.37%
16	600028	中国石化	90,151,084.35	3.18%
17	002024	苏宁电器	83,799,010.00	2.96%
18	000758	中色股份	83,661,933.78	2.96%
19	600350	山东高速	82,326,485.63	2.91%
20	600009	上海机场	81,913,968.96	2.89%
21	000848	承德露露	71,874,949.21	2.54%
22	600718	东软股份	71,844,482.27	2.54%
23	600467	好当家	70,694,543.07	2.50%
24	601398	工商银行	68,091,423.83	2.41%
25	600062	双鹤药业	67,341,120.90	2.38%
26	000858	五 粮 液	62,887,280.98	2.22%
27	000970	中科三环	61,568,512.33	2.17%
28	600033	福建高速	57,653,205.92	2.04%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	600900	长江电力	325,384,400.12	11.49%
2	600009	上海机场	276,737,890.85	9.78%
3	600016	民生银行	228,591,522.71	8.07%
4	600050	中国联通	197,360,146.91	6.97%
5	600036	招商银行	192,768,747.79	6.81%
6	600269	赣粤高速	156,625,578.73	5.53%
7	000758	中色股份	147,351,253.53	5.21%
8	600028	中国石化	147,340,151.86	5.20%
9	600350	山东高速	131,437,022.00	4.64%
10	000027	深能源 A	116,114,403.72	4.10%
11	600030	中信证券	104,808,676.65	3.70%
12	600177	雅戈尔	102,323,924.52	3.61%
13	600548	深高速	97,432,078.01	3.44%
14	000858	五粮液	91,359,568.42	3.23%
15	601006	大秦铁路	90,680,763.41	3.20%
16	000970	中科三环	89,096,976.11	3.15%
17	600151	航天机电	80,706,510.00	2.85%
18	600418	江淮汽车	80,036,296.37	2.83%
19	000538	云南白药	79,810,513.12	2.82%
20	600362	江西铜业	75,078,435.57	2.65%
21	600415	小商品城	74,405,634.48	2.63%
22	600002	齐鲁石化	63,076,245.89	2.23%
23	600033	福建高速	62,252,036.49	2.20%
24	000956	中原退市	61,083,556.35	2.16%
25	600416	湘电股份	58,813,223.01	2.08%
26	600787	中储股份	57,709,027.16	2.04%
27	000917	电广传媒	56,756,515.29	2.00%

3、本报告期内买入股票的成本总额为 5,451,881,663.90 元；卖出股票的收入总额为 5,737,372,482.84 元。

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	国债	827,824,407.10	14.80%
2	金融债	309,875,000.00	5.54%
3	央行票据	-	-
4	企业债	-	-
5	可转债	332,897.00	0.01%
	合计	1,138,032,304.10	20.34%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	占净值比例
1	20 国债	435,436,114.80	7.78%
2	20 国债	210,073,855.50	3.75%
3	06 国开 08	200,000,000.00	3.57%
4	02 国债	162,062,436.80	2.90%
5	06 进出 04	78,924,000.00	1.41%

(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

(八) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	期末市值(元)	占净值比例
1	580009	伊利 CWB1	49,589	879,659.27	0.02%
2	580008	国电 JTB1	161,963	469,368.77	0.01%

(九) 投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3、基金的其他资产构成

单位：元

其他应收款	11,281,200.00
应收证券清算款	10,101,895.73
应收利息	8,751,099.13
交易保证金	573,546.92
应收股利	3,387.83
合计	30,711,129.61

4、至本报告期末，本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期内获得的权证

	权证名称	数量(份)	成本总额(元)
被动持有权证	包钢 JTB1	3,098,720	-
	邯钢 JTB1	690,343	-
	首创 JTB1	71,870	-
	万华 HXB1	57,951	-
	雅戈 QCB1	1,247,637	-
	长电 CWB1	638,025	-
	国电 JTB1	161,963	-
	伊利 CWB1	49,589	-
	茅台 JCP1	550,931	-
	海尔 JTP1	2,500,956	-
	雅戈 QCP1	8,733,459	-
	万华 HXP1	86,926	-
	原水 CTP1	411,347	-
	包钢 JTP1	3,098,720	-
	沪场 JTP1	10,351,209	-
	招行 CMP1	2,727,157	-
因认购新债获配权证	钢钒 GFC1	27,888,750	21,949,351.84

八、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至 2006 年 12 月 31 日兴和证券投资基金持有人情况如下：

(一) 持有人户数

基金份额持有人户数	111,897 户
平均每户持有基金份额	26,810 份

(二) 持有人结构

	持有份额(份)	占基金总份额比例
机构投资者	1,704,224,945.00	56.81%
个人投资者	1,295,775,055.00	43.19%
合计	3,000,000,000.00	100.00%

(三) 前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占基金总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	277,139,187	9.24%
2	中国人寿保险(集团)公司	265,436,228	8.85%

3	中国人民财产保险股份有限公司	156,850,908	5.23%
4	中国太平洋保险公司	128,506,178	4.28%
5	新华人寿保险股份有限公司	103,057,890	3.44%
6	宝钢集团有限公司	73,170,000	2.44%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司	64,139,480	2.14%
8	全国社保基金一零九组合	59,309,824	1.98%
9	全国社保基金六零四组合	46,410,520	1.55%
10	全国社保基金六零一组合	41,160,991	1.37%

注：以上信息依据中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的基金持有人名册编制。

九、重大事件揭示

(一) 本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

(二) 本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(三) 本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。

(四) 经华夏基金管理有限公司第二届董事会 2006 年第二次会议决议，免去李操纲先生公司副总经理职务。

(五) 经华夏基金管理有限公司董事会、股东会决议，并报中国证监会核准，华夏基金管理有限公司现有股东变更为中信证券股份有限公司（出资 40.725%）、西南证券有限责任公司（出资 35.725%）、北京证券有限责任公司（出资 20%）和中国科技证券有限责任公司（出资 3.55%）。

(六) 2006 年 7 月 27 日，中国建设银行股份有限公司董事会召开会议，通过了委任张建国先生担任中国建设银行行长的议案；2006 年 10 月 20 日，中国建设银行股份有限公司举行 2006 年第一次临时股东大会，委任张建国先生为建行执行董事，同时出任副董事长。2006 年 7 月，常振明先生辞任建行副董事长、执行董事及行长的职务。

(七) 2006 年 12 月 28 日，中国建设银行股份有限公司根据工作需要，将“基金托管部”更名为“投资托管服务部”。

(八) 本报告期基金投资策略未发生改变。

(九) 本基金 2006 年末进行收益分配。

本基金管理人于 2006 年 12 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告，将《兴和证券投资基金基金合同》中“十七、基金收益与分配（三）基金收益分配原则”中的“1、基金收益分配比例不低于

基金净收益的 90%；2、基金收益分配采用现金形式，每年分配一次，分配在基金会计年度结束后的四个月内实施”修订为：“1、基金收益分配采用现金方式，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；2、基金年度收益分配比例不得低于基金年度可分配收益的 90%”。

(十) 本基金管理人于 2006 年 12 月 30 日发布更换旗下基金会计师事务所的公告，本基金的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所有限公司更换为德勤华永会计师事务所有限公司。本基金报告年度支付给德勤华永会计师事务所有限公司的报酬为 85,000.00 元人民币，目前该事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

1999 年至 2005 年由普华永道中天会计师事务所有限公司向本基金提供 7 年的连续审计服务。

(十一) 选择证券经营机构交易席位的情况

为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- 1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- 2、公司财务状况良好；
- 3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- 4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- 5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

根据以上标准，本期分别选择了申银万国证券、光大证券、中信建投证券、西南证券、国泰君安证券、江南证券、兴业证券、华泰证券、南方证券、天同证券、中信证券、国联证券和中银国际证券的席位作为兴和证券投资基金专用交易席位。其中中信证券、国联证券和中银国际证券的席位为本期新增的券商席位，北京证券（本报告期由招商证券接管北京证券经纪业务）、第一创业证券和平安证券的席位为本期剔除的券商席位。席位佣金为股票成交金额的 1‰扣除应由券商负担的交易手续费、证管费及结算风险金。

各席位交易量及佣金提取情况如下：

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日租用各券商席位的数量、股票交易量及佣金情况如下：

单位：元

序号	券商名称	租用该券商席位的数量	股票交易量	占股票交易总量比例	应付佣金	占应付佣金总量比例
1	中信建投	3	2,488,757,043.84	22.94%	2,009,488.63	23.05%
2	西南证券	1	1,732,613,406.69	15.97%	1,355,785.16	15.55%
3	光大证券	1	1,665,599,948.12	15.35%	1,360,958.17	15.61%
4	国泰君安	2	1,464,510,215.71	13.50%	1,178,406.33	13.52%
5	中信证券	1	1,295,657,586.84	11.94%	1,039,984.06	11.93%
6	华泰证券	1	1,168,452,313.16	10.77%	950,006.42	10.90%
7	申万证券	1	509,605,828.65	4.70%	414,280.12	4.75%
8	兴业证券	1	364,832,985.18	3.36%	285,485.66	3.27%
9	国联证券	1	111,182,403.30	1.02%	87,000.95	1.00%
10	中银国际证券	1	47,074,783.53	0.43%	36,836.38	0.42%
	合计	13	10,848,286,515.02	100.00%	8,718,231.88	100.00%

2006 年 1 月 1 日至 2006 年 12 月 31 日各券商债券、回购交易量情况如下：

单位：元

序号	券商名称	债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例
1	国泰君安	316,503,272.30	22.89%	1,907,000,000.00	17.68%
2	申万证券	276,031,848.60	19.97%	100,000,000.00	0.93%
3	中信证券	225,497,475.10	16.31%	5,532,300,000.00	51.28%
4	中信建投	180,718,275.00	13.07%	1,442,100,000.00	13.37%
5	华泰证券	118,421,526.90	8.57%	1,387,000,000.00	12.86%
6	光大证券	97,015,460.10	7.02%	420,000,000.00	3.89%
7	国联证券	93,309,533.60	6.75%	-	-
8	兴业证券	38,561,325.39	2.79%	-	-
9	招商证券	36,490,034.50	2.64%	-	-
	合计	1,382,548,751.49	100.00%	10,788,400,000.00	100.00%

(十二) 其他重大事件

1、本基金管理人于 2006 年 12 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票“宝新能源”的公告；

2、本基金管理人于 2006 年 12 月 30 日发布华夏基金管理有限公司关于更换旗下基金会计师事务所的公告；

3、本基金管理人于 2006 年 12 月 15 日发布华夏基金管理有限公司关于修改旗下封闭式基金收益分配条款的公告；

4、本基金管理人于 2006 年 10 月 28 日发布关于华夏基金管理有限公司股东变更的公告；

5、本基金管理人于 2006 年 6 月 12 日发布华夏基金管理有限公司深圳分公司迁址公告；

6、本基金管理人于 2006 年 6 月 1 日发布华夏基金管理有限公司关于旗下基金资产支持证券投资方案的公告；

7、本基金管理人于 2006 年 5 月 13 日发布公告，免去李操纲先生公司副总经理职务；

8、本基金管理人于 2006 年 4 月 13 日发布华夏基金管理有限公司上海分公司迁址公告。

投资者可通过《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 查阅上述公告。

十、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《兴和证券投资基金基金合同》；
- 3、《兴和证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司
二〇〇七年三月三十一日