

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

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

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2011 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
4	管理人报告.....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	32
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	50
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	50
7.8	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.....	50
7.9	投资组合报告附注.....	51
8	基金份额持有人信息.....	51
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	52
9	开放式基金份额变动.....	52
10	重大事件揭示.....	52

10.1	基金份额持有人大会决议.....	52
10.2	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.....	52
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4	基金投资策略的改变.....	53
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	53
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8	其他重大事件.....	55
11	备查文件目录.....	58
11.1	备查文件目录.....	58
11.2	存放地点.....	58
11.3	查阅方式.....	58

2 基金简介

2.1 基金基本情况

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股增强指数	
基金主代码	040002	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
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	
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	
报告期末基金份额总额	6,436,160,981.31份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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</p>

	收益。
业绩比较基准	95% × MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5% × 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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市浦东南路 360 号 新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区复兴门内 大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内 大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李勃	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市浦东南路 360 号新上海 国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011年1月1日至2011年6月30日）
本期已实现收益	164,392,688.01
本期利润	-184,023,528.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0276
本期加权平均净值利润率	-3.24%
本期基金份额净值增长率	-4.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)
期末可供分配利润	1,649,853,270.56
期末可供分配基金份额利润	0.2563
期末基金资产净值	5,315,280,676.16
期末基金份额净值	0.826
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	246.23%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.35%	1.13%	1.85%	1.17%	0.50%	-0.04%
过去三个月	-5.17%	1.06%	-5.66%	1.07%	0.49%	-0.01%
过去六个月	-4.33%	1.19%	-3.74%	1.18%	-0.59%	0.01%
过去一年	19.45%	1.34%	19.36%	1.33%	0.09%	0.01%

过去三年	11.28%	1.87%	12.68%	1.89%	-1.40%	-0.02%
自基金成立起至今	246.23%	1.66%	180.65%	1.70%	65.58%	-0.04%

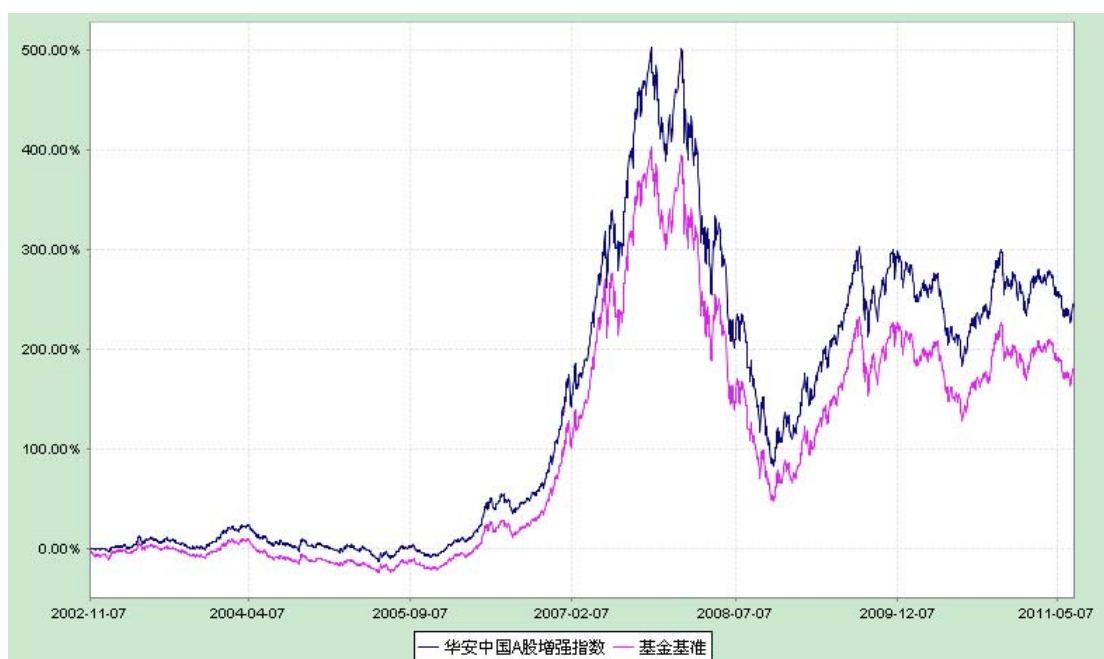
注：业绩比较基准收益率=95%×MSCI 中国 A 股指数+5%×金融同业存款利率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95% 投资于股票，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%。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 94.52%，其中权证投资比例为 0。投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金净资产为 5.41%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2002 年 11 月 8 日至 2011 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安大中华升级股票等 22 只开放式基金，管理资产规模达到 755.14 亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，被动投资部总监	2008-04-25	-	8 年	理学博士，8 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。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，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及华安上证 180ETF 联接基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上

					证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
牛勇	本基金的基金经理	2010-09-02	-	7 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），7 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任本基金的基金经理助理，2010 年 6 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 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《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-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”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 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

按照本基金的基金合同规定，本基金的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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在一季度补库存的拉动下，工业增加值同比小幅反弹，市场尤其是周期类板块表现突出；但进入二季度，通胀上行使得货币政策持续收紧，经济需求出现下滑趋势，对

抗通胀的宏观调控政策对经济基本面显示出效果，投资者对上市公司盈利下滑的担忧导致市场出现显著调整。操作上，本基金通过有限度的增强操作进行了防御性的调整。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内华安中国 A 股增强指数基金份额净值增长率为-4.33%，同期业绩比较基准增长率为-3.74%，基金净值表现落后比较基准 0.59%，截至 2011 年 6 月 30 日，本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.08%（按照基金合同和招募说明书规定）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

6 月份 CPI 同比 6.4% 创下新高，但市场预期 7 月 CPI 仍将处于高位，尽管下半年 CPI 从高位回落的概率较大，但从控制通胀预期角度，短期内政策放松的可能性并不大，流动性仍然保持偏紧，加之上市公司中报整体难以超市场预期，复杂因素交织使得三季度市场呈现震荡的概率较大。四季度如果 CPI 出现趋势性回落，政策将有微调的可能，包括新增信贷额度的调控空间可能略有宽松，市场环境可能较三季度相对宽松。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们继续坚持被动投资的原则，在充分拟合指数的前提下通过适度增强策略，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基

金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民, 工商管理硕士, 曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作, 进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员, 华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理, 现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理, 华安基金管理有限公司首席投资官。

李炳旺先生, 研究生学历, 24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理, 现任华安基金管理有限公司副总裁。

宋磊, 研究发展部总经理, 工学硕士, 曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作, 2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司, 在基金研究发展部从事化工行业研究, 现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

黄勤, 固定收益部总经理, 经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司, 曾任固定收益部债券投资经理, 现任华安现金富利货币、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦, 金融工程部总经理, 理学博士, CQF (国际数量金融工程师)。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, 现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接的基金经理, 金融工程部总经理。

陈林, 基金运营部总经理, 工商管理硕士, 高级会计师, CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作, 2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司, 曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理, 现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任, 并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、2010 年度在本报告期内实施的利润分配：

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 13 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 19 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.10 元。

2、本报告期不进行收益分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年，本基金托管人在对华安 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》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义

务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 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，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 71,195,469.37 元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安强化收益债券型证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	130,601,081.80	106,386,761.00
结算备付金		2,572,913.85	2,782,743.87
存出保证金		837,767.39	669,186.06
交易性金融资产	6.4.7.2	5,179,717,621.93	6,065,914,845.00
其中：股票投资		5,024,246,527.53	5,865,350,845.00
基金投资		-	-
债券投资		155,471,094.40	200,564,000.00

资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		3,640,310.39	30,514,539.51
应收利息	6.4.7.3	1,165,916.60	6,990,732.86
应收股利		3,893,246.37	-
应收申购款		6,218,762.24	21,935,337.48
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		5,328,647,620.57	6,235,194,145.78
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		522,871.43	-
应付赎回款		5,182,545.75	10,795,610.44
应付管理人报酬		4,112,742.48	5,359,357.62
应付托管费		822,548.50	1,071,871.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	2,020,840.95	2,777,706.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	705,395.30	914,156.23
负债合计		13,366,944.41	20,918,702.61
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.6	1,961,084,652.34	2,167,017,577.63
未分配利润	6.4.7.7	3,354,196,023.82	4,047,257,865.54
所有者权益合计		5,315,280,676.16	6,214,275,443.17
负债和所有者权益总计		5,328,647,620.57	6,235,194,145.78

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.826 元，基金份额总额 6,436,160,981.31 份。

6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至 2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至 2010年6月30日
一、收入		-143,071,031.94	-1,411,805,913.84
1. 利息收入		3,299,004.97	1,623,932.82
其中：存款利息收入	6.4.7.8	829,816.90	695,996.29
债券利息收入		2,469,188.07	927,936.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		202,046,180.00	52,856,547.85
其中：股票投资收益	6.4.7.9	165,825,238.63	26,833,289.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	-1,519,942.69	31,912.15
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	37,740,884.06	25,991,345.81
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.12	-348,416,216.91	-1,466,303,258.17
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		-	16,863.66
减：二、费用		40,952,496.96	34,363,191.76
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	28,274,984.35	25,562,118.33
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,654,996.79	5,112,423.69
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.13	6,807,591.63	3,474,429.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.14	214,924.19	214,219.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-184,023,528.90	-1,446,169,105.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-184,023,528.90	-1,446,169,105.60

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,167,017,577.63	4,047,257,865.54	6,214,275,443.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-184,023,528.90	-184,023,528.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-205,932,925.29	-437,842,843.45	-643,775,768.74
其中：1. 基金申购款	455,810,637.99	792,840,733.71	1,248,651,371.70
2. 基金赎回款	-661,743,563.28	-1,230,683,577.16	-1,892,427,140.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-71,195,469.37	-71,195,469.37
五、期末所有者权益（基金净值）	1,961,084,652.34	3,354,196,023.82	5,315,280,676.16
项目	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,825,771,366.07	3,908,070,402.13	5,733,841,768.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,446,169,105.60	-1,446,169,105.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	247,385,633.27	346,284,752.27	593,670,385.54
其中：1. 基金申购款	684,166,162.04	1,153,251,123.50	1,837,417,285.54
2. 基金赎回款	-436,780,528.77	-806,966,371.23	-1,243,746,900.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-118,966,417.38	-118,966,417.38

基金净值变动(净值减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	2,073,156,999.34	2,689,219,631.42	4,762,376,630.76

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：李炳旺，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 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人民币 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《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《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》的有关规定，本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 3.281806547，并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

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份股的其他个股。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%。

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 2011 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 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基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 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]102

号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
活期存款	130,601,081.80
定期存款	-
其他存款	-
合计	130,601,081.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,985,543,555.41	5,024,246,527.53	38,702,972.12	
债券	交易所市场	864,000.00	991,094.40	127,094.40
	银行间市场	154,769,920.00	154,480,000.00	-289,920.00
	合计	155,633,920.00	155,471,094.40	-162,825.60
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	

合计	5,141,177,475.41	5,179,717,621.93	38,540,146.52
----	------------------	------------------	---------------

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	30,614.47
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,042.02
应收债券利息	1,106,102.40
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	28,157.71
合计	1,165,916.60

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	2,017,859.76
银行间市场应付交易费用	2,981.19
合计	2,020,840.95

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
应付后端申购费	96.05
债券利息税	-
预提费用	205,299.25
银行手续费	-
合计	705,395.30

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,111,925,703.93	2,167,017,577.63
本期申购	1,495,788,503.87	455,810,637.99

本期赎回（以“-”号填列）	-2,171,553,226.49	-661,743,563.28
本期末	6,436,160,981.31	1,961,084,652.34

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,715,754,495.03	2,331,503,370.51	4,047,257,865.54
本期利润	164,392,688.01	-348,416,216.91	-184,023,528.90
本期基金份额交易产生的变动数	-159,098,443.11	-278,744,400.34	-437,842,843.45
其中：基金申购款	367,967,653.60	424,873,080.11	792,840,733.71
基金赎回款	-527,066,096.71	-703,617,480.45	-1,230,683,577.16
本期已分配利润	-71,195,469.37	-	-71,195,469.37
本期末	1,649,853,270.56	1,704,342,753.26	3,354,196,023.82

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	763,294.73
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	18,463.17
其他	48,059.00
合计	829,816.90

6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	2,446,967,711.34
减：卖出股票成本总额	2,281,142,472.71
买卖股票差价收入	165,825,238.63

6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	219,309,943.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	211,708,240.00

减：应收利息总额	9,121,646.29
债券投资收益	-1,519,942.69

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	37,740,884.06
基金投资产生的股利收益	-
合计	37,740,884.06

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-348,416,216.91
——股票投资	-350,101,631.31
——债券投资	1,685,414.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-348,416,216.91

6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	6,807,041.63
银行间市场交易费用	550.00
合计	6,807,591.63

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	56,531.73
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	624.94
帐户维护费	9,000.00
合计	214,924.19

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6 月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	28,274,984.35	25,562,118.33
其中：支付销售机构的客户维护费	1,059,206.96	1,075,695.50

注：支付基金管理人华安基金管理有限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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,654,996.79	5,112,423.69

注：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 × 0.2% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	130,601,081.80	763,294.73	93,739,259.46	605,333.31

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2011-01-19	2011-01-19	0.100	36,750,963.82	34,444,505.55	71,195,469.37	2010 年分红
合计			0.100	36,750,963.82	34,444,505.55	71,195,469.37	

6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券
6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002596	海南瑞泽	2011-06-24	2011-07-07	新股网上认购	12.15	12.15	500	6,075.00	6,075.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600098	广州控股	2011-06-20	重大事项	6.79	2011-07-08	7.47	439,896	4,255,229.37	2,986,893.84	-
600170	上海建工	2011-08-08	资产重组	15.59	2011-07-04	16.25	243,161	3,261,745.09	3,790,879.99	-
600216	浙江医药	2011-06-27	非公开发行股票融资	31.39	2011-07-04	32.60	191,122	6,065,343.23	5,999,319.58	-
600315	上海家化	2010-12-06	重大事项	36.88	未知	未知	318,402	6,691,769.28	11,742,665.76	-
601998	中信银行	2011-06-28	配股	4.75	2011-07-07	4.59	1,220,632	7,282,871.98	5,798,002.00	-
000652	泰达股份	2010-11-22	重大事项	7.68	2011-07-08	7.68	1,236,754	8,854,907.47	9,498,270.72	-
000793	华闻传媒	2011-02-28	重大事项	5.66	2011-07-11	6.23	295,300	1,615,525.64	1,671,398.00	-
000876	新希望	2011-06-29	资产重组	19.95	2011-07-05	21.95	551,490	5,269,425.88	11,002,225.50	-
000917	电广传媒	2010-12-27	重大	24.40	2011-07-06	26.84	572,828	8,959,591.25	13,977,003.20	-

			资产 重组							
000959	首钢股份	2010-10-29	重大 资产 重组	4.42	未知	未知	1,212,508	6,323,927.62	5,359,285.36	-

注：本基金截至 2011 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的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从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，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；在管理层层面设立风险控制委员会，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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的

银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.02%（2010 年 12 月 31 日：无）。

6.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金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，因此除附注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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余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。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行

监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2011年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	130,601,081.80	-	-	-	130,601,081.80
结算备付金	2,572,913.85	-	-	-	2,572,913.85
存出保证金	-	-	-	837,767.39	837,767.39
交易性金融资产	154,480,000.00	-	991,094.40	5,024,246,527.53	5,179,717,621.93
应收证券清算款	-	-	-	3,640,310.39	3,640,310.39
应收利息	-	-	-	1,165,916.60	1,165,916.60
应收股利	-	-	-	3,893,246.37	3,893,246.37
应收申购款	6,188,562.24	-	-	30,200.00	6,218,762.24
资产总计	293,842,557.89	-	991,094.40	5,033,813,968.28	5,328,647,620.57
负债					
应付证券清算款	-	-	-	522,871.43	522,871.43
应付赎回款	-	-	-	5,182,545.75	5,182,545.75
应付管理人报酬	-	-	-	4,112,742.48	4,112,742.48
应付托管费	-	-	-	822,548.50	822,548.50
应付交易费用	-	-	-	2,020,840.95	2,020,840.95
其他负债	-	-	-	705,395.30	705,395.30
负债总计	-	-	-	13,366,944.41	13,366,944.41
利率敏感度缺口	293,842,557.89	-	991,094.40	5,020,447,023.87	5,315,280,676.16
上年度末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	106,386,761.00	-	-	-	106,386,761.00
结算备付金	2,782,743.87	-	-	-	2,782,743.87
存出保证金	-	-	-	669,186.06	669,186.06
交易性金融资产	200,564,000.00	-	-	5,865,350,845.00	6,065,914,845.00
应收证券清算款	-	-	-	30,514,539.51	30,514,539.51

应收利息	-	-	-	6,990,732.86	6,990,732.86
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	4,674,414.36	-	-	17,260,923.12	21,935,337.48
资产总计	314,407,919.23	-	-	5,920,786,226.55	6,235,194,145.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10,795,610.44	10,795,610.44
应付管理人报酬	-	-	-	5,359,357.62	5,359,357.62
应付托管费	-	-	-	1,071,871.51	1,071,871.51
应付交易费用	-	-	-	2,777,706.81	2,777,706.81
其他负债	-	-	-	914,156.23	914,156.23
负债总计	-	-	-	20,918,702.61	20,918,702.61
利率敏感度缺口	314,407,919.23	-	-	5,899,867,523.94	6,214,275,443.17

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 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净值的比例为 2.93% (2010 年 12 月 31 日：3.23%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份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。同时，本基金根据股票市场的具体情况，对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整以达到相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,024,246,527.53	94.52	5,865,350,845.00	94.39
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,024,246,527.53	94.52	5,865,350,845.00	94.39

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降 5%	减少约 26,349.00 万元	减少约 30,890.00 万元
	业绩比较基准上升 5%	增加约 26,349.00 万元	增加约 30,890.00 万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,024,246,527.53	94.29
	其中：股票	5,024,246,527.53	94.29
2	固定收益投资	155,471,094.40	2.92
	其中：债券	155,471,094.40	2.92
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	133,173,995.65	2.50
6	其他各项资产	15,756,002.99	0.30
7	合计	5,328,647,620.57	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	41,064,231.70	0.77
B	采掘业	457,559,320.55	8.61
C	制造业	2,229,014,831.17	41.94
C0	食品、饮料	321,102,932.77	6.04
C1	纺织、服装、皮毛	35,277,022.15	0.66
C2	木材、家具	1,184,040.99	0.02
C3	造纸、印刷	16,169,393.40	0.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	234,220,663.36	4.41
C5	电子	82,654,921.26	1.56
C6	金属、非金属	472,593,023.11	8.89
C7	机械、设备、仪表	741,664,147.50	13.95
C8	医药、生物制品	308,047,488.45	5.80
C99	其他制造业	16,101,198.18	0.30

D	电力、煤气及水的生产和供应业	129,220,906.94	2.43
E	建筑业	136,363,045.94	2.57
F	交通运输、仓储业	176,770,287.83	3.33
G	信息技术业	200,913,159.28	3.78
H	批发和零售贸易	198,376,247.55	3.73
I	金融、保险业	953,647,367.89	17.94
J	房地产业	296,711,225.84	5.58
K	社会服务业	49,759,196.26	0.94
L	传播与文化产业	27,095,036.51	0.51
M	综合类	127,745,595.07	2.40
	合计	5,024,240,452.53	94.52

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	6,075.00	0.00
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	6,075.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
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	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
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	6,075.00	0.00
--	----	----------	------

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	9,347,226	121,700,882.52	2.29
2	600016	民生银行	17,756,460	101,744,515.80	1.91
3	601318	中国平安	1,999,943	96,537,248.61	1.82
4	600030	中信证券	6,672,537	87,276,783.96	1.64
5	000002	万科A	9,543,574	80,643,200.30	1.52
6	601166	兴业银行	5,831,558	78,609,401.84	1.48
7	601601	中国太保	3,509,419	78,575,891.41	1.48
8	600000	浦发银行	7,659,627	75,370,729.68	1.42
9	000858	五粮液	1,616,932	57,756,811.04	1.09
10	600519	贵州茅台	269,253	57,251,265.39	1.08
11	600111	包钢稀土	711,857	50,847,945.51	0.96
12	002024	苏宁电器	3,907,243	50,051,782.83	0.94
13	601939	建设银行	10,087,291	49,831,217.54	0.94
14	600031	三一重工	2,727,796	49,209,439.84	0.93
15	601328	交通银行	8,239,794	45,648,458.76	0.86
16	601088	中国神华	1,448,142	43,646,999.88	0.82
17	600276	恒瑞医药	1,416,887	42,464,103.39	0.80
18	000527	美的电器	2,205,448	40,558,188.72	0.76
19	000651	格力电器	1,700,090	39,952,115.00	0.75
20	600585	海螺水泥	1,429,898	39,693,968.48	0.75
21	000568	泸州老窖	838,630	37,838,985.60	0.71
22	601668	中国建筑	9,098,395	36,666,531.85	0.69
23	600900	长江电力	5,019,863	36,193,212.23	0.68
24	600050	中国联通	6,683,179	35,086,689.75	0.66
25	000983	西山煤电	1,424,155	34,464,551.00	0.65
26	000063	中兴通讯	1,185,680	33,531,030.40	0.63
27	000792	盐湖股份	559,174	32,991,266.00	0.62
28	600104	上海汽车	1,754,031	32,870,540.94	0.62
29	600547	山东黄金	714,056	32,018,271.04	0.60
30	600837	海通证券	3,524,155	31,787,878.10	0.60
31	600887	伊利股份	1,826,034	30,403,466.10	0.57
32	002304	洋河股份	224,838	28,365,562.08	0.53

33	600160	巨化股份	873,634	28,358,159.64	0.53
34	000001	深发展 A	1,636,188	27,929,729.16	0.53
35	000157	中联重科	1,765,139	27,147,837.82	0.51
36	600048	保利地产	2,428,507	26,689,291.93	0.50
37	601006	大秦铁路	3,257,314	26,677,401.66	0.50
38	000423	东阿阿胶	611,936	25,248,479.36	0.48
39	601288	农业银行	8,659,695	24,247,146.00	0.46
40	600309	烟台万华	1,284,501	24,033,013.71	0.45
41	000538	云南白药	420,150	23,982,162.00	0.45
42	600028	中国石化	2,906,129	23,917,441.67	0.45
43	601766	中国南车	3,276,543	23,328,986.16	0.44
44	600068	葛洲坝	1,903,907	22,827,844.93	0.43
45	601169	北京银行	2,288,986	22,821,190.42	0.43
46	000338	潍柴动力	501,135	22,766,563.05	0.43
47	600348	国阳新能	901,047	21,751,274.58	0.41
48	600518	康美药业	1,651,257	21,730,542.12	0.41
49	600383	金地集团	3,257,263	20,879,055.83	0.39
50	600581	八一钢铁	1,398,456	20,487,380.40	0.39
51	000937	冀中能源	799,426	20,265,449.10	0.38
52	601989	中国重工	1,452,705	20,032,801.95	0.38
53	601857	中国石油	1,833,573	19,967,609.97	0.38
54	600406	国电南瑞	534,713	19,410,081.90	0.37
55	601699	潞安环能	590,406	19,371,220.86	0.36
56	002106	莱宝高科	627,292	18,975,583.00	0.36
57	600089	特变电工	1,463,197	18,933,769.18	0.36
58	000402	金融街	2,516,870	18,801,018.90	0.35
59	600425	青松建化	893,057	18,593,446.74	0.35
60	000581	威孚高科	472,662	18,221,120.10	0.34
61	000060	中金岭南	1,358,368	18,066,294.40	0.34
62	600019	宝钢股份	2,958,751	17,841,268.53	0.34
63	600015	华夏银行	1,630,800	17,726,796.00	0.33
64	002123	荣信股份	777,211	17,704,866.58	0.33
65	600690	青岛海尔	632,546	17,679,660.70	0.33
66	601168	西部矿业	1,189,421	17,627,219.22	0.33
67	601009	南京银行	1,950,551	17,496,442.47	0.33
68	000895	双汇发展	254,589	16,820,695.23	0.32
69	600881	亚泰集团	1,972,883	16,434,115.39	0.31
70	000623	吉林敖东	529,716	16,320,549.96	0.31
71	600208	新潮中宝	2,569,934	16,010,688.82	0.30
72	000630	铜陵有色	652,960	15,736,336.00	0.30
73	000709	河北钢铁	3,474,365	15,704,129.80	0.30

74	000024	招商地产	847,992	15,518,253.60	0.29
75	600489	中金黄金	564,499	15,405,177.71	0.29
76	000009	中国宝安	893,323	15,383,022.06	0.29
77	000422	湖北宜化	724,020	15,153,738.60	0.29
78	000425	徐工机械	609,585	15,111,612.15	0.28
79	000401	冀东水泥	600,257	15,000,422.43	0.28
80	600497	驰宏锌锗	679,224	14,976,889.20	0.28
81	600256	广汇股份	629,111	14,960,259.58	0.28
82	000933	神火股份	976,194	14,847,910.74	0.28
83	601618	中国中冶	3,693,504	14,552,405.76	0.27
84	600795	国电电力	4,904,850	14,518,356.00	0.27
85	600058	五矿发展	423,226	14,508,187.28	0.27
86	600252	中恒集团	764,648	14,230,099.28	0.27
87	000917	电广传媒	572,828	13,977,003.20	0.26
88	600010	包钢股份	1,662,358	13,880,689.30	0.26
89	000800	一汽轿车	976,390	13,825,682.40	0.26
90	600739	辽宁成大	496,416	13,800,364.80	0.26
91	000069	华侨城 A	1,719,717	13,602,961.47	0.26
92	601607	上海医药	801,746	13,469,332.80	0.25
93	601988	中国银行	4,281,936	13,445,279.04	0.25
94	000778	新兴铸管	1,273,132	13,431,542.60	0.25
95	002008	大族激光	1,074,849	13,414,115.52	0.25
96	600875	东方电气	526,021	13,413,535.50	0.25
97	000039	中集集团	610,863	13,365,682.44	0.25
98	601958	金铂股份	685,259	13,191,235.75	0.25
99	600631	百联股份	884,795	13,165,749.60	0.25
100	600100	同方股份	1,246,043	13,033,609.78	0.25
101	000758	中色股份	364,478	12,884,297.30	0.24
102	601666	平煤股份	901,419	12,628,880.19	0.24
103	600123	兰花科创	298,968	12,490,883.04	0.23
104	000012	南玻 A	752,852	12,422,058.00	0.23
105	601106	中国一重	2,545,414	12,345,257.90	0.23
106	600660	福耀玻璃	1,178,994	12,214,377.84	0.23
107	002001	新和成	413,514	12,177,987.30	0.23
108	600409	三友化工	1,048,955	12,167,878.00	0.23
109	600118	中国卫星	536,288	12,018,214.08	0.23
110	002038	双鹭药业	318,270	12,014,692.50	0.23
111	600315	上海家化	318,402	11,742,665.76	0.22
112	601299	中国北车	1,745,851	11,697,201.70	0.22
113	600062	双鹤药业	471,335	11,684,394.65	0.22
114	600029	南方航空	1,480,077	11,603,803.68	0.22

115	601101	昊华能源	183,080	11,554,178.80	0.22
116	600395	盘江股份	345,630	11,471,459.70	0.22
117	002202	金风科技	767,263	11,455,236.59	0.22
118	601001	大同煤业	662,941	11,269,997.00	0.21
119	601117	中国化学	1,265,280	11,210,380.80	0.21
120	600018	上港集团	2,856,089	11,138,747.10	0.21
121	600143	金发科技	673,597	11,087,406.62	0.21
122	000768	西飞国际	1,006,792	11,084,779.92	0.21
123	600642	申能股份	2,185,815	11,082,082.05	0.21
124	000876	新希望	551,490	11,002,225.50	0.21
125	000878	云南铜业	501,569	10,989,376.79	0.21
126	601390	中国中铁	2,734,963	10,912,502.37	0.21
127	002146	荣盛发展	1,110,560	10,883,488.00	0.20
128	600415	小商品城	881,294	10,831,103.26	0.20
129	601808	中海油服	605,685	10,817,534.10	0.20
130	600079	人福医药	488,995	10,787,229.70	0.20
131	600997	开滦股份	674,708	10,768,339.68	0.20
132	000877	天山股份	301,799	10,725,936.46	0.20
133	600636	三爱富	300,000	10,659,000.00	0.20
134	601898	中煤能源	1,065,656	10,656,560.00	0.20
135	601333	广深铁路	2,592,273	10,654,242.03	0.20
136	000541	佛山照明	785,213	10,647,488.28	0.20
137	600583	海油工程	1,656,773	10,636,482.66	0.20
138	600801	华新水泥	410,000	10,496,000.00	0.20
139	600741	华域汽车	924,401	10,288,583.13	0.19
140	600177	雅戈尔	1,041,527	10,279,871.49	0.19
141	600362	江西铜业	289,604	10,263,565.76	0.19
142	600376	首开股份	768,770	10,155,451.70	0.19
143	600582	天地科技	457,242	10,123,337.88	0.19
144	601186	中国铁建	1,664,989	10,073,183.45	0.19
145	002007	华兰生物	292,021	9,911,192.74	0.19
146	600970	中材国际	360,991	9,865,884.03	0.19
147	600132	重庆啤酒	169,433	9,725,454.20	0.18
148	000969	安泰科技	494,316	9,653,991.48	0.18
149	600498	烽火通信	369,945	9,611,171.10	0.18
150	000550	江铃汽车	365,845	9,610,748.15	0.18
151	600005	武钢股份	2,304,047	9,561,795.05	0.18
152	600009	上海机场	743,780	9,520,384.00	0.18
153	000652	泰达股份	1,236,754	9,498,270.72	0.18
154	600549	厦门钨业	229,062	9,490,038.66	0.18
155	600320	振华重工	1,409,218	9,371,299.70	0.18

156	002073	软控股份	452,786	9,327,391.60	0.18
157	600196	复星医药	849,222	9,239,535.36	0.17
158	000825	太钢不锈	1,790,172	9,219,385.80	0.17
159	002244	滨江集团	749,465	9,218,419.50	0.17
160	000860	顺鑫农业	532,023	9,172,076.52	0.17
161	000962	东方钨业	362,946	9,055,502.70	0.17
162	000898	鞍钢股份	1,312,446	8,924,632.80	0.17
163	000680	山推股份	499,481	8,785,870.79	0.17
164	601111	中国国航	911,994	8,746,022.46	0.16
165	600809	山西汾酒	123,887	8,678,284.35	0.16
166	600153	建发股份	944,288	8,404,163.20	0.16
167	000417	合肥百货	461,713	8,403,176.60	0.16
168	600546	山煤国际	269,027	8,390,952.13	0.16
169	002155	辰州矿业	253,607	8,290,412.83	0.16
170	000061	农产品	519,118	8,285,123.28	0.16
171	601866	中海集运	2,264,484	8,242,721.76	0.16
172	601919	中国远洋	993,899	8,239,422.71	0.16
173	600060	海信电器	613,123	8,228,110.66	0.15
174	600655	豫园商城	752,774	8,190,181.12	0.15
175	002152	广电运通	263,642	8,128,082.86	0.15
176	000776	广发证券	206,895	8,120,628.75	0.15
177	600458	时代新材	421,628	8,112,122.72	0.15
178	600859	王府井	201,983	8,073,260.51	0.15
179	600125	铁龙物流	756,988	7,978,653.52	0.15
180	601918	国投新集	655,686	7,973,141.76	0.15
181	000528	柳工	352,208	7,970,467.04	0.15
182	600588	用友软件	383,659	7,926,394.94	0.15
183	600879	航天电子	648,549	7,886,355.84	0.15
184	600388	龙净环保	286,495	7,829,908.35	0.15
185	600456	宝钛股份	271,208	7,827,062.88	0.15
186	600535	天士力	189,580	7,797,425.40	0.15
187	600598	北大荒	554,393	7,761,502.00	0.15
188	000759	中百集团	696,339	7,652,765.61	0.14
189	600085	同仁堂	213,541	7,614,872.06	0.14
190	600635	大众公用	1,278,131	7,540,972.90	0.14
191	601717	郑煤机	205,816	7,504,051.36	0.14
192	600499	科达机电	466,199	7,463,845.99	0.14
193	000559	万向钱潮	922,566	7,417,430.64	0.14
194	600770	综艺股份	388,172	7,344,214.24	0.14
195	600432	吉恩镍业	325,312	7,247,951.36	0.14
196	000783	长江证券	672,626	7,244,182.02	0.14

197	600895	张江高科	762,379	7,196,857.76	0.14
198	600717	天津港	856,996	7,010,227.28	0.13
199	000960	锡业股份	239,978	6,983,359.80	0.13
200	600832	东方明珠	896,860	6,950,665.00	0.13
201	600805	悦达投资	461,757	6,926,355.00	0.13
202	002249	大洋电机	324,381	6,893,096.25	0.13
203	601788	光大证券	501,294	6,892,792.50	0.13
204	600500	中化国际	684,473	6,837,885.27	0.13
205	000027	深圳能源	906,631	6,835,997.74	0.13
206	600750	江中药业	279,074	6,831,731.52	0.13
207	600703	三安光电	415,864	6,820,169.60	0.13
208	600271	航天信息	262,535	6,783,904.40	0.13
209	601888	中国国旅	286,895	6,779,328.85	0.13
210	600308	华泰股份	674,536	6,765,596.08	0.13
211	600649	城投控股	823,121	6,683,742.52	0.13
212	600316	洪都航空	205,754	6,631,451.42	0.12
213	600150	中国船舶	88,697	6,562,691.03	0.12
214	600261	阳光照明	349,870	6,553,065.10	0.12
215	601628	中国人寿	348,220	6,529,125.00	0.12
216	000762	西藏矿业	195,028	6,471,029.04	0.12
217	600366	宁波韵升	412,721	6,463,210.86	0.12
218	600259	广晟有色	88,559	6,457,722.28	0.12
219	000540	中天城投	386,428	6,437,890.48	0.12
220	000869	张裕A	64,962	6,418,245.60	0.12
221	600718	东软集团	559,985	6,372,629.30	0.12
222	600811	东方集团	922,841	6,349,146.08	0.12
223	000839	中信国安	606,653	6,315,257.73	0.12
224	600026	中海发展	743,712	6,276,929.28	0.12
225	601179	中国西电	1,026,868	6,263,894.80	0.12
226	000625	长安汽车	682,267	6,242,743.05	0.12
227	600066	宇通客车	268,541	6,214,038.74	0.12
228	000400	许继电气	200,428	6,175,186.68	0.12
229	600600	青岛啤酒	180,093	6,148,375.02	0.12
230	600117	西宁特钢	596,839	6,129,536.53	0.12
231	000612	焦作万方	342,964	6,118,477.76	0.12
232	000718	苏宁环球	763,129	6,105,032.00	0.11
233	600298	安琪酵母	182,658	6,064,245.60	0.11
234	600008	首创股份	1,065,863	6,032,784.58	0.11
235	000562	宏源证券	361,016	6,032,577.36	0.11
236	000807	云铝股份	559,054	6,015,421.04	0.11
237	600460	士兰微	353,805	6,011,146.95	0.11

238	600765	中航重机	399,960	5,999,400.00	0.11
239	600216	浙江医药	191,122	5,999,319.58	0.11
240	600428	中远航运	826,420	5,966,752.40	0.11
241	000501	鄂武商 A	348,338	5,949,613.04	0.11
242	600694	大商股份	154,755	5,916,283.65	0.11
243	000031	中粮地产	1,027,276	5,876,018.72	0.11
244	600839	四川长虹	1,746,173	5,832,217.82	0.11
245	601688	华泰证券	470,405	5,809,501.75	0.11
246	601998	中信银行	1,220,632	5,798,002.00	0.11
247	600525	长园集团	695,442	5,793,031.86	0.11
248	600188	兖州煤业	163,495	5,771,373.50	0.11
249	000729	燕京啤酒	338,314	5,741,188.58	0.11
250	600673	东阳光铝	355,200	5,686,752.00	0.11
251	002065	东华软件	236,511	5,605,310.70	0.11
252	600220	江苏阳光	1,100,908	5,548,576.32	0.10
253	600550	天威保变	305,193	5,496,525.93	0.10
254	601899	紫金矿业	758,307	5,490,142.68	0.10
255	600418	江淮汽车	493,680	5,484,784.80	0.10
256	600426	华鲁恒升	324,467	5,483,492.30	0.10
257	600742	一汽富维	186,233	5,452,902.24	0.10
258	600580	卧龙电气	662,434	5,445,207.48	0.10
259	000488	晨鸣纸业	776,488	5,443,180.88	0.10
260	600884	杉杉股份	297,331	5,432,237.37	0.10
261	600528	中铁二局	621,327	5,399,331.63	0.10
262	000959	首钢股份	1,212,508	5,359,285.36	0.10
263	002011	盾安环境	384,306	5,338,010.34	0.10
264	000418	小天鹅 A	327,712	5,263,054.72	0.10
265	600176	中国玻纤	172,956	5,226,730.32	0.10
266	600312	平高电气	512,726	5,204,168.90	0.10
267	000963	华东医药	213,146	5,173,053.42	0.10
268	000999	华润三九	287,580	5,162,061.00	0.10
269	600267	海正药业	137,912	5,149,634.08	0.10
270	600325	华发股份	457,057	5,128,179.54	0.10
271	600037	歌华有线	500,059	5,095,601.21	0.10
272	600872	中炬高新	753,475	5,063,352.00	0.10
273	600664	哈药股份	321,806	5,052,354.20	0.10
274	600266	北京城建	334,675	5,036,858.75	0.09
275	000826	桑德环境	202,006	5,036,009.58	0.09
276	600516	方大炭素	383,536	5,035,827.68	0.09
277	600108	亚盛集团	823,336	4,997,649.52	0.09
278	600169	太原重工	483,144	4,903,911.60	0.09

279	600602	广电电子	734,845	4,842,628.55	0.09
280	000961	中南建设	459,168	4,839,630.72	0.09
281	002422	科伦药业	81,484	4,807,556.00	0.09
282	000786	北新建材	299,305	4,761,942.55	0.09
283	000726	鲁泰A	432,524	4,736,137.80	0.09
284	600269	赣粤高速	999,874	4,709,406.54	0.09
285	000816	江淮动力	599,897	4,691,194.54	0.09
286	600166	福田汽车	539,918	4,686,488.24	0.09
287	600570	恒生电子	315,722	4,685,314.48	0.09
288	600729	重庆百货	108,344	4,682,627.68	0.09
289	000970	中科三环	225,309	4,661,643.21	0.09
290	600584	长电科技	562,824	4,648,926.24	0.09
291	600674	川投能源	322,956	4,631,189.04	0.09
292	600628	新世界	464,241	4,600,628.31	0.09
293	000930	中粮生化	590,746	4,590,096.42	0.09
294	600331	宏达股份	344,019	4,578,892.89	0.09
295	000897	津滨发展	998,431	4,552,845.36	0.09
296	002375	亚厦股份	153,414	4,525,713.00	0.09
297	000968	煤气化	178,664	4,525,559.12	0.09
298	600893	航空动力	261,512	4,521,542.48	0.09
299	600487	亨通光电	168,099	4,513,458.15	0.08
300	002161	远望谷	200,000	4,486,000.00	0.08
301	000597	东北制药	319,976	4,476,464.24	0.08
302	600339	天利高新	366,927	4,461,832.32	0.08
303	000513	丽珠集团	161,338	4,431,954.86	0.08
304	600219	南山铝业	467,855	4,402,515.55	0.08
305	600236	桂冠电力	793,394	4,387,468.82	0.08
306	600195	中牧股份	192,360	4,376,190.00	0.08
307	002022	科华生物	330,453	4,375,197.72	0.08
308	600352	浙江龙盛	455,944	4,367,943.52	0.08
309	600737	中粮屯河	421,148	4,316,767.00	0.08
310	600467	好当家	362,706	4,316,201.40	0.08
311	600027	华电国际	1,300,000	4,316,000.00	0.08
312	600999	招商证券	234,520	4,310,477.60	0.08
313	600971	恒源煤电	106,424	4,295,272.64	0.08
314	600199	金种子酒	255,963	4,284,820.62	0.08
315	600251	冠农股份	128,622	4,265,105.52	0.08
316	600210	紫江企业	707,836	4,247,016.00	0.08
317	002028	思源电气	310,087	4,245,091.03	0.08
318	600787	中储股份	404,415	4,222,092.60	0.08
319	600481	双良节能	291,023	4,208,192.58	0.08

320	600720	祁连山	230,301	4,200,690.24	0.08
321	600797	浙大网新	569,690	4,192,918.40	0.08
322	000900	现代投资	254,980	4,156,174.00	0.08
323	600408	安泰集团	567,973	4,146,202.90	0.08
324	000939	凯迪电力	320,000	4,108,800.00	0.08
325	000735	罗牛山	574,858	4,104,486.12	0.08
326	002063	远光软件	216,538	4,099,064.34	0.08
327	000539	粤电力 A	755,148	4,077,799.20	0.08
328	600783	鲁信创投	160,288	4,064,903.68	0.08
329	600537	海通集团	106,292	3,892,413.04	0.07
330	600067	冠城大通	418,295	3,890,143.50	0.07
331	600231	凌钢股份	425,977	3,884,910.24	0.07
332	002223	鱼跃医疗	156,536	3,839,828.08	0.07
333	000667	名流置业	1,282,848	3,835,715.52	0.07
334	600161	天坛生物	226,202	3,834,123.90	0.07
335	600816	安信信托	194,500	3,829,705.00	0.07
336	601991	大唐发电	683,605	3,814,515.90	0.07
337	600596	新安股份	361,400	3,801,928.00	0.07
338	600595	中孚实业	378,521	3,800,350.84	0.07
339	600170	上海建工	243,161	3,790,879.99	0.07
340	600115	东方航空	726,435	3,777,462.00	0.07
341	600675	中华企业	554,385	3,769,818.00	0.07
342	600823	世茂股份	257,155	3,762,177.65	0.07
343	600240	华业地产	352,569	3,754,859.85	0.07
344	002254	烟台氨纶	208,638	3,722,101.92	0.07
345	600096	云天化	186,081	3,701,151.09	0.07
346	600880	博瑞传播	261,518	3,671,712.72	0.07
347	000830	鲁西化工	523,500	3,664,500.00	0.07
348	600804	鹏博士	463,248	3,655,026.72	0.07
349	600863	内蒙华电	410,355	3,635,745.30	0.07
350	600858	银座股份	176,678	3,611,298.32	0.07
351	600072	中船股份	137,833	3,583,658.00	0.07
352	000089	深圳机场	647,530	3,580,840.90	0.07
353	600812	华北制药	308,906	3,558,597.12	0.07
354	000021	长城开发	428,932	3,551,556.96	0.07
355	000997	新大陆	234,379	3,520,372.58	0.07
356	000046	泛海建设	396,528	3,481,515.84	0.07
357	002041	登海种业	168,416	3,481,158.72	0.07
358	600064	南京高科	248,255	3,438,331.75	0.06
359	600575	芜湖港	374,404	3,437,028.72	0.06
360	600436	片仔癀	54,282	3,414,337.80	0.06

361	000987	广州友谊	162,362	3,407,978.38	0.06
362	000690	宝新能源	678,028	3,403,700.56	0.06
363	600350	山东高速	817,595	3,384,843.30	0.06
364	600866	星湖科技	325,636	3,360,563.52	0.06
365	600815	厦工股份	227,945	3,359,909.30	0.06
366	600033	福建高速	1,029,468	3,335,476.32	0.06
367	001696	宗申动力	462,600	3,326,094.00	0.06
368	000685	中山公用	199,630	3,321,843.20	0.06
369	600351	亚宝药业	425,267	3,304,324.59	0.06
370	600820	隧道股份	309,318	3,300,423.06	0.06
371	600810	神马股份	198,063	3,256,155.72	0.06
372	600322	天房发展	610,741	3,243,034.71	0.06
373	600011	华能国际	612,325	3,233,076.00	0.06
374	000088	盐田港	502,732	3,227,539.44	0.06
375	000988	华工科技	172,634	3,214,445.08	0.06
376	600511	国药股份	211,575	3,211,708.50	0.06
377	002408	齐翔腾达	100,000	3,183,000.00	0.06
378	600183	生益科技	346,290	3,178,942.20	0.06
379	600611	大众交通	463,317	3,178,354.62	0.06
380	600198	大唐电信	221,329	3,145,085.09	0.06
381	600886	国投电力	431,303	3,126,946.75	0.06
382	600138	中青旅	236,423	3,120,783.60	0.06
383	600557	康缘药业	222,236	3,113,526.36	0.06
384	000932	华菱钢铁	747,160	3,070,827.60	0.06
385	601588	北辰实业	836,950	3,063,237.00	0.06
386	002353	杰瑞股份	47,045	3,053,220.50	0.06
387	600435	中兵光电	244,986	3,047,625.84	0.06
388	600311	荣华实业	225,608	3,043,451.92	0.06
389	002081	金螳螂	75,120	3,019,824.00	0.06
390	002097	山河智能	218,342	3,010,936.18	0.06
391	600835	上海机电	254,465	3,010,320.95	0.06
392	000848	承德露露	188,026	3,000,894.96	0.06
393	600098	广州控股	439,896	2,986,893.84	0.06
394	600508	上海能源	122,260	2,979,476.20	0.06
395	000926	福星股份	247,698	2,964,945.06	0.06
396	601872	招商轮船	772,053	2,956,962.99	0.06
397	600704	物产中大	165,502	2,926,075.36	0.06
398	002465	海格通信	97,417	2,886,465.71	0.05
399	600961	株冶集团	170,954	2,882,284.44	0.05
400	002230	科大讯飞	69,850	2,828,925.00	0.05
401	600517	置信电气	233,686	2,820,590.02	0.05

402	002069	獐子岛	115,533	2,807,451.90	0.05
403	600755	厦门国贸	347,966	2,801,126.30	0.05
404	600748	上实发展	383,817	2,778,835.08	0.05
405	600307	酒钢宏兴	506,296	2,774,502.08	0.05
406	000616	亿城股份	628,335	2,770,957.35	0.05
407	002344	海宁皮城	126,616	2,766,559.60	0.05
408	600289	亿阳信通	309,183	2,764,096.02	0.05
409	601268	二重重装	254,622	2,760,102.48	0.05
410	600643	爱建股份	262,165	2,752,732.50	0.05
411	600004	白云机场	347,776	2,743,952.64	0.05
412	600688	S 上石化	306,223	2,710,073.55	0.05
413	600779	水井坊	120,647	2,704,905.74	0.05
414	600638	新黄浦	269,584	2,682,360.80	0.05
415	601098	中南传媒	281,146	2,679,321.38	0.05
416	000677	山东海龙	581,654	2,658,158.78	0.05
417	600038	哈飞股份	98,416	2,634,596.32	0.05
418	600416	湘电股份	214,810	2,601,349.10	0.05
419	601877	正泰电器	149,950	2,598,633.50	0.05
420	002122	天马股份	201,795	2,582,976.00	0.05
421	601018	宁波港	800,000	2,560,000.00	0.05
421	600268	国电南自	200,000	2,560,000.00	0.05
423	601107	四川成渝	451,035	2,534,816.70	0.05
424	002294	信立泰	75,409	2,532,988.31	0.05
425	002236	大华股份	55,754	2,525,098.66	0.05
426	000028	一致药业	97,138	2,508,103.16	0.05
427	002385	大北农	77,360	2,506,464.00	0.05
428	000823	超声电子	171,641	2,495,660.14	0.05
429	600639	浦东金桥	257,646	2,481,130.98	0.05
430	600410	华胜天成	165,123	2,470,240.08	0.05
431	000973	佛塑科技	182,645	2,425,525.60	0.05
432	600663	陆家嘴	171,591	2,398,842.18	0.05
433	600597	光明乳业	301,128	2,387,945.04	0.04
434	600533	栖霞建设	465,023	2,376,267.53	0.04
435	000683	远兴能源	264,176	2,364,375.20	0.04
436	000886	海南高速	481,525	2,316,135.25	0.04
437	002237	恒邦股份	56,327	2,277,300.61	0.04
438	600317	营口港	389,379	2,258,398.20	0.04
439	600867	通化东宝	268,040	2,246,175.20	0.04
440	002078	太阳纸业	210,100	2,229,161.00	0.04
441	002104	恒宝股份	175,314	2,200,190.70	0.04
442	000100	TCL 集团	731,460	2,187,065.40	0.04

443	600616	金枫酒业	195,871	2,178,085.52	0.04
444	600641	万业企业	235,369	2,141,857.90	0.04
445	002091	江苏国泰	113,478	2,140,195.08	0.04
446	600197	伊力特	169,707	2,138,308.20	0.04
447	600087	长航油运	716,099	2,083,848.09	0.04
448	600888	新疆众和	85,609	2,076,018.25	0.04
449	601678	滨化股份	115,820	2,044,223.00	0.04
450	600808	马钢股份	586,872	2,042,314.56	0.04
451	600380	健康元	219,082	2,017,745.22	0.04
452	002004	华邦制药	44,213	1,994,006.30	0.04
453	002092	中泰化学	148,338	1,946,194.56	0.04
454	002168	深圳惠程	108,000	1,942,920.00	0.04
455	600993	马应龙	101,766	1,935,589.32	0.04
456	002506	超日太阳	100,000	1,930,000.00	0.04
457	600523	贵航股份	98,034	1,867,547.70	0.04
458	600586	金晶科技	225,648	1,859,339.52	0.03
459	002194	武汉凡谷	167,000	1,853,700.00	0.03
460	600653	申华控股	542,683	1,850,549.03	0.03
461	600601	方正科技	514,080	1,840,406.40	0.03
462	000410	沈阳机床	167,877	1,839,931.92	0.03
463	600685	广船国际	61,115	1,835,894.60	0.03
464	600141	兴发集团	86,863	1,811,962.18	0.03
465	600109	国金证券	123,936	1,803,268.80	0.03
466	000686	东北证券	88,632	1,781,503.20	0.03
467	002242	九阳股份	136,976	1,712,200.00	0.03
468	600844	丹化科技	96,002	1,676,194.92	0.03
469	000793	华闻传媒	295,300	1,671,398.00	0.03
470	600963	岳阳林纸	189,124	1,618,901.44	0.03
471	000822	山东海化	150,869	1,599,211.40	0.03
472	600983	合肥三洋	124,934	1,490,462.62	0.03
473	000650	仁和药业	102,841	1,463,427.43	0.03
474	000655	金岭矿业	73,952	1,413,222.72	0.03
475	600827	友谊股份	81,621	1,381,843.53	0.03
476	000636	风华高科	129,744	1,357,122.24	0.03
477	600747	大连控股	165,912	1,342,228.08	0.03
478	002048	宁波华翔	110,950	1,328,071.50	0.02
479	002310	东方园林	14,733	1,325,970.00	0.02
480	600825	新华传媒	191,044	1,312,472.28	0.02
481	601818	光大银行	390,808	1,309,206.80	0.02
482	000887	中鼎股份	100,000	1,297,000.00	0.02
483	002029	七匹狼	40,328	1,278,397.60	0.02

484	002241	歌尔声学	49,575	1,258,213.50	0.02
485	600978	宜华木业	211,059	1,184,040.99	0.02
486	002083	孚日股份	146,700	1,183,869.00	0.02
487	600020	中原高速	344,198	1,142,737.36	0.02
488	600078	澄星股份	108,607	1,111,049.61	0.02
489	600221	海南航空	155,176	1,107,956.64	0.02
490	600509	天富热电	102,953	1,106,744.75	0.02
491	000059	辽通化工	79,264	1,076,405.12	0.02
492	600246	万通地产	209,382	1,046,910.00	0.02
493	600569	安阳钢铁	273,155	1,010,673.50	0.02
494	600270	外运发展	119,350	989,411.50	0.02
495	000951	中国重汽	53,306	985,094.88	0.02
496	600282	南钢股份	240,569	964,681.69	0.02
497	000725	京东方 A	353,224	964,301.52	0.02
498	000006	深振业 A	164,966	958,452.46	0.02
499	000078	海王生物	96,598	923,476.88	0.02
500	601718	际华集团	200,000	920,000.00	0.02
501	002056	横店东磁	33,409	917,077.05	0.02
502	000503	海虹控股	98,598	903,157.68	0.02
503	000717	韶钢松山	213,175	816,460.25	0.02
504	600522	中天科技	32,175	760,617.00	0.01
505	600178	东安动力	71,644	701,394.76	0.01
506	600122	宏图高科	106,228	666,049.56	0.01
507	600006	东风汽车	149,293	653,903.34	0.01
508	600330	天通股份	50,816	636,724.48	0.01
509	000829	天音控股	67,592	617,790.88	0.01
510	000927	一汽夏利	60,568	427,610.08	0.01
511	600022	济南钢铁	82,907	395,466.39	0.01
512	000533	万家乐	53,478	394,667.64	0.01
513	601600	中国铝业	34,501	379,856.01	0.01
514	002142	宁波银行	33,600	365,568.00	0.01
515	000728	国元证券	22,601	255,391.30	0.00
516	000518	四环生物	27,300	208,026.00	0.00
517	000751	锌业股份	24,500	191,345.00	0.00
518	000780	平庄能源	11,400	181,260.00	0.00
519	000998	隆平高科	6,100	158,600.00	0.00
520	000066	长城电脑	20,300	144,130.00	0.00
521	000598	兴蓉投资	7,832	141,759.20	0.00
522	000522	白云山 A	9,600	139,200.00	0.00
523	000682	东方电子	21,400	136,746.00	0.00
524	000661	长春高新	2,701	128,297.50	0.00

525	000627	天茂集团	27,700	122,157.00	0.00
526	600326	西藏天路	8,304	119,909.76	0.00
527	600151	航天机电	10,353	119,370.09	0.00
528	000159	国际实业	8,600	119,110.00	0.00
529	600439	瑞贝卡	10,700	118,342.00	0.00
530	002051	中工国际	4,300	117,820.00	0.00
531	600239	云南城投	8,840	113,682.40	0.00
532	600069	银鸽投资	11,700	112,554.00	0.00
533	002140	东华科技	4,100	112,545.00	0.00
534	002005	德豪润达	6,818	111,133.40	0.00
535	600651	飞乐音响	11,100	109,779.00	0.00
536	002064	华峰氨纶	11,312	108,142.72	0.00
537	000301	东方市场	26,301	107,308.08	0.00
538	600054	黄山旅游	6,441	107,049.42	0.00
539	600637	广电信息	8,400	104,580.00	0.00
540	600662	强生控股	15,297	102,183.96	0.00
541	000708	大冶特钢	6,600	101,046.00	0.00
542	600773	西藏城投	4,100	96,760.00	0.00
543	600295	鄂尔多斯	5,001	96,469.29	0.00
544	600482	风帆股份	6,309	96,022.98	0.00
545	600702	沱牌曲酒	4,475	92,453.50	0.00
546	000911	南宁糖业	5,050	90,900.00	0.00
547	600468	百利电气	3,300	89,793.00	0.00
548	600186	莲花味精	16,800	89,544.00	0.00
549	000712	锦龙股份	6,500	89,115.00	0.00
550	601002	晋亿实业	4,800	88,752.00	0.00
551	600158	中体产业	13,755	86,656.50	0.00
552	000572	海马汽车	16,700	85,170.00	0.00
553	002431	棕榈园林	3,200	84,352.00	0.00
554	600736	苏州高新	13,300	83,790.00	0.00
555	600300	维维股份	15,900	81,885.00	0.00
556	000158	常山股份	12,300	78,351.00	0.00
557	600521	华海药业	5,400	76,572.00	0.00
558	600059	古越龙山	7,300	76,504.00	0.00
559	600724	宁波富达	8,500	76,415.00	0.00
560	600877	中国嘉陵	9,400	76,328.00	0.00
561	600790	轻纺城	9,500	76,285.00	0.00
562	000428	华天酒店	13,204	74,866.68	0.00
563	600121	郑州煤电	6,800	71,604.00	0.00
564	600491	龙元建设	10,860	71,024.40	0.00
565	600545	新疆城建	7,700	70,686.00	0.00

566	000828	东莞控股	12,300	69,987.00	0.00
567	600139	西部资源	2,800	67,536.00	0.00
568	600086	东方金钰	3,400	67,048.00	0.00
569	600657	信达地产	10,500	66,885.00	0.00
570	600157	永泰能源	3,930	64,962.90	0.00
571	601099	太平洋	6,700	63,114.00	0.00
572	600707	彩虹股份	4,800	59,712.00	0.00
573	600510	黑牡丹	5,888	57,584.64	0.00
574	600725	云维股份	6,100	56,242.00	0.00
575	600754	锦江股份	3,200	55,712.00	0.00
576	601003	柳钢股份	10,100	52,924.00	0.00
577	600438	通威股份	6,700	52,126.00	0.00
578	600676	交运股份	8,000	51,440.00	0.00
579	600184	光电股份	1,400	49,476.00	0.00
580	600102	莱钢股份	5,100	48,348.00	0.00
581	600146	大元股份	2,100	47,145.00	0.00
582	600726	华电能源	12,400	42,780.00	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002596	海南瑞泽	500	6,075.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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比例（%）
1	601166	兴业银行	61,174,264.91	0.98
2	600585	海螺水泥	43,192,076.64	0.70
3	600048	保利地产	41,093,425.99	0.66
4	600016	民生银行	39,473,452.60	0.64
5	601668	中国建筑	35,613,747.85	0.57
6	600031	三一重工	35,558,239.62	0.57
7	000858	五粮液	34,176,726.27	0.55
8	600036	招商银行	30,553,590.82	0.49
9	600276	恒瑞医药	30,419,819.62	0.49
10	600030	中信证券	30,374,094.19	0.49

11	002304	洋河股份	27,686,107.63	0.45
12	000002	万科A	27,492,061.21	0.44
13	601766	中国南车	26,675,766.30	0.43
14	600795	国电电力	25,435,738.00	0.41
15	601939	建设银行	24,754,975.65	0.40
16	000651	格力电器	24,015,002.22	0.39
17	601088	中国神华	23,675,906.21	0.38
18	601601	中国太保	23,567,958.37	0.38
19	000527	美的电器	22,890,342.12	0.37
20	000983	西山煤电	22,169,563.04	0.36

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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比例 (%)
1	601318	中国平安	67,209,973.43	1.08
2	601166	兴业银行	50,277,505.92	0.81
3	600031	三一重工	49,076,062.43	0.79
4	600585	海螺水泥	47,868,392.53	0.77
5	600036	招商银行	45,149,593.31	0.73
6	600519	贵州茅台	43,547,903.63	0.70
7	000858	五粮液	37,496,617.65	0.60
8	600104	上海汽车	33,945,957.61	0.55
9	002024	苏宁电器	33,800,688.35	0.54
10	000983	西山煤电	33,156,081.72	0.53
11	600362	江西铜业	31,070,244.84	0.50
12	601766	中国南车	30,176,743.03	0.49
13	000157	中联重科	29,890,575.77	0.48
14	000012	南玻A	26,901,704.89	0.43
15	600276	恒瑞医药	26,793,289.67	0.43
16	600028	中国石化	26,424,500.50	0.43
17	000528	柳工	25,954,504.12	0.42
18	600016	民生银行	25,943,199.96	0.42
19	600123	兰花科创	24,634,864.33	0.40
20	002202	金风科技	24,265,748.60	0.39

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,790,139,786.55
卖出股票的收入（成交）总额	2,446,967,711.34

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	154,480,000.00	2.91
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	991,094.40	0.02
8	其他	-	-
9	合计	155,471,094.40	2.92

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101022	11 央票 22	1,600,000	154,480,000.00	2.91
2	110016	川投转债	8,640	991,094.40	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 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

无。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 2011 年 5 月 27 日，五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。报告期内，基金投资的前十名其他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、处罚的情况。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	837,767.39
2	应收证券清算款	3,640,310.39
3	应收股利	3,893,246.37
4	应收利息	1,165,916.60
5	应收申购款	6,218,762.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,756,002.99

7.9.4 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。

7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票未出现流通受限情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002596	海南瑞泽	6,075.00	0.00	新股网上认购

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

(户)	额	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
227,041	28,348.01	1,594,111,223.53	24.77%	4,842,049,757.78	75.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,900,296.00	0.05%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002年11月8日）基金份额总额	3,094,001,262.00
本报告期期初基金份额总额	7,111,925,703.93
本报告期基金总申购份额	1,495,788,503.87
减：本报告期基金总赎回份额	2,171,553,226.49
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,436,160,981.31

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国银河证券股份有限公司	1	1,719,285,428.05	40.65%	1,461,389.10	41.18%	-
招商证券股份有限公司	1	1,200,047,165.77	28.38%	975,045.40	27.47%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	861,054,616.36	20.36%	731,893.72	20.62%	-
申银万国证券股份有限公司	1	427,048,713.02	10.10%	362,990.80	10.23%	-
广发证券	1	21,710,807.77	0.51%	17,640.00	0.50%	-

有限公司						
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	8,596,606.80	84.36%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1,593,336.80	15.64%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金交易单元无变更情况。

2、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能够针对本基金业务需要, 提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(3) 具有战略规划和定位, 能够积极推动多边业务合作, 最大限度地调动整体资源, 为基金投资赢取机会;

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》, 对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部或基金投资部/市场部汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果, 择优选出拟新增单元, 填写《新增交易单元申请审核表》, 对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或基金投资部/市场部提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核, 并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》, 并通知基金托管人。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于参加深圳发展银行股份有限公司基金定期定额投资、网上银行及电话银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-01-04
2	关于参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-01-04
3	华安MSCI中国A股指数增强型证券投资	《上海证券报》、	2011-01-13

	基金分红公告，向基金持有人按每10份基金份额派发现金红利0.10元。	《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	
4	关于参加温州银行股份有限公司个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-01-31
5	关于新增浙商证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-01-31
6	关于新增财达证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-02-14
7	关于旗下基金持有的“上海汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-02-19
8	关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定投业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-03-10
9	关于新增哈尔滨银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-03-21
10	关于旗下基金持有的“双汇发展”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-03-23
11	关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-03-31
12	关于旗下基金持有的“上海汽车”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-04-08
13	关于新增民生证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-04-11
14	关于参加华夏银行-盈基金2011网上银	《上海证券报》、	2011-04-18

	行基金申购4折优惠活动的公告	《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	
15	关于新增浙江稠州商业银行股份有限公司为基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-04-18
16	关于新增烟台银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-04-23
17	关于旗下基金持有的“中百集团”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-06-01
18	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-06-30
19	关于新增大连银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2011-06-30

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

11 备查文件目录

11.1 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》及其更新
- 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

11.2 存放地点

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>。

11.3 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
二〇一一年八月二十九日