

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型 证券投资基金 2008 年半年度报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

签发日期：二〇〇八年八月二十六日

目 录

一、	重要提示.....	3
二、	基金产品概况.....	3
	(一)、 基金概况.....	3
	(二)、 基金的投资.....	3
	(三)、 基金管理人.....	4
	(四)、 基金托管人.....	4
	(五)、 信息披露.....	5
	(六)、 其他有关资料.....	5
三、	主要财务指标和基金净值表现.....	5
	(一)、 主要财务指标.....	5
	(二)、 净值表现.....	6
四、	管理人报告.....	7
	(一)、 基金管理人及基金经理简介.....	7
	(二)、 基金运作合规性声明.....	8
	(三)、 公平交易专项说明.....	8
	(四)、 基金经理工作报告.....	8
五、	托管人报告.....	9
六、	财务会计报告.....	9
	(一)、 资产负债表（未经审计）.....	10
	(二)、 利润表（未经审计）.....	10
	(三)、 所有者权益（基金净值）变动表（未经审计）.....	11
	(四)、 会计报表附注.....	12
七、	投资组合报告.....	23
	(一)、 报告期末基金资产组合情况.....	23
	(二)、 股票投资组合.....	23
	(三)、 报告期末股票明细.....	24
	(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动.....	31
	(五)、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
	(六)、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明 细.....	33
	(七)、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证 券投资明细.....	33
	(八)、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明 细.....	33
	(九)、 投资组合报告附注.....	33
八、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	34
九、	开放式基金份额变动.....	35
十、	重大事件.....	35
十一、	备查文件目录.....	39

一、重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2008 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 6 月 30 日。

二、基金产品概况

(一)、基金概况

基金名称:	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
基金简称:	华安中国 A 股
交易代码:	040002
深交所行情代码	160402
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2002 年 11 月 8 日
期末基金份额总额:	5,941,239,410.76 份
基金存续期:	不定期

(二)、基金的投资

投资目标: 运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。

投资策略: (1) 资产配置: 本基金投资于股票的目标比例为

基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下，可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况，适当调整基金资产分配比例。

(2) 股票投资：本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。

(3) 其它投资：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的收益。

业绩比较基准： $95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$

风险收益特征：本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。

(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
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：40088-50099、021-68604666

(四)、 基金托管人

基金托管人：中国工商银行股份有限公司（以下简称“中国工商银行”）
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（邮政编码：100032）
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号（邮政编码：100032）

法定代表人：姜建清
信息披露负责人：蒋松云
联系电话：010-66106912
传真：010-66106904
电子邮箱：custody@icbc.com.cn

（五）、信息披露

信息披露报纸：中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址：<http://www.huaan.com.cn>
报告置备地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

（六）、其他有关资料

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

三、主要财务指标和基金净值表现

（一）、主要财务指标

序号	主要财务指标	2008 年 1 月 1 日至
		2008 年 6 月 30 日
1	本期利润	-3,273,282,430.95
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	-174,464,553.16
3	加权平均份额本期利润	-1.0584
4	期末可供分配利润	2,277,053,052.27
5	期末可供分配份额利润	0.3833
6	期末基金资产净值	4,561,277,281.89
7	期末基金份额净值	0.768
8	加权平均净值利润率	-55.78%
9	本期份额净值增长率	-44.23%
10	份额累计净值增长率	211.12%

提示：

1、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）。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)、净值表现
A、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

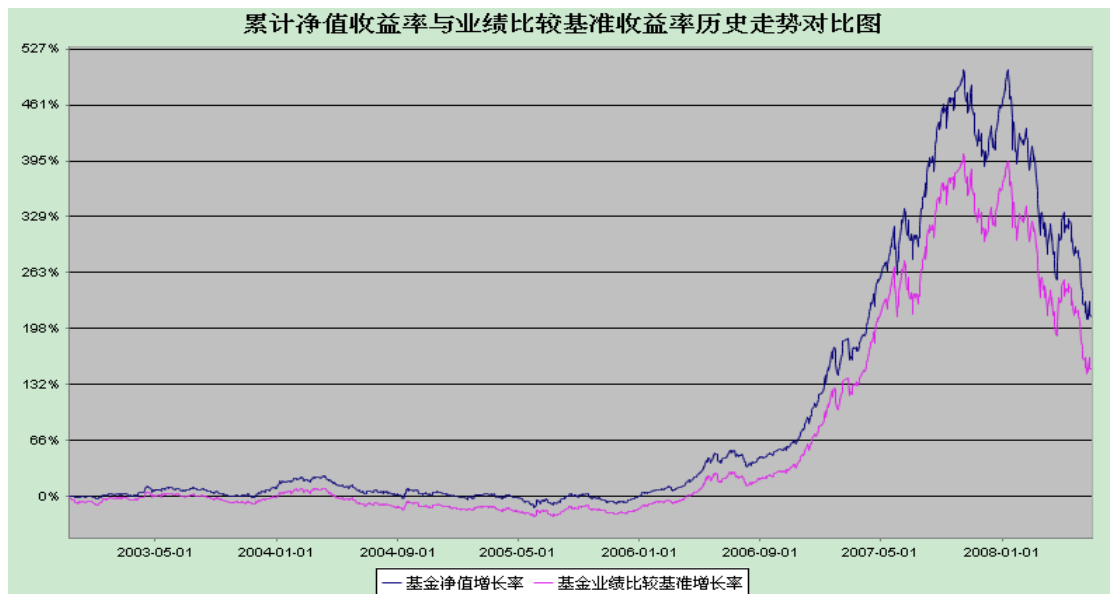
阶段	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
一个月	-19.92%	3.06%	-21.21%	3.26%	1.29%	-0.20%
三个月	-24.13%	3.03%	-25.28%	3.14%	1.15%	-0.11%
六个月	-44.23%	2.85%	-44.29%	2.93%	0.06%	-0.08%
一年	-22.50%	2.44%	-24.65%	2.49%	2.15%	-0.05%
三年	231.42%	1.90%	206.19%	1.95%	25.23%	-0.05%
自基金合同 生效起至今	211.12%	1.55%	148.31%	1.59%	62.81%	-0.04%

B、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2002 年 11 月 8 日至 2008 年 6 月 30 日)



根据《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》规定，本基金应自基金合同生效之日起3个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分基金的投资中三、投资范围；四、投资组合原则及选择标准（三）指数化增强性投资管理的限度和控制；六、投资限制的有关规定。

四、 管理人报告

(一)、 基金管理人及基金经理简介

1. 基金管理人

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、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 2008 年 6 月 30 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、华安收益、华安国际配置(QDII) 等 10 只开放式基金，管理资产规模达到 719.55 亿人民币、0.972 亿美元。

2. 基金经理

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘光华	本基金的基金经理	2005-05-25	-	11 年	工商管理硕士，11 年银行、基金从业经历。曾在农业银行上海分行国际部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究部高级研究员，2006 年 4 月至 2007 年 3 月担任上证 180ETF 基金经理，2005 年 5 月起担任本基金的基金经理，2007 年 3 月起同时担任华安中小盘成长（原安瑞证券投资基金）基金经理。
许之彦	本基金的基金经理、金融工程部负责人	2008-04-25	-	5 年	理学博士，5 年证券、基金从业经验。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月起担任本基金的基金经理。
刘瓔	本基金的基金经理	2008-04-25	-	7 年	管理学硕士，7 年证券从业经历。曾在交通银行工作，2001 年加入华安基金管理有限公司，历任市场部高级投资顾问、专户理财部客户主管、上证 180 交易型开放式指数证券投资基金经理助理。2007 年 3 月起担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2008 年 4 月起同时担任本基金的基金经理。

（二）、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

（三）、公平交易专项说明

（1）公平交易制度的执行情况

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，目前公司《交易端基金间公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。该模块已于 2004 年下半年正式上线使用，目前运作情况良好，未出现过例外情况。

对于场外交易，《交易端基金间公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，目前执行良好。

（2）本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为增强型指数基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

（3）异常交易行为的专项说明

本报告期内没有出现异常交易。

（四）、基金经理工作报告

1) 回顾

08 年上半年，A 股市场出现了较大幅度的下跌。其中 MSCI 中国 A 股指数跌幅为 46.65%，基金跌幅为 44.23%，基准跌幅 44.29%，略微超越基准 0.06%。跟踪偏离度为 0.2477%。

自网络经济泡沫破灭后，美国等采取了扩张性的货币政策，加上新兴市场经济整体快速增长，逐步催生了如信用市场、商品市场、房地产市场、股票市场等价格上涨，甚至于产生了泡沫。美国次贷问题爆发引发的信用危机持续蔓延，全球经济增速逐步放缓，另外，受到食品、能源等价格过快上涨下，全球通胀处在一个较高的水平。尽管如美联储等采取了积极应对的措施，但我们对中短期经济状况仍表示一定的担忧。

股改给 A 股市场带来的制度效应、上市公司微观层面持续的高增长、良好的外部经济环境等给市场赋予了较高的预期，2006-07 年市场出现超常的涨幅。自 07 年 10 月以来，全球市场在宽幅波动中下跌，欧美主要股市跌幅均超过 20%。A 股市场调整幅度超过 50%。在宏观经济趋缓下，周期性行业较高的估值难以维持，中游行业受到两端挤压利润空间在减少，高成长预期难以实现。

尽管 MSCI 中国 A 基金年初认识到了经济面临较大的困难和挑战，但仍然认识不足，在跟踪误差范围内没有能够更好的规避系统风险。二季度，我们采取动态积极的仓位控制策略，逐步取得一定的效果，但作为管理人，我们感到责任重大。

2) 展望

中国经济在经历了近 30 年持续高增长后，逐步成为经济强国，但面临的问题也日益突出。我们认为，在面临如能源资源瓶颈、外需减缓、内需相对较弱等挑战下，中国经济是否能够成功转型决定了未来 10 年甚至更长时间的可持续发展。产业结构的调整和经济转型是国家中长期发展的战略，经济的转型是个不破不立的过程，企业面临问题主要还要通过市场化的方式优胜劣汰来解决。在国内高通胀背景下，从紧的货币政策短期难以松动，但扩张性的财政政策覆盖面逐步拓宽。我们相信，中国经济能够逐步实现成功的转型，未来经济机遇大于挑战。

从估值的角度看。中国 A 股市场目前趋于合理，部分行业已蕴含了经济下行风险的预期。市场的风险主要来自于内外部经济减缓幅度、油价波动和通胀预期。

操作上，在有效跟踪市场和控制跟踪误差前提下，增强部分的操作将以经济转型主线，从产业发展的角度选择增强的行业，并深入挖掘具有抵御通胀、经济减弱和安全边际较高的公司。下半年，我们会继续勤勉尽责，在有效跟踪标的指数前提下，力争未来为投资者获得一定的超额回报，来回报持有人对我们的信任和支持。

五、 托管人报告

2008年上半年，本托管人在对华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2008年上半年，华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在所有重要方面的运作严格按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在2008年上半年所编制和披露的华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2008年8月20日

六、 财务会计报告

(除特殊注明外，单位：人民币元)

(一)、 资产负债表 (未经审计)

项 目	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
资产:			
银行存款		90,832,092.88	236,558,224.18
结算备付金		6,529,769.97	5,400,322.55
存出保证金		1,491,735.93	909,192.84
交易性金融资产	8(1)	4,332,553,300.71	6,146,472,250.98
其中: 股票投资		4,138,738,559.51	5,921,604,704.98
债券投资		193,814,741.20	224,867,546.00
衍生金融资产	8(2)	2,879,927.26	538,709.32
应收证券清算款		100,748,386.25	412,066.15
应收股利		2,846,729.75	-
应收利息	8(3)	2,561,088.98	5,755,933.05
应收申购款		41,557,108.42	43,166,105.67
资产总计		<u>4,582,000,140.15</u>	<u>6,439,212,804.74</u>
负债:			
应付证券清算款		-	12,168,138.62
应付赎回款		11,898,098.73	31,773,230.88
应付管理人报酬		4,174,195.30	4,900,531.16
应付托管费		834,839.10	980,106.23
应付交易费用	8(4)	3,102,894.33	2,493,956.88
其他负债	8(5)	712,830.80	800,000.00
负债合计		<u>20,722,858.26</u>	<u>53,115,963.77</u>
所有者权益:			
实收基金	8(6)	1,810,353,705.65	1,413,053,092.04
未分配利润	8(13)	2,750,923,576.24	4,973,043,748.93
所有者权益合计		<u>4,561,277,281.89</u>	<u>6,386,096,840.97</u>
负债和所有者权益总计		<u>4,582,000,140.15</u>	<u>6,439,212,804.74</u>
基金份额总额(份)		5,941,239,410.76	1,413,053,092.04
基金份额净值		0.768	4.519

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、 利润表 (未经审计)

项 目	附注	2008年1月1日至 2008年6月30日	2007年1月1日至 2007年6月30日
收入:			
利息收入		4,974,310.18	1,114,249.69

其中：存款利息收入		1,266,811.76	573,787.94
债券利息收入		3,707,498.42	540,461.75
投资收益		-124,328,035.82	344,297,797.43
其中：股票投资收益	8(7)	-155,905,330.15	332,536,815.10
债券投资收益	8(8)	777,451.66	384,900.52
衍生工具收益	8(9)	405,696.14	128,437.06
股利收益		30,394,146.53	11,247,644.75
公允价值变动收益	8(10)	-3,098,817,877.79	435,811,262.95
其他收入		-	-
收入合计		-3,218,171,603.43	781,223,310.07

费用：

管理人报酬	7(3)	29,321,030.27	7,486,925.96
托管费	7(3)	5,864,206.07	1,497,385.22
交易费用	8(11)	18,777,280.53	6,886,251.84
利息支出		921,438.10	349,480.48
其中：卖出回购金融资产支出		921,438.10	349,480.48
其他费用	8(12)	226,872.55	199,152.41
费用合计		55,110,827.52	16,419,195.91

利润总额		-3,273,282,430.95	764,804,114.16
------	--	-------------------	----------------

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、所有者权益(基金净值)变动表（未经审计）

	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	1,413,053,092.04	4,973,043,748.93	6,386,096,840.97
本期经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	-	-3,273,282,430.95	-3,273,282,430.95
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	397,300,613.61	1,051,162,258.26	1,448,462,871.87
其中：基金申购款	1,437,348,286.38	3,795,782,150.73	5,233,130,437.11
基金赎回款	-1,040,047,672.77	-2,744,619,892.47	-3,784,667,565.24
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-	-
期末所有者权益(基金净值)	1,810,353,705.65	2,750,923,576.24	4,561,277,281.89

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间		
实收基金	未分配利润	所有者权益合计

期初所有者权益(基金净值)	520,760,979.21	459,111,419.77	979,872,398.98
本期经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	-	764,804,114.16	764,804,114.16
本期基金份额交易产生的基金净值变动数	295,900,812.82	766,201,011.07	1,062,101,823.89
其中: 基金申购款	1,106,018,702.28	2,233,766,633.21	3,339,785,335.49
基金赎回款	-810,117,889.46	-1,467,565,622.14	-2,277,683,511.60
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-150,753,096.03	-150,753,096.03
期末所有者权益(基金净值)	816,661,792.03	1,839,363,448.97	2,656,025,241.00

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、 会计报表附注

1、 基金基本情况

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金(2006年1月9日前原名为华安上证180指数增强型证券投资基金,以下简称“本基金”)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[2002]第70号《关于同意华安上证180指数增强型证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证180指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证180指数增强型证券投资基金基金合同》)发起,并于2002年11月8日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,094,001,258.61元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第126号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据2006年1月14日发布的《关于华安上证180指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》,并经中国证监会证监基金字[2006]8号《关于核准华安上证180指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,本基金自2006年1月9日起更名为华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金,跟踪标的的成份指数由上证180指数变更为MSCI中国A股指数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国A股市场的MSCI中国A股指数的成份股。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%,投资标的指数成份股的比重在50个交易日内不持续低于股票净值的80%;此外,本基金可参与股票一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股,在成份股之外的股票投资仅限于未售出的配售新股、预期将调

整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成分股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率 \times 95%+金融同业存款利率 \times 5%。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《华安基金管理有限公司关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 3.281806547，并于 2007 年 4 月 30 日进行了份额变更登记。

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 8 月 26 日批准报出。

2、 财务报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部于 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》及《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3、 遵循企业会计准则的声明

本基金 2008 年半年度财务报告符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2008 年 6 月 30 日的财务状况以及 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4、 主要会计政策、会计估计及其变更

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。自 2007 年 7 月 1 日起，本基金执行新会计准则及中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、修改后的基金合同及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。本基金已按照《企业会计准则第 38 号-首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及其他相关规定，对 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止期间(以下简称“2007 年上半年”)的财务报表予以追溯调整。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《华安基金管理有限公司关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，本基金已按照基金份额拆分于拆分日按拆分前的基金份额数及拆分比例，计算增加的基金份额数，在实收基金科目的数量栏记录的方法进行会计处理。

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[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、2008 年 4 月 23 日财政部、国家税务总局发布的《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:

- (a) 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。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (c) 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。
- (d) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日前按 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税, 自 2008 年 4 月 24 日起, 按 0.1% 的税率缴纳。

6、重大会计差错的内容和更正金额

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 (“华安基金公司”)	基金管理人 基金销售机构 基金注册登记机构	提取管理费	基金合同
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	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		
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). 与关联方进行的交易

- ① 本报告期通过关联人席位的股票成交量: 无。
2007 年上半年通过关联人席位的股票成交量: 无。
- ② 本报告期通过关联人席位的债券、回购和权证成交量: 无。
2007 年上半年通过关联人席位的债券、回购和权证成交量: 无。
- ③ 本报告期与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况: 无。
2007 年上半年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

支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

本基金在本半年度需支付管理人报酬 29,321,030.27 元(2007 年上半年：7,486,925.96 元)。

② 基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

本基金在本年度需支付托管费 5,864,206.07 元(2007 年上半年：1,497,385.22 元)。

(4). 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。基金托管人于 2008 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 90,832,092.88 元(2007 年上半年末：139,680,107.06 元)。本半年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 967,708.44 元(2007 年上半年：387,898.18 元)。

(5). 基金各关联方投资本基金的情况

① 基金管理公司投资本基金的情况：

2008 年上半年度基金管理有限公司均未投资本基金、均未持有本基金。

② 基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况：

2008 年上半年末基金管理公司主要股东及其控制的机构均未投资本基金、均未持有本基金。

8、基金会计报表重要项目的说明

(1) 交易性金融资产项目说明：

明细项目	2008 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
股票投资	5,665,772,709.62	4,138,738,559.51	-1,527,034,150.11
债券投资：	193,980,584.34	193,814,741.20	-165,843.14
—交易所	11,390,584.34	11,213,741.20	-176,843.14
—银行间市场	182,590,000.00	182,601,000.00	11,000.00
合计	5,859,753,293.96	4,332,553,300.71	-1,527,199,993.25

(2) 衍生金融资产项目说明:

明细项目	2008 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	估值增值
权证投资	3,560,415.66	2,879,927.26	-680,488.40
合计	3,560,415.66	2,879,927.26	-680,488.40

(3) 应收利息项目说明:

明细项目	2008 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	40,299.60
应收结算备付金利息	2,644.56
应收申购款利息	4,933.60
应收债券利息	2,513,211.22
合计	2,561,088.98

(4) 应付交易费用项目说明:

明细项目	2008 年 6 月 30 日
应付银行间交易费用	5,384.79
应付交易所交易佣金	3,097,509.54
其中: 申银万国证券股份有限公司	225,191.70
招商证券股份有限公司	299,067.97
广发证券股份有限公司	491,323.67
国泰君安证券股份有限公司	290,584.83
中信建投证券有限责任公司	376,303.07
中国银河证券股份有限公司	1,415,038.30
合计	3,102,894.33

(5) 其他负债项目说明:

明细项目	2008 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
预提审计费用	63,650.86
预提信息披露费	149,179.94
合计	712,830.80

(6) 实收基金项目说明:

	基金份额	金额
2007 年 12 月 31 日	1, 413, 053, 092. 04	1, 413, 053, 092. 04
本期申购	1, 023, 602, 147. 93	1, 023, 602, 147. 93
本期赎回	685, 197, 382. 00	685, 197, 382. 00
2008 年 4 月 29 日拆分前	1, 751, 457, 857. 97	1, 751, 457, 857. 97
基金份额拆分调整份额	3, 996, 488, 007. 87	-
本期申购	1, 357, 963, 913. 15	413, 746, 138. 45
本期赎回	1, 164, 670, 368. 23	354, 850, 290. 77
2008 年 6 月 30 日	5, 941, 239, 410. 76	1, 810, 353, 705. 65

(7) 股票投资收益项目说明:

明细项目	本报告期
卖出股票成交总额	2, 328, 656, 671. 78
减: 卖出股票成本总额	2, 484, 562, 001. 93
股票投资收益	-155, 905, 330. 15

(8) 债券投资收益项目说明:

明细项目	本报告期
卖出及到期兑付债券结算金额	369, 445, 885. 31
减: 应收利息总额	6, 868, 087. 29
减: 卖出及到期兑付债券成本总额	361, 800, 346. 36
债券投资收益	777, 451. 66

(9) 衍生工具投资收益项目说明:

明细项目	本报告期
卖出权证成交金额	3, 158, 176. 22
减: 卖出权证成本总额	2, 752, 480. 08
衍生工具投资收益项目	405, 696. 14

(10) 公允价值变动收益/损失项目说明:

项目名称	本报告期
交易性金融资产	-3, 098, 817, 877. 79
——股票投资	-3, 097, 514, 917. 37
——债券投资	-556, 983. 28
——权证投资	-745, 977. 14
合计	-3, 098, 817, 877. 79

(11) 交易费用:

明细项目	本报告期

交易所市场	18,774,230.53
银行间市场	3,050.00
合计	18,777,280.53

(12) 其他费用：

明细项目	本报告期
银行汇划费用	5,041.75
信息披露费	149,179.94
审计费	63,650.86
帐户维护费	9,000.00
合计	226,872.55

(13) 收益分配：无

9、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

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 2008 年 6 月 30 日止投资的流通受限制的股票情况如下：

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	流通受限类型	申购价格	年末估值单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
002258	利尔化学	08/6/30	08/7/8	新股网上申购	16.06	16.06	5,000	80,300.00	80,300.00
合计								80,300.00	80,300.00

截至 2008 年 6 月 30 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	年末估值单价	停牌原因	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
600900	长江电力	2008/5/8	14.65	公布重大事项	未知	未知	6,005,569	91,537,110.29	87,981,585.85
000792	盐湖钾肥	2008/6/26	88.12	重大资产重组	未知	未知	675,200	38,900,574.83	59,498,624.00
600655	豫园商城	2008/2/25	32.44	定向增发	2008/7/28	29.20	633,114		

								18,471,577.75	20,538,218.16
600096	云天化	2008/3/24	61.60	重大资产重组	未知	未知	246,300	6,195,204.67	15,172,080.00
600415	小商品城	2008/6/27	92.50	非公开增发	2008/7/4	92.30	101,520	9,059,249.88	9,390,600.00
000425	徐工科技	2008/6/13	14.59	重大资产重组	2008/7/25	12.98	569,087	8,380,016.36	8,302,979.33
600643	爱建股份	2008/6/23	9.91	重大资产重组	2008/7/8	10.90	458,532	5,975,268.94	4,544,052.12
000024	招商地产	2008/6/30	14.94	公开增发	2008/7/1	14.50	289,807	8,898,817.55	4,329,716.58
合计								187,417,820.27	209,757,856.04

2) 流通受限制不能自由转让的债券

基金认购新发行分离交易可转债，从债券认购日至债券上市日期间，暂无法流通。本基金截至 2008 年 6 月 30 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	年末估值		年末成本总额	年末估值总额	
					本	单价			
12601608	宝钢债	2008-6-20	2008-7-4	76.27	75.08	147,150	11,223,406.35	11,048,022.00	
12601708	葛洲债	2008-6-26	2008-7-11	70.84	70.22	2,360	167,177.99	165,719.20	
合计								11,390,584.34	11,213,741.20

3) 流通受限制不能自由转让的权证

基金认购新发行分离交易可转债，从权证获配日至权证上市日期间，暂无法流通。本基金截至 2008 年 6 月 30 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	年末估值		年末成本总额	年末估值总额	
					本	单价			
580024	宝钢 CWB1	2008-6-20	2008-7-4	1.48	1.197	2,354,400	3,491,593.65	2,818,216.80	
580025	葛洲 CWB1	2008-6-26	2008-7-11	1.34	1.205	51,212	68,822.01	61,710.46	
合计								3,560,415.66	2,879,927.26

4) 截至 2008 年 6 月 30 日，债券正回购交易中作为质押的债券：无。

5) 截至 2008 年 6 月 30 日，买断式逆回购交易中取得的债券：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，因此除在附注流通受限制不能自由转让的基金资产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，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股，投资组合中股票投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2008 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2008 年 6 月 30 日		2007 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	4,138,738,559.51	90.74%	5,921,604,704.98	92.73%
- 债券投资	193,814,741.20	4.25%	224,867,546.00	3.52%
衍生金融资产	2,879,927.26	0.06%	538,709.32	0.01%
	<u>4,335,433,227.97</u>	<u>95.05%</u>	<u>6,147,010,960.30</u>	<u>96.26%</u>

于 2008 年 6 月 30 日，若本基金业绩比较基准的公允价值上升 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 2.25 亿元（2007 年 6 月 30 日为：1.30 亿元）；反之，若本基金业绩比较基准的公允价值下降 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 2.25 亿元（2007 年 6 月 30 日为：1.30 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、结算备付金及债券投资等。本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，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2008 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	90,832,092.88	-	-	-	90,832,092.88
结算备付金	6,529,769.97	-	-	-	6,529,769.97

存出保证金	-	-	-	1,491,735.93	1,491,735.93
交易性金融资产	182,601,000.00	-	11,213,741.20	4,138,738,559.51	4,332,553,300.71
衍生金融资产	-	-	-	2,879,927.26	2,879,927.26
应收证券清算款	-	-	-	100,748,386.25	100,748,386.25
应收利息	-	-	-	2,561,088.98	2,561,088.98
应收股利	-	-	-	2,846,729.75	2,846,729.75
应收申购款	-	-	-	41,557,108.42	41,557,108.42
资产总计	279,962,862.85	-	11,213,741.20	4,290,823,536.10	4,582,000,140.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,898,098.73	11,898,098.73
应付管理人报酬	-	-	-	4,174,195.30	4,174,195.30
应付托管费	-	-	-	834,839.10	834,839.10
应付交易费用	-	-	-	3,102,894.33	3,102,894.33
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	712,830.80	712,830.80
负债总计	-	-	-	20,722,858.26	20,722,858.26
利率敏感度缺口	279,962,862.85	-	11,213,741.20	4,270,100,677.84	4,561,277,281.89

2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	236,558,224.18	-	-	-	236,558,224.18
结算备付金	5,400,322.55	-	-	-	5,400,322.55
存出保证金	-	-	-	909,192.84	909,192.84
交易性金融资产	223,685,000.00	-	1,182,546.00	5,921,604,704.98	6,146,472,250.98
衍生金融资产	-	-	-	538,709.32	538,709.32
应收证券清算款	-	-	-	412,066.15	412,066.15
应收利息	-	-	-	5,755,933.05	5,755,933.05
应收申购款	-	-	-	43,166,105.67	43,166,105.67
资产总计	465,643,546.73	-	1,182,546.00	5,972,386,712.01	6,439,212,804.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,168,138.62	12,168,138.62
应付赎回款	-	-	-	31,773,230.88	31,773,230.88
应付管理人报酬	-	-	-	4,900,531.16	4,900,531.16
应付托管费	-	-	-	980,106.23	980,106.23
应付交易费用	-	-	-	2,493,956.88	2,493,956.88
其他负债	-	-	-	800,000.00	800,000.00
负债总计	-	-	-	53,115,963.77	53,115,963.77
利率敏感度缺口	465,643,546.73	-	1,182,546.00	5,919,270,748.24	6,386,096,840.97

于 2008 年 6 月 30 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（2007 年 6 月 30 日：同）。

(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。

七、投资组合报告

(一)、 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额 (元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益类投资	4,138,738,559.51	90.33
	其中：股票	4,138,738,559.51	90.33
2	固定收益类投资	193,814,741.20	4.23
	其中：债券	193,814,741.20	4.23
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	2,879,927.26	0.06
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	97,361,862.85	2.12
6	其他资产	149,205,049.33	3.26
	合计	4,582,000,140.15	100.00

(二)、 股票投资组合

1、 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	6,741,024.00	0.15
B	采掘业	333,631,664.68	7.31
C	制造业	1,517,862,548.16	33.28
C0	食品、饮料	184,527,114.46	4.05
C1	纺织、服装、皮毛	18,936,081.98	0.42
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	23,690,810.00	0.52
C4	石油、化学、塑胶、塑料	266,361,655.75	5.84
C5	电子	10,793,176.00	0.24
C6	金属、非金属	426,364,183.57	9.35
C7	机械、设备、仪表	423,111,347.24	9.28
C8	医药、生物制品	160,938,977.58	3.53
C99	其他制造业	3,139,201.58	0.07
D	电力、煤气及水的生产和供应业	155,612,676.29	3.41
E	建筑业	72,790,435.62	1.60

F	交通运输、仓储业	244,239,382.35	5.35
G	信息技术业	320,952,278.51	7.04
H	批发和零售贸易	235,985,612.64	5.17
I	金融、保险业	836,608,051.26	18.34
J	房地产业	200,058,632.36	4.39
K	社会服务业	42,581,453.86	0.93
L	传播与文化产业	12,534,365.44	0.27
M	综合类	76,820,435.60	1.68
	合计	4,056,418,560.77	88.93

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	50,393,632.53	1.10
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	80,300.00	0.00
C5	电子	26,745,611.31	0.59
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	17,960,661.72	0.39
C8	医药、生物制品	5,607,059.50	0.12
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	12,067,369.77	0.26
H	批发和零售贸易	11,525,132.00	0.25
I	金融、保险业	8,333,864.44	0.18
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	82,319,998.74	1.80

（三）、报告期末股票明细

1. 指数型投资

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	9,129,024	213,801,742.08	4.69%
2	600000	浦发银行	6,932,688	152,519,136.00	3.34%
3	000002	万科A	12,770,186	115,059,375.86	2.52%
4	600050	中国联通	15,536,299	103,627,114.33	2.27%
5	601939	建设银行	16,189,123	95,677,716.93	2.10%
6	600016	民生银行	16,723,457	95,323,704.90	2.09%
7	600030	中信证券	3,813,053	91,208,227.76	2.00%
8	601318	中国平安	1,792,866	88,316,579.16	1.94%
9	600900	长江电力	6,005,569	87,981,585.85	1.93%
10	000063	中兴通讯	1,337,205	83,709,033.00	1.84%
11	600019	宝钢股份	8,767,256	76,362,799.76	1.67%
12	000422	湖北宜化	4,067,129	69,791,933.64	1.53%
13	601088	中国神华	1,850,000	69,504,500.00	1.52%
14	600005	武钢股份	6,973,135	68,057,797.60	1.49%
15	601857	中国石油	4,474,928	66,855,424.32	1.47%
16	000001	深发展A	3,350,906	64,773,012.98	1.42%
17	000792	盐湖钾肥	675,200	59,498,624.00	1.30%
18	002024	苏宁电器	1,403,236	57,953,646.80	1.27%
19	600519	贵州茅台	416,150	57,670,067.00	1.26%
20	600028	中国石化	5,142,871	52,200,140.65	1.14%
21	601006	大秦铁路	3,771,950	51,336,239.50	1.13%
22	000538	云南白药	1,708,978	46,296,214.02	1.01%
23	601919	中国远洋	2,265,442	44,742,479.50	0.98%
24	600309	烟台万华	2,311,804	43,300,088.92	0.95%
25	600585	海螺水泥	1,059,541	42,371,044.59	0.93%
26	000983	西山煤电	772,542	38,627,100.00	0.85%
27	000680	山推股份	2,957,620	32,918,310.60	0.72%
28	601186	中国铁建	3,216,600	30,107,376.00	0.66%
29	000839	中信国安	2,260,162	29,540,317.34	0.65%
30	600428	中远航运	1,135,951	29,171,221.68	0.64%
31	600588	用友软件	1,028,018	28,753,663.46	0.63%
32	600583	海油工程	1,255,711	27,361,942.69	0.60%
33	000527	美的电器	2,279,774	27,243,299.30	0.60%
34	000858	五粮液	1,494,845	27,236,075.90	0.60%
35	000651	格力电器	861,775	26,973,557.50	0.59%
36	600456	宝钛股份	1,094,236	26,765,012.56	0.59%
37	600694	大商股份	741,099	25,419,695.70	0.56%
38	600196	复星医药	2,048,790	24,769,871.10	0.54%
39	600271	航天信息	915,734	24,450,097.80	0.54%
40	600026	中海发展	1,179,900	23,468,211.00	0.51%
41	000568	泸州老窖	772,738	23,251,686.42	0.51%
42	000898	鞍钢股份	1,705,068	22,217,036.04	0.49%
43	600320	振华港机	2,135,661	22,146,804.57	0.49%
44	600100	同方股份	1,211,384	21,962,391.92	0.48%

45	600655	豫园商城	633,114	20,538,218.16	0.45%
46	600089	特变电工	1,370,003	20,495,244.88	0.45%
47	600169	太原重工	911,602	20,419,884.80	0.45%
48	000061	农产品	1,004,429	20,349,731.54	0.45%
49	600739	辽宁成大	809,257	20,101,943.88	0.44%
50	000528	柳工	1,039,843	20,016,977.75	0.44%
51	000629	攀钢钢钒	2,163,950	19,886,700.50	0.44%
52	600008	首创股份	2,374,958	18,738,418.62	0.41%
53	600361	华联综超	1,034,545	18,673,537.25	0.41%
54	600600	青岛啤酒	924,954	18,573,076.32	0.41%
55	601390	中国中铁	3,550,000	18,460,000.00	0.40%
56	600887	伊利股份	1,111,200	18,145,896.00	0.40%
57	600316	洪都航空	1,128,554	17,616,727.94	0.39%
58	600269	赣粤高速	1,770,335	17,331,579.65	0.38%
59	600660	福耀玻璃	2,722,452	17,233,121.16	0.38%
60	000768	西飞国际	1,006,189	17,125,336.78	0.38%
61	600881	亚泰集团	1,950,000	16,906,500.00	0.37%
62	600066	宇通客车	1,238,869	16,439,791.63	0.36%
63	000402	金融街	2,145,076	15,766,308.60	0.35%
64	600859	王府井	407,048	15,622,502.24	0.34%
65	000069	华侨城 A	1,542,049	15,590,115.39	0.34%
66	600489	中金黄金	311,958	15,544,867.14	0.34%
67	600096	云天化	246,300	15,172,080.00	0.33%
68	600308	华泰股份	1,150,370	14,954,810.00	0.33%
69	600770	综艺股份	975,525	14,564,588.25	0.32%
70	600737	中粮屯河	887,482	14,563,579.62	0.32%
71	600009	上海机场	916,580	14,500,295.60	0.32%
72	000423	东阿阿胶	557,140	14,374,212.00	0.32%
73	600808	马钢股份	2,677,911	14,300,044.74	0.31%
74	600717	天津港	1,033,175	14,216,488.00	0.31%
75	000933	神火股份	403,094	14,108,290.00	0.31%
76	000060	中金岭南	983,365	13,786,777.30	0.30%
77	600550	天威保变	446,000	13,745,720.00	0.30%
78	600058	五矿发展	586,450	13,728,794.50	0.30%
79	600685	广船国际	539,906	13,638,025.56	0.30%
80	600104	上海汽车	1,710,729	13,429,222.65	0.29%
81	601628	中国人寿	558,428	13,357,597.76	0.29%
82	000709	唐钢股份	1,221,600	13,010,040.00	0.29%
83	600596	新安股份	211,270	12,769,158.80	0.28%
84	600383	金地集团	1,385,380	12,565,396.60	0.28%
85	000825	太钢不锈	1,134,012	12,281,349.96	0.27%
86	000623	吉林敖东	374,455	12,278,379.45	0.27%
87	000541	佛山照明	1,649,591	12,239,965.22	0.27%
88	600352	浙江龙盛	808,392	12,190,551.36	0.27%

89	600879	火箭股份	1,000,000	11,820,000.00	0.26%
90	000027	深圳能源	1,397,971	11,673,057.85	0.26%
91	600875	东方电气	373,892	11,123,287.00	0.24%
92	600690	青岛海尔	1,254,200	11,087,128.00	0.24%
93	000338	潍柴动力	267,038	10,761,631.40	0.24%
94	600001	邯郸钢铁	2,343,615	10,757,192.85	0.24%
95	000157	中联重科	775,700	10,743,445.00	0.24%
96	600177	雅戈尔	985,352	10,090,004.48	0.22%
97	600832	东方明珠	950,121	10,071,282.60	0.22%
98	600276	恒瑞医药	288,494	10,068,440.60	0.22%
99	600325	华发股份	943,353	10,027,842.39	0.22%
100	000800	一汽轿车	1,248,100	9,909,914.00	0.22%
101	000401	冀东水泥	791,299	9,851,672.55	0.22%
102	600997	开滦股份	241,961	9,673,600.78	0.21%
103	600795	国电电力	1,492,328	9,595,669.04	0.21%
104	600415	小商品城	101,520	9,390,600.00	0.21%
105	600062	双鹤药业	346,370	9,126,849.50	0.20%
106	000031	中粮地产	800,000	8,944,000.00	0.20%
107	000012	南玻 A	594,800	8,808,988.00	0.19%
108	000488	晨鸣纸业	840,000	8,736,000.00	0.19%
109	600895	张江高科	936,000	8,686,080.00	0.19%
110	600797	浙大网新	1,422,566	8,677,652.60	0.19%
111	600015	华夏银行	935,919	8,638,532.37	0.19%
112	600631	百联股份	735,537	8,635,204.38	0.19%
113	600010	包钢股份	2,165,600	8,575,776.00	0.19%
114	601988	中国银行	2,085,864	8,447,749.20	0.19%
115	000425	徐工科技	569,087	8,302,979.33	0.18%
116	601333	广深铁路	1,950,000	8,151,000.00	0.18%
117	600123	兰花科创	318,891	8,067,942.30	0.18%
118	600628	新世界	908,300	7,965,791.00	0.17%
119	600031	三一重工	285,030	7,926,684.30	0.17%
120	600331	宏达股份	337,719	7,811,440.47	0.17%
121	600037	歌华有线	567,180	7,452,745.20	0.16%
122	600219	南山铝业	706,231	7,450,737.05	0.16%
123	600011	华能国际	1,053,826	7,408,396.78	0.16%
124	600635	大众公用	730,184	7,374,858.40	0.16%
125	600642	申能股份	808,328	7,299,201.84	0.16%
126	600312	平高电气	805,381	7,288,698.05	0.16%
127	600820	隧道股份	871,000	7,229,300.00	0.16%
128	600118	中国卫星	431,700	7,222,341.00	0.16%
129	000039	中集集团	663,721	7,181,461.22	0.16%
130	600718	东软集团	250,626	7,045,096.86	0.15%
131	000729	燕京啤酒	417,612	7,015,881.60	0.15%
132	000895	双汇发展	185,912	6,934,517.60	0.15%

133	600598	北大荒	421,314	6,741,024.00	0.15%
134	000698	沈阳化工	447,300	6,722,919.00	0.15%
135	000088	盐田港	903,000	6,718,320.00	0.15%
136	600282	南钢股份	1,360,270	6,706,131.10	0.15%
137	000869	张裕A	97,648	6,444,768.00	0.14%
138	600761	安徽合力	487,801	6,258,486.83	0.14%
139	600018	上港集团	1,300,000	6,240,000.00	0.14%
140	601866	中海集运	1,292,400	6,035,508.00	0.13%
141	600188	兖州煤业	303,100	6,007,442.00	0.13%
142	601588	北辰实业	932,600	5,838,076.00	0.13%
143	000951	中国重汽	360,449	5,767,184.00	0.13%
144	000539	粤电力A	900,000	5,724,000.00	0.13%
145	000759	武汉中百	588,000	5,680,080.00	0.12%
146	600085	同仁堂	283,687	5,648,208.17	0.12%
147	600256	广汇股份	421,000	5,565,620.00	0.12%
148	600675	中华企业	786,384	5,559,734.88	0.12%
149	600315	上海家化	194,160	5,543,268.00	0.12%
150	600500	中化国际	500,608	5,476,651.52	0.12%
151	600362	江西铜业	241,900	5,445,169.00	0.12%
152	600029	南方航空	759,934	5,410,730.08	0.12%
153	600780	通宝能源	1,115,075	5,408,113.75	0.12%
154	600547	山东黄金	104,120	5,367,386.00	0.12%
155	000731	四川美丰	687,071	5,324,800.25	0.12%
156	600161	天坛生物	420,000	5,258,400.00	0.12%
157	600143	金发科技	307,963	5,241,530.26	0.11%
158	000410	沈阳机床	709,232	5,163,208.96	0.11%
159	600299	蓝星新材	323,050	5,155,878.00	0.11%
160	000707	双环科技	453,986	5,134,581.66	0.11%
161	000917	电广传媒	314,068	5,081,620.24	0.11%
162	600581	八一钢铁	558,532	5,049,129.28	0.11%
163	600811	东方集团	649,065	4,991,309.85	0.11%
164	000559	万向钱潮	868,500	4,880,970.00	0.11%
165	600153	建发股份	337,410	4,835,085.30	0.11%
166	600048	保利地产	356,447	4,808,470.03	0.11%
167	600497	驰宏锌锗	307,400	4,743,182.00	0.10%
168	600170	上海建工	510,000	4,676,700.00	0.10%
169	600022	济南钢铁	454,710	4,669,871.70	0.10%
170	600582	天地科技	194,994	4,617,457.92	0.10%
171	600072	中船股份	373,556	4,579,796.56	0.10%
172	600643	爱建股份	458,532	4,544,052.12	0.10%
173	000400	许继电气	513,800	4,521,440.00	0.10%
174	600521	华海药业	260,391	4,507,368.21	0.10%
175	000758	中色股份	318,579	4,447,362.84	0.10%
176	000937	金牛能源	100,000	4,418,000.00	0.10%

177	000024	招商地产	289,807	4,329,716.58	0.09%
178	600027	华电国际	884,423	4,289,451.55	0.09%
179	601168	西部矿业	297,125	4,278,600.00	0.09%
180	600357	承德钒钛	576,089	4,263,058.60	0.09%
181	600649	城投控股	420,000	4,254,600.00	0.09%
182	600267	海正药业	261,678	4,231,333.26	0.09%
183	600138	中青旅	248,223	4,207,379.85	0.09%
184	000999	S 三 九	250,000	4,152,500.00	0.09%
185	600812	华北制药	584,566	4,127,035.96	0.09%
186	600839	四川长虹	812,000	4,076,240.00	0.09%
187	600535	天士力	348,649	3,936,247.21	0.09%
188	002007	华兰生物	94,820	3,921,755.20	0.09%
189	600380	健康元	690,000	3,891,600.00	0.09%
190	600220	江苏阳光	595,975	3,873,837.50	0.08%
191	600688	S 上石化	582,000	3,742,260.00	0.08%
192	600068	葛洲坝	492,000	3,704,760.00	0.08%
193	600348	国阳新能	80,000	3,608,800.00	0.08%
194	600886	国投电力	515,230	3,488,107.10	0.08%
195	000630	铜陵有色	310,000	3,422,400.00	0.08%
196	000652	泰达股份	547,400	3,366,510.00	0.07%
197	000822	山东海化	391,069	3,249,783.39	0.07%
198	600663	陆家嘴	238,744	3,249,305.84	0.07%
199	000036	华联控股	920,000	3,238,400.00	0.07%
200	000625	长安汽车	666,232	3,237,887.52	0.07%
201	600067	冠城大通	447,939	3,216,202.02	0.07%
202	000089	深圳机场	520,000	3,187,600.00	0.07%
203	000501	鄂武商 A	357,600	3,182,640.00	0.07%
204	600601	方正科技	616,174	3,173,296.10	0.07%
205	600508	上海能源	181,568	3,146,573.44	0.07%
206	600266	北京城建	261,654	3,027,336.78	0.07%
207	600602	广电电子	718,960	3,019,632.00	0.07%
208	600418	江淮汽车	750,000	2,992,500.00	0.07%
209	600755	厦门国贸	200,000	2,984,000.00	0.07%
210	600098	广州控股	500,000	2,945,000.00	0.06%
211	000927	一汽夏利	670,605	2,816,541.00	0.06%
212	600307	酒钢宏兴	293,488	2,796,940.64	0.06%
213	600064	南京高科	200,000	2,748,000.00	0.06%
214	000581	威孚高科	310,790	2,669,686.10	0.06%
215	000677	山东海龙	580,000	2,656,400.00	0.06%
216	600350	山东高速	503,000	2,605,540.00	0.06%
217	600183	生益科技	429,100	2,531,690.00	0.06%
218	000939	凯迪电力	269,469	2,519,535.15	0.06%
219	600616	第一食品	179,070	2,342,235.60	0.05%
220	600004	白云机场	227,000	2,331,290.00	0.05%

221	600517	置信电气	98,013	2,259,199.65	0.05%
222	600849	上海医药	330,730	2,225,812.90	0.05%
223	000518	四环生物	566,600	2,124,750.00	0.05%
224	600210	紫江企业	501,485	2,116,266.70	0.05%
225	600779	水井坊	100,700	2,100,602.00	0.05%
226	600639	浦东金桥	200,000	2,062,000.00	0.05%
227	000690	宝新能源	204,459	2,007,787.38	0.04%
228	600006	东风汽车	500,000	1,955,000.00	0.04%
229	000778	新兴铸管	325,248	1,951,488.00	0.04%
230	600569	安阳钢铁	395,379	1,929,449.52	0.04%
231	600591	上海航空	329,000	1,927,940.00	0.04%
232	000932	华菱管线	300,000	1,896,000.00	0.04%
233	600835	上海机电	126,923	1,845,460.42	0.04%
234	600584	长电科技	400,000	1,828,000.00	0.04%
235	000900	现代投资	112,100	1,748,760.00	0.04%
236	000751	锌业股份	298,448	1,716,076.00	0.04%
237	000793	华闻传媒	300,000	1,704,000.00	0.04%
238	600020	中原高速	407,400	1,649,970.00	0.04%
239	000046	泛海建设	200,000	1,640,000.00	0.04%
240	000987	广州友谊	60,000	1,608,000.00	0.04%
241	600406	国电南瑞	76,106	1,510,704.10	0.03%
242	600033	福建高速	249,250	1,493,007.50	0.03%
243	000912	泸天化	112,000	1,487,360.00	0.03%
244	000807	云铝股份	180,096	1,458,777.60	0.03%
245	000897	津滨发展	300,000	1,440,000.00	0.03%
246	000612	焦作万方	75,627	1,391,536.80	0.03%
247	600651	飞乐音响	220,000	1,370,600.00	0.03%
248	600747	大连控股	264,800	1,358,424.00	0.03%
249	000682	东方电子	346,100	1,280,570.00	0.03%
250	600270	外运发展	154,032	1,212,231.84	0.03%
251	600528	中铁二局	160,000	1,137,600.00	0.02%
252	000659	珠海中富	236,200	1,131,398.00	0.02%
253	600102	莱钢股份	111,679	1,103,388.52	0.02%
254	600748	上实发展	100,000	1,040,000.00	0.02%
255	000969	安泰科技	66,946	1,022,934.88	0.02%
256	600863	内蒙华电	243,000	1,018,170.00	0.02%
257	000726	鲁泰A	136,000	977,840.00	0.02%
258	000009	中国宝安	199,520	971,662.40	0.02%
259	600432	吉恩镍业	41,914	933,424.78	0.02%
260	000970	中科三环	137,700	895,050.00	0.02%
261	000876	新希望	100,000	894,000.00	0.02%
262	000554	泰山石油	117,909	887,854.77	0.02%
263	600132	重庆啤酒	67,028	871,364.00	0.02%
264	600823	世茂股份	90,838	854,785.58	0.02%

265	600597	光明乳业	120,000	825,600.00	0.02%
266	000503	海虹控股	138,413	788,954.10	0.02%
267	600884	杉杉股份	100,000	756,000.00	0.02%
268	600549	厦门钨业	91,000	731,640.00	0.02%
269	000717	韶钢松山	100,000	529,000.00	0.01%
270	000959	首钢股份	120,000	516,000.00	0.01%
271	000636	风华高科	99,200	510,880.00	0.01%
272	600740	山西焦化	40,000	437,600.00	0.01%
273	600151	航天机电	50,000	386,000.00	0.01%
274	000762	西藏矿业	10,824	117,873.36	0.00%
275	000960	锡业股份	2,499	62,100.15	0.00%
	合计			4,056,418,560.77	88.93%

2. 积极投资

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	002008	大族激光	1,478,667	16,753,297.11	0.37%
2	000418	小天鹅A	2,478,864	13,261,922.40	0.29%
3	600825	新华传媒	448,100	11,525,132.00	0.25%
4	002214	大立科技	704,180	9,992,314.20	0.22%
5	601328	交通银行	1,114,153	8,333,864.44	0.18%
6	002194	武汉凡谷	414,559	7,872,475.41	0.17%
7	002073	青岛软控	281,699	4,698,739.32	0.10%
8	600289	亿阳信通	354,898	4,194,894.36	0.09%
9	000028	一致药业	192,970	3,155,059.50	0.07%
10	600750	江中药业	200,000	2,452,000.00	0.05%
11	002258	利尔化学	5,000	80,300.00	0.00%
	合计			82,319,998.74	1.80%

(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

1、 累计买入、 累计卖出价值前二十名的或超出期初基金资产净值 2% 的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例
1	600000	浦发银行	161,855,409.59	2.53%
2	000063	中兴通讯	105,675,668.31	1.65%
3	600036	招商银行	94,357,569.47	1.48%
4	000001	深发展A	91,749,526.51	1.44%
5	000002	万科A	88,518,053.62	1.39%
6	000422	湖北宜化	83,238,484.78	1.30%

7	601006	大秦铁路	82,977,772.69	1.30%
8	600005	武钢股份	82,953,363.00	1.30%
9	600585	海螺水泥	77,124,366.58	1.21%
10	601919	中国远洋	75,149,816.35	1.18%
11	601318	中国平安	75,104,871.17	1.18%
12	600050	中国联通	72,057,517.36	1.13%
13	601939	建设银行	71,793,257.23	1.12%
14	600028	中国石化	71,163,991.21	1.11%
15	601857	中国石油	68,060,229.25	1.07%
16	600019	宝钢股份	62,619,757.18	0.98%
17	600550	天威保变	49,959,218.31	0.78%
18	600900	长江电力	48,995,722.39	0.77%
19	600737	中粮屯河	45,559,650.20	0.71%
20	000538	云南白药	45,272,562.09	0.71%

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	600000	浦发银行	94,606,190.50	1.48%
2	601166	兴业银行	92,097,288.72	1.44%
3	000063	中兴通讯	76,590,744.70	1.20%
4	600028	中国石化	75,563,440.00	1.18%
5	600550	天威保变	63,882,084.00	1.00%
6	600383	金地集团	55,660,425.61	0.87%
7	000667	名流置业	54,840,693.48	0.86%
8	000422	湖北宜化	50,256,532.96	0.79%
9	000002	万科A	49,731,899.56	0.78%
10	000878	云南铜业	46,719,335.08	0.73%
11	601006	大秦铁路	46,136,615.24	0.72%
12	000612	焦作万方	41,437,987.36	0.65%
13	601857	中国石油	40,047,038.21	0.63%
14	600030	中信证券	38,772,645.00	0.61%
15	601628	中国人寿	37,752,977.96	0.59%
16	600048	保利地产	37,246,118.55	0.58%
17	600737	中粮屯河	35,734,256.17	0.56%
18	600598	北大荒	35,516,055.39	0.56%
19	000157	中联重科	32,951,327.50	0.52%
20	000731	四川美丰	31,753,463.17	0.50%

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： 3,799,210,773.83

卖出股票的收入总额： 2,328,656,671.78

(五)、 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	182,601,000.00	4.00
3	金融债券	-	-
	其中: 政策性金融债	-	-
4	企业债券	11,213,741.20	0.25
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
	合计	193,814,741.20	4.25

(六)、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	0801007	08 央票 07	1,000,000	96,120,000.00	2.11
2	0801043	08 央票 43	900,000	86,481,000.00	1.90
3	126016	08 宝钢债	147,150	11,048,022.00	0.24
4	126017	08 葛洲债	2,360	165,719.20	0.00

(七)、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(八)、 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	580024	宝钢 CWB1	2,354,400	2,818,216.80	0.06
2	580025	葛洲 CWB1	51,212	61,710.46	0.00

(九)、 投资组合报告附注

1. 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。

2. 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. 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	1,491,735.93
2	应收证券清算款	100,748,386.25
3	应收股利	2,846,729.75
4	应收利息	2,561,088.98
5	应收申购款	41,557,108.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
	合计	149,205,049.33

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5. 报告期末积极投资和指数投资的前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资和指数投资的前五名股票中不存在流通受限情况。

6. 整个报告期内获得的权证明细

权证代码	权证名称	数量 (份)	权证成本总额(元)	权证投资 类别
580017	赣粤 CWB1	112,941	588,433.87	可分离债获赠权证
580018	中远 CWB1	33,418	232,985.56	可分离债获赠权证
580019	石化 CWB1	233,310	663,458.79	可分离债获赠权证
580020	上港 CWB1	78,897	143,805.41	可分离债获赠权证
580021	青啤 CWB1	141,120	425,876.54	可分离债获赠权证
580022	国电 CWB1	93,090	224,699.33	可分离债获赠权证
580024	宝钢 CWB1	2,354,400	3,491,593.65	可分离债获赠权证
580025	葛洲 CWB1	51,212	68,822.01	可分离债获赠权证

八、基金份额持有人户数和持有人结构

1. 基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
----	-------	---------

基金份额持有人户数	242,667	-
平均每户持有基金份额	24,483.10	-
机构投资者持有的基金份额	1,229,042,375.09	20.69%
个人投资者持有的基金份额	4,712,197,035.67	79.31%

2. 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项 目	期末持有本开放式基 金份额的总量（份）	占本基金总份 额的比例
基金管理公司持有本基金的 所有从业人员	655,639.24	0.011%

九、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	3,094,001,262.00
期初基金份额总额	1,413,053,092.04
加：本期申购基金份额总额	2,381,566,061.08
减：本期赎回基金份额总额	1,849,867,750.23
报告期期间基金拆分变动份额(份额减 少以“-”填列)	3,996,488,007.87
期末基金份额总额	5,941,239,410.76

十、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议：无。

(二)、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 本基金管理人于 2008 年 6 月 10 日发布关于董事和监事变更的公告：经本公司股东会审议，选举马名驹先生担任本公司董事，顾培柱先生不再担任本公司董事；选举李梅清女士担任本公司监事，戴金宝先生不再担任本公司监事。

(2). 本基金管理人于 2008 年 4 月 25 日发布关于调整基金经理的公告：增聘许之彦先生、刘璎女士为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，刘光华先生仍然担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。

2、本基金托管人重大人事变动如下：无。

(三)、本半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：无。

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况：无。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2002 年 11 月 8 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席位情况如下：

1、报告期内租用证券公司席位的变更情况：

退租席位：

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
国金证券有限责任公司	1	0

2、交易成交量及佣金情况：

(1). 股票交易情况：

券商名称	租用席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
申银万国证券股份有限公司	1	469,227,908.08	7.84%	398,842.59	7.94%
招商证券股份有限公司	1	409,975,644.19	6.85%	333,106.37	6.64%
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	1,443,873,011.37	24.11%	1,173,151.64	23.37%
国泰君安证券股份有限公司	1	571,169,159.71	9.54%	485,494.81	9.67%
中信建投证券有限责任公司	1	1,813,459,917.57	30.28%	1,541,437.40	30.70%
中国银河证券股份有限公司	1	1,280,336,948.73	21.38%	1,088,281.95	21.68%
合计	7	<u>5,988,042,589.65</u>	100.00%	<u>5,020,314.76</u>	100.00%

(2). 债券、回购及权证交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例	权证成交量	占总成交总量比例
国泰君安证券股份有限公司	1,493,654.40	13.74%	-	-	677,376.00	21.45%
中信建投证券有限责任公司	5,785,223.60	53.21%	-	-	2,480,800.22	78.55%
申银万国证券股份有限公司	638,580.00	5.87%	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	2,306,226.00	21.21%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	649,437.60	5.97%	-	-	-	-
合计	<u>10,873,121.60</u>	100.00%	<u>-</u>	-	<u>3,158,176.22</u>	100.00%

(九)、 其他重要事项:

1. 基金合同修改

	修改内容	披露日期
1)	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的公告	[2008-4-26]
2)	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的提示性公告	[2008-4-28]
3)	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的提示性公告	[2008-4-29]
4)	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告	[2008-5-5]

2. 代销渠道变更

	其他重要事项	披露日期
1)	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	[2008-01-15]
2)	关于参加中国光大银行基金定投优惠推广活动的公告	[2008-01-18]
3)	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	[2008-01-25]
4)	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	[2008-01-28]
5)	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	[2008-01-31]
6)	关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告	[2008-02-25]
7)	关于新增中原证券股份有限公司为代销机构的公告	[2008-03-03]
8)	关于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	[2008-03-12]
9)	关于新增深圳平安银行为开放式基金代销机构的公告	[2008-03-21]
10)	关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告	[2008-03-24]
11)	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	[2008-03-24]
12)	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	[2008-03-24]
13)	关于新增东莞证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	[2008-04-11]
14)	关于新增平安证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	[2008-04-17]

- | | |
|--|--------------|
| 15) 关于新增广东发展银行股份有限公司为开放式基金代
销机构的公告 | [2008-05-05] |
| 16) 关于参加民生银行网上银行基金申购费率优惠活动的
公告 | [2008-05-08] |
| 17) 关于参加北京银行网上银行基金申购费率优惠活动的
公告 | [2008-06-03] |
| 18) 关于开通北京银行定期定额投资业务的公告 | [2008-06-03] |
| 19) 关于参加交通银行基金定投优惠活动的公告 | [2008-06-12] |
| 20) 关于网上交易系统开通招商银行网上直销业务的公告 | [2008-06-17] |
| 21) 关于新增广州证券有限责任公司为开放式基金代
销机构的公告 | [2008-06-25] |
| 22) 关于参加中信银行网上银行基金申购费率优惠活动的
公告 | [2008-06-26] |
| 23) 关于新增瑞银证券有限责任公司为开放式基金代
销机构及参加瑞银证券有限责任公司网上申购费率优惠
活动的公告 | [2008-06-27] |
| 24) 关于参加中信银行网上银行基金申购费率优惠活动的
更正公告 | [2008-07-01] |
| 25) 关于新增中国银行股份有限公司为代销机构的公告 | [2008-07-01] |
| 26) 关于在中国民生银行股份有限公司开通旗下基金定期
定额投资业务的公告 | [2008-07-10] |
| 27) 关于新增中银国际证券有限责任公司为开放式基金代
销机构的公告 | [2008-07-21] |
| 28) 关于参加广州证券有限责任公司网上申购费率优惠活
动的公告 | [2008-07-22] |
| 29) 关于参加长江证券股份有限公司网上申购费率优惠活
动的公告 | [2008-07-25] |
| 30) 关于新增中山证券有限责任公司为开放式基金代
销机构的公告 | [2008-07-25] |
| 31) 关于参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动与
定期定额申购费率优惠活动的公告 | [2008-08-01] |
| 32) 关于新增齐鲁证券有限公司为开放式基金代销机构及
参加齐鲁证券有限公司网上交易费率优惠活动的公告 | [2008-08-13] |

3. 其他重要事项

- | | 其他重要事项 | 披露日期 |
|----|----------------------|--------------|
| 1) | 关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告 | [2008-06-03] |

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，或基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn> 上。

十一、 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 9、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 8 月 26 日