

华安宏利股票型证券投资基金 2007 年年度报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

签发日期：二〇〇八年三月二十七日

一、	重要提示	3
二、	基金产品概况	3
	1、基金概况	3
	2、基金的投资	3
	3、基金管理人	4
	4、基金托管人	4
	5、信息披露	4
	6、其他有关资料	4
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
	1、新会计准则下基金近三年主要财务指标	5
	2、净值表现	5
	3、过往三年基金收益分配情况	7
四、	管理人报告	7
	1、基金管理人和基金经理简介	7
	2、基金运作合规性声明	7
	3、基金经理工作报告	8
	4、内部监察报告	8
五、	托管人报告	9
六、	审计报告	9
七、	财务会计报告	10
	(一)、资产负债表	11
	(二)、利润表	12
	(三)、所有者权益（基金净值）变动表	12
	(四)、会计报表附注	13
八、	投资组合报告	30
	(一)、报告期末基金资产组合	30
	(二)、报告期末股票投资组合	30
	(三)、报告期末股票明细	31
	(四)、报告期内股票投资组合的重大变动	33
	(五)、报告期末债券投资组合	38
	(六)、报告期末前五名债券明细	38
	(七)、报告期末权证投资组合	38
	(八)、资产支持证券投资组合	39
	(九)、投资组合报告附注	39
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	40
十、	开放式基金份额变动	40
十一、	重大事件	40
十二、	备查文件目录	47

一、重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2008 年 3 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告的财务报表部分已经审计。

二、基金产品概况

1、基金概况

基金名称:	华安宏利股票型证券投资基金
基金简称:	华安宏利
交易代码:	040005
深交所行情代码:	160406
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2006 年 9 月 6 日
期末基金份额总额:	5,237,124,136.00 份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

投资目标: 通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益,以及分红所带来的红利收益,实现基金资产的稳定增值。

投资策略: 本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持,使其更为科学和客观。

业绩比较基准: 基金整体业绩比较基准=中信标普 300 指数收益率×90%+同业存款利率×10%

风险收益特征:

本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的稳定增值。

3、基金管理人

基金管理人: 华安基金管理有限公司
注册地址: 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼
(邮政编码: 200120)
办公地址: 上海市浦东南路 360 号
新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼
(邮政编码: 200120)
法定代表人: 俞妙根
总经理: 俞妙根
信息披露负责人: 冯颖
联系电话: 021-38969999
传真: 021-68863414
电子邮箱: fengying@huan.com.cn
客户服务热线: 021-68604666, 40088-50099

4、基金托管人

基金托管人: 中国建设银行股份有限公司(简称“建设银行”)
注册地址: 北京市西城区金融大街 25 号
办公地址: 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
(邮政编码: 100032)
法定代表人: 郭树清
信息披露负责人: 尹东
联系电话: 010-67595003
传真: 010-66275833
电子邮箱: yindong@ccb.cn

5、信息披露

信息披露报纸: 中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址: <http://www.huan.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

6、其他有关资料

会计师事务所: 普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址: 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
登记注册机构: 华安基金管理有限公司

办公地点:

上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(除特殊注明外, 单位: 人民币元)

1、新会计准则下基金近三年主要财务指标

序号	主要财务指标	2007 年	2006 年 9 月 6 日至 2006 年 12 月 31 日
1	本期利润	8,206,673,812.37	659,838,721.04
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	5,326,140,112.38	198,999,915.59
3	加权平均份额本期利润	1.9197	0.3929
4	期末可供分配利润	4,853,453,148.26	193,620,677.62
5	期末可供分配份额利润	0.9267	0.1182
6	期末基金资产净值:	16,640,603,735.18	2,289,236,064.30
7	期末基金份额净值:	3.1774	1.3976
8	加权平均净值利润率	72.56%	34.89%
9	本期份额净值增长率	166.25%	39.76%
10	份额累计净值增长率	272.11%	39.76%

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

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

2、净值表现

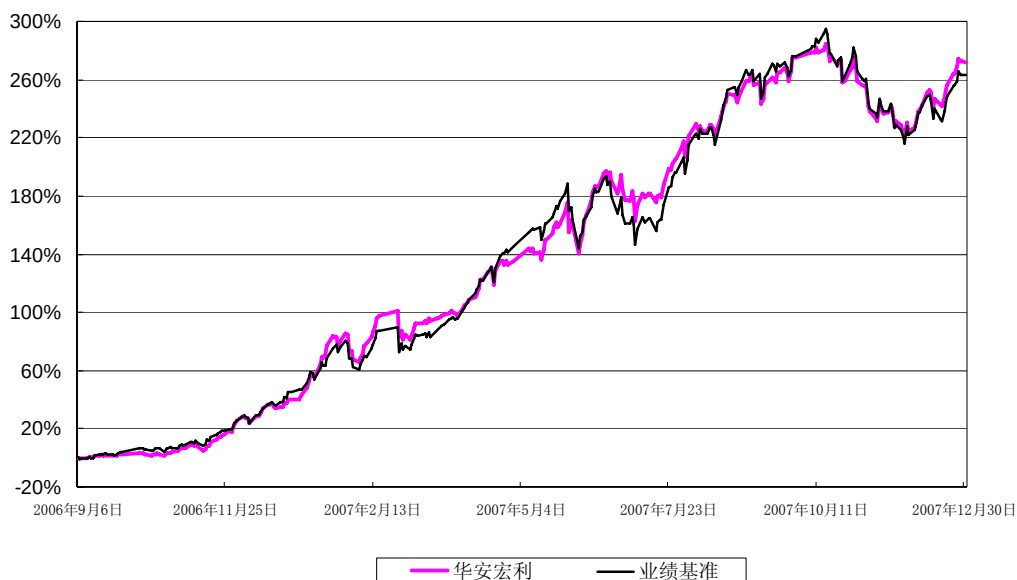
A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.88%	1.64%	-3.14%	1.76%	2.26%	-0.12%
过去六个月	34.11%	1.74%	36.94%	1.85%	-2.83%	-0.11%
过去一年	166.25%	2.10%	145.35%	2.06%	20.90%	0.04%
自基金合同生效起至今	272.11%	1.91%	263.53%	1.88%	8.58%	0.03%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

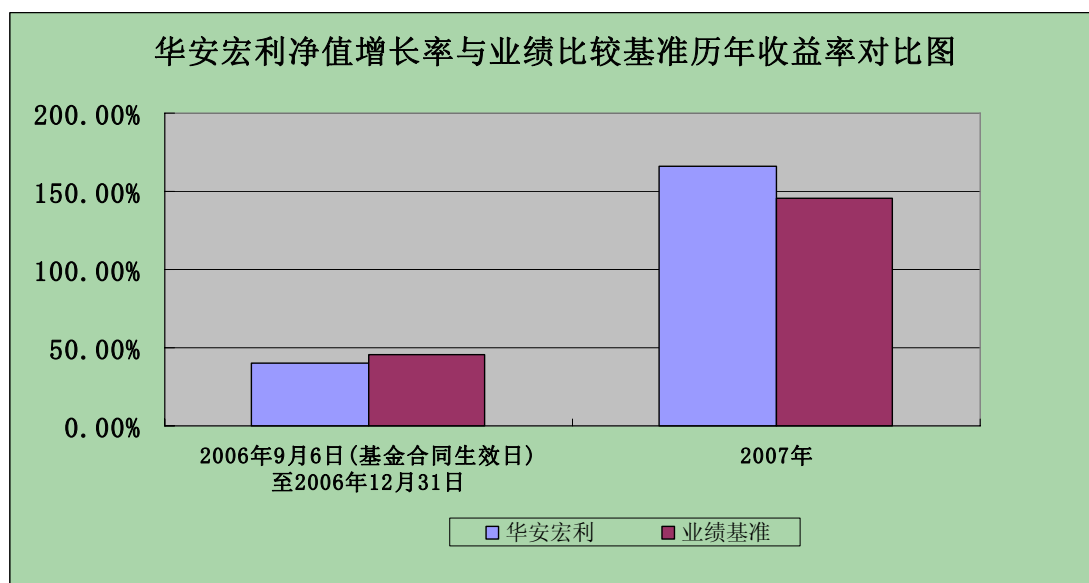
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华安宏利份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图
2006/9/6--2007/12/31



C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准的收益率对比图



3、过往三年基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日	无	
2007 年	3.90 元	
合计	3.90 元	

四、管理人报告

1、基金管理人和基金经理简介

(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 2007 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺 2 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、上证 180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安国际配置(QDII)等 9 只开放式基金，管理资产规模达到 1074 亿人民币、1.31 亿美元。

(2) 基金经理

尚志民先生：工商管理硕士，11 年证券、基金从业经验，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，1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任基金安顺的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月担任基金安瑞的基金经理，2001 年 9 月至 2003 年 9 月担任华安创新的基金经理，2003 年 9 月至今担任基金安顺的基金经理，2006 年 9 月至今担任华安宏利的基金经理，现任基金投资部总经理。

汪光成先生，管理学博士，持有基金从业资格证书，6 年证券、基金行业从业经历，曾在深圳华为公司工作，2002 年 1 月加入华安基金管理有限公司后，曾先后在战略策划部、研究发展部工作，从事数量分析和行业研究工作。2008 年 2 月至今担任基金安顺和华安宏利的基金经理。

2、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》、《华安宏利股票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。

3、基金经理工作报告

2007 年，在国内经济持续向好和流动性过剩背景下，投资者表现出了极大的热情，投资热点纷呈，市场出现了普遍性的大幅度上涨，虽然四季度市场出现了调整，但沪深两市指数年涨幅仍然巨大。

在报告期内，本基金基于对市场的良好预期，全年在股票类资产上保持高比例配置，并在大部分期间采取行业集中的策略，较好的把握了股市持续上涨和行业趋势良好带来的投资机会。在组合策略方面，采取自上而下的选股策略，重点投资于拥有资源尤其是不可再生资源的企业，拥有品牌、渠道和技术优势的消费和制造企业，以及具备良好成长潜力或行业趋势向好的企业，并在四季度根据市场环境的变化，适时降低了有色金属、房地产行业的配置，有效控制了组合的波动风险。

展望 2008 年，市场面临的不确定性比较多。首先，国内通货膨胀问题明显，物价上涨存在从结构性到全面性转变的担忧，预计国内货币政策从紧的基调不会变化，宏观调控的压力仍然比较大；其次，美国次级债问题引致的全球经济减速，使得国内经济增长的外部环境发生不利变化；第三，“大小非”解禁的高峰期来临，股票供需格局发生一定的变化。我们认为，与海外市场相比，A 股市场估值水平相对较高，随着经济不确定性的增加，行业趋势和企业盈利增长预期都可能发生变化，各类股东间的利益博弈和估值方面的分歧都可能导致市场的波动比较大。尽管存在诸多困难，但我们认为，中国经济增长结构转变过程中，消费升级、节能减排、企业技术进步，以及国家财政政策的变化等，都将出现很多良好的投资标的。

操作策略上，我们认为今年组合操作的难度非常大，本基金将继续强调估值管理和组合的流动性，在行业和个股配置方面保持相对分散，重点关注通货膨胀受益类、节能减排、医改以及经济结构性调整受益的公司，构建部分主题投资组合。同时，在大类资产配置比例方面将采取相对灵活的策略，不断优化组合结构，控制组合整体风险，力求基金净值的稳定可持续增长。

4、内部监察报告

本报告期内，监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，强化员工的合规意识，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

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

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

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

(4) 进一步完善投资交易系统控制功能, 防范合规风险, 提高合规监察效率;

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

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性, 努力防范和控制各种风险, 保障基金份额持有人的合法权益。

五、 托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和《华安宏利股票型证券投资基金托管协议》, 托管华安宏利股票型证券投资基金(以下简称华安宏利基金)。

本报告期, 中国建设银行股份有限公司在华安宏利基金的托管过程中, 严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

本报告期, 按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定, 本托管人对基金管理人—华安基金管理有限公司在华安宏利基金投资运作方面进行了监督, 对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核, 发现少数监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。基金管理人在合理期限内进行了调整, 对基金份额持有人利益未造成损害。

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

六、 审计报告

普华永道中天审字(2008)第 20241 号

华安宏利股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华安宏利股票型证券投资基金(以下简称“华安宏利基金”)的财务报表, 包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表、2007 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

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

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

二、 注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

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

普华永道中天
会计师事务所有限公司

中国·上海市

注册会计师
薛 竞
注册会计师
金 毅
2008 年 3 月 27 日

七、 财务会计报告

(除特殊注明外，单位：人民币元)

(一)、资产负债表

项 目	附注	2007年12月31日	2006年12月31日
资产：			
银行存款		1,616,860,530.71	16,281,701.93
结算备付金		15,642,066.11	6,931,569.23
存出保证金		4,983,574.06	464,076.34
交易性金融资产	9(1)	15,255,320,879.00	2,200,146,335.33
其中：股票投资		14,384,462,879.00	2,073,872,155.33
债券投资		870,858,000.00	126,274,180.00
资产支持证券投资		0.00	0.00
衍生金融资产	9(2)	0.00	61,695,937.50
买入返售金融资产		0.00	0.00
应收证券清算款		7,504,572.29	18,494,198.12
应收利息	9(3)	12,699,620.13	151,504.29
应收股利		0.00	0.00
应收申购款		91,788,017.10	15,916,124.77
其他资产		0.00	0.00
资产合计		17,004,799,259.40	2,320,081,447.51
负债：			
短期借款		0.00	0.00
交易性金融负债		0.00	0.00
衍生金融负债		0.00	0.00
卖出回购金融资产款		0.00	0.00
应付证券清算款		283,308,023.85	0.00
应付赎回款		48,799,224.43	23,796,341.28
应付管理人报酬		19,378,560.78	2,841,115.32
应付托管费		3,229,760.12	473,519.22
应付销售服务费		0.00	0.00
应付交易费用	9(4)	8,504,225.87	3,064,722.55
应交税费		0.00	0.00
应付利息	9(5)	0.00	0.00
应付利润		0.00	0.00
其他负债	9(6)	975,729.17	669,684.84
负债合计		364,195,524.22	30,845,383.21
所有者权益：			
实收基金	9(7)	5,237,124,136.00	1,637,980,896.86
未分配利润		11,403,479,599.18	651,255,167.44
所有者权益合计		16,640,603,735.18	2,289,236,064.30
负债和所有者权益合计		17,004,799,259.40	2,320,081,447.51
基金份额总额(份)		5,237,124,136.00	1,637,980,896.86

基金份额净值	3.1774	1.3976
--------	--------	--------

(二)、利润表

项 目	附注	2007年	2006年9月6日 (基金合同生效日) 至2006年12月31日
一、收入：			
1. 利息收入		23,317,407.96	1,636,582.70
其中：存款利息收入		8,256,497.17	1,445,012.39
债券利息收入		15,060,910.79	191,570.31
资产支持证券利息收入		0.00	0.00
买入返售金融资产收入		0.00	0.00
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,637,184,599.26	216,337,063.81
其中：股票投资收益	9(8)	5,553,764,149.39	215,453,626.80
债券投资收益	9(9)	4,732,581.71	4,535.34
资产支持证券投资收益		0.00	0.00
衍生工具收益	9(10)	21,975,421.86	14,022.05
股利收益		56,712,446.30	864,879.62
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	9(11)	2,880,533,699.99	460,838,805.45
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	9(12)	18,125,070.83	1,099,392.56
收入合计		8,559,160,778.04	679,911,844.52
二、费用：			
1、管理人报酬	8(3)	167,216,034.28	8,977,350.73
2、托管费	8(3)	27,869,339.04	1,496,225.16
3、销售服务费		0.00	0.00
4、交易费用	9(13)	150,198,408.72	9,408,041.90
5、利息支出		6,720,928.37	11,878.97
其中：卖出回购金融资产支出		6,720,928.37	11,878.97
6、其他费用	9(14)	482,255.26	179,626.72
费用合计		352,486,965.67	20,073,123.48
三、利润总额		8,206,673,812.37	659,838,721.04

(三)、所有者权益（基金净值）变动表

	实收基金	2007 年度 未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益（基金净值）	1,637,980,896.86	651,255,167.44	2,289,236,064.30

本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	0.00	8,206,673,812.37	8,206,673,812.37
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	3,599,143,239.14	4,223,505,541.26	7,822,648,780.40
其中:基金申购款	9,626,863,694.96	12,789,153,072.57	22,416,016,767.53
基金赎回款	6,027,720,455.82	8,565,647,531.31	14,593,367,987.13
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	1,677,954,921.89	1,677,954,921.89
年末所有者权益(基金净值)	5,237,124,136.00	11,403,479,599.18	16,640,603,735.18

2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)

至 2006 年 12 月 31 日止期间

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	1,684,224,358.17	0.00	1,684,224,358.17
本年经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	0.00	659,838,721.04	659,838,721.04
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	-46,243,461.31	-8,583,553.60	-54,827,014.91
其中:基金申购款	628,163,229.79	122,015,897.66	750,179,127.45
基金赎回款	674,406,691.10	130,599,451.26	805,006,142.36
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0.00	0.00	0.00
年末所有者权益(基金净值)	1,637,980,896.86	651,255,167.44	2,289,236,064.30

(四)、会计报表附注

1. 基金的基本情况

华安宏利股票型证券投资基金(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[2006]第143号《关于同意华安宏利股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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1,683,963,683.51元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第112号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于2006年9月6日正式生效,基金

合同生效日的基金份额总额为 1,684,224,358.17 份基金份额，其中认购资金利息折合 260,674.66 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中，股票投资比例占基金资产净值的目标比例为 90%，最低比例为 60%，最高比例为 95%。本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数收益率 $\times$ 90%+金融同业存款利率 $\times$ 10%。

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

2. 财务报表的编制基础

本基金原以 2006 年 2 月 15 日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》(以下合称“原会计准则和制度”)、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自 2007 年 7 月 1 日起，本基金执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007 年度财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的规定编制的年度财务报表。

在编制 2007 年度财务报表时，2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。按原会计准则和制度列报的 2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注 12。

3. 遵循企业会计准则的声明：

本基金 2007 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 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4. 重要会计政策和会计估计

1) 会计年度。

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日。

2) 记账本位币。

本基金的记帐本位币为人民币。

3) 金融资产和金融负债的分类及抵销

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

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

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

4) 基金资产的估值原则。

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

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的按最近交易日的市场交易收盘价估值。

首次公开发行但未上市的股票按成本估值。

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

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

2006 年 11 月 13 日之前取得的非公开发行股票，在锁定期内按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的按最近交易日的市场交易收盘价估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

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

(iii) 权证投资

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

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

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

5) 证券投资基金成本计价方法。

(i) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平

均法于交易日结转。

(2) 债券投资

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

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

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

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

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007 年 7 月 1 日之前，权证投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接记入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在债券取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

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

(ii) 贷款和应收款项

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

(iii) 其他金融负债

2007 年 7 月 1 日之前，其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账，并采用名义利率法确认负债相关的利息支出，其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额；自 2007 年 7 月 1 日起，其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收

入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

6) 收入/(损失)的确认和计量。

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

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

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

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

7) 费用的确认和计量。

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

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

8) 实收基金。

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

9) 损益平准金

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

10) 基金的收益分配政策。

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持



有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。本基金收益每年最多分配四次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金当期收益先弥补以前年度亏损后方可进行当年收益分配。基金当年亏损则不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

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

5. 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(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。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。

(d) 基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3%的税率缴纳。

(e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6. 资产负债表日后事项：

无。

7. 重大会计差错的内容和更正金额：

无。

8. 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”)	基金管理人 基金注册登记机构 基金销售机构	提取管理费 持有本基金	基金合同
中国建设银行股份有限公司 (“建设银行”)	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(原名 为上海国际信托投资有限公 司)	基金管理人的股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人的股东(2007 年 11 月 20 日之前)		
上海锦江国际投资管理有限公 司	基金管理人的股东(2007 年 11 月 20 日起)		
上海沸点投资发展有限公司	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		

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

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交易单元的股票成交量:无。

上年度通过关联人交易单元的股票成交量:无。

② 本报告期通过关联人交易单元的债券、回购和权证成交量:无。

上年度通过关联人交易单元的债券、回购和权证成交量:无。

③ 本报告期与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

关 联 人	买入债券 结算金额	卖出债券 结算金额	买入返售 证券	利息收 入	卖出回购证券	利息支出
建设银行	0.00	0.00	0.00	0.00	126,400,000.00	65,705.00

上年度本基金与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易:无。

(3). 关联方报酬

① 基金管理人报酬

本基金应支付基金管理人管理费,按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提,计算方法如下:

$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 167,216,034.28 元。(2006 期间: 8,977,350.73 元)

② 基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提,计算方法如下:

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

本基金在本报告期间需支付基金托管费 27,869,339.04 元。(2006 期间: 1,496,225.16 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建设银行保管,并按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 1,616,860,530.71 元(2006 年末: 16,281,701.93 元)。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 7,269,211.23 元(2006 期间: 1,414,010.38 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:

本报告期基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	期初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有限公司	0.00	0.00%	9,114,850.11	0.00	9,114,850.11	0.17%	0.24%

基金管理人华安基金管理有限公司在本年度运用自有资金 26,000,000.00 元经代销机构购入本基金 9,114,850.11 份基金份额,申购费 62,250.60 元。2007 年 12 月 31 日,华安基金管理有限公司持有本基金总份额的 0.17%。

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:

本报告期末无。

9. 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



项目	2007-12-31			2006-12-31		
	成本	市值	估值增值	成本	市值	估值增值
股票投资	11,043,340,189.46	14,384,462,879.00	3,341,122,689.54	1,638,124,588.37	2,073,872,155.33	435,747,566.96
交易所市场	99,618,850.00	99,680,000.00	61,150.00	17,124,668.84	17,086,700.00	-37,968.84
债券 银行间	770,989,334.10	771,178,000.00	188,665.90	109,187,480.00	109,187,480.00	0.00
投资 市场						
合计	870,608,184.10	870,858,000.00	249,815.90	126,312,148.84	126,274,180.00	-37,968.84
资产支持证 券投资						
基金投资 （适用于						

(2) 衍生金融资产项目说明

项目	2007-12-31			2006-12-31		
	成本	市值	估值增值	成本	市值	估值增值
权证投资	0.00	0.00	0.00	36,566,730.17	61,695,937.50	25,129,207.33
其他衍生金融资产 （适用于 QDII 基金）						

(3) 应收利息项目说明：

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应收银行存款利息	417,904.35	18,607.00
应收结算备付金利息	7,038.90	3,119.20
应收债券利息	12,264,128.76	129,778.09
应收基金申购款利息	10,548.12	0.00
合计	12,699,620.13	151,504.29

(4) 应付交易费用项目说明：

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付银行间交易费用	9,441.85	0.00
应付交易所交易佣金合计	8,494,784.02	3,064,722.55
其中：兴业证券股份有限公司	1,263,250.25	587,832.72
国泰君安证券股份有限公司	1,004,627.48	195,919.86
申银万国证券股份有限公司	1,116,054.40	611,177.89
招商证券股份有限公司	1,808,657.62	820,388.57
长江证券股份有限公司	0.00	620,376.66
中信建投证券有限责任公司	1,011,867.83	229,026.85
中信证券股份有限公司	2,290,326.44	0.00
合计	8,504,225.87	3,064,722.55

(5) 应付利息项目说明:

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
合计	0.00	0.00

(6) 其他负债项目说明:

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
预提审计费用	120,000.00	80,000.00
预提信息披露费	180,000.00	0.00
应付基金赎回费	175,729.17	89,684.84
合计	975,729.17	669,684.84

(7) 实收基金变动明细:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2006 年 12 月 31 日
期初数	1,637,980,896.86	1,684,224,358.17
加: 本期因申购增加数	9,626,863,694.96	628,163,229.79
其中: 红利再投资	380,131,583.34	0.00
减: 本期因赎回减少数	6,027,720,455.82	674,406,691.10
期末数	5,237,124,136.00	1,637,980,896.86

(8) 股票投资收益项目说明:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2006 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	20,118,666,268.12	1,602,869,350.35
减: 卖出股票成本总额	14,564,902,118.73	1,387,415,723.55
股票投资收益	5,553,764,149.39	215,453,626.80

(9) 债券投资收益项目说明:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2006 年 12 月 31 日
卖出及到期兑付债券结算金	1,186,222,506.01	8,598,307.57
减: 应收利息总额	20,044,962.12	30,197.17
减: 卖出及到期兑付债券成本	1,161,444,962.18	8,563,575.06
债券投资收益	4,732,581.71	4,535.34

(10) 衍生工具投资收益项目说明:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日
		(基金合同生效日)
		至 2006 年 12 月 31 日
卖出权证成交金额	355,407,887.42	83,921.15
减: 卖出权证成本总额	333,432,465.56	69,899.10
衍生工具投资收益项目	21,975,421.86	14,022.05

(11) 公允价值变动收益/损失项目说明

项目名称	2007 年度	2006 年度
交易性金融资产		
——股票投资	2,905,375,122.58	435,747,566.96
——债券投资(银行间市场)	188,665.90	0.00
——债券投资(交易所市场)	99,118.84	-37,968.84
——资产支持证券投资	0.00	0.00
——基金投资(适用于 QDII 基金)	0.00	0.00
衍生工具		
——权证投资	-25,129,207.33	25,129,207.33
——其他衍生工具(适用于 QDII 基金)	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00
合计	2,880,533,699.99	460,838,805.45

(12) 其他收入:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日
		(基金合同生效日)
		至 2006 年 12 月 31 日
开放式基金赎回费收入(a)	18,123,726.82	1,006,257.99
基金合同生效前认购资金利息收入	0.00	93,134.57
利息补偿收入(b)	1,344.01	0.00
合计	18,125,070.83	1,099,392.56

(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减, 赎回费总额的 25% 归入基金资产。

(b) 本基金参与新股网下申购, 未中签的退款资金未及时到账, 相关责任机构给予本基金利息补偿。

(13) 交易费用:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日
		(基金合同生效日)
		至 2006 年 12 月 31 日
交易所市场	150,183,149.42	9,407,466.90
银行间市场	15,259.30	575.00
合计	150,198,408.72	9,408,041.90

(14) 其他费用:

明细项目	2007 年	2006 年 9 月 6 日
		(基金合同生效日)
		至 2006 年 12 月 31 日
信息披露费	280,000.00	90,000.00
审计费用	120,000.00	80,000.00
银行托管帐户维护费	18,000.00	0.00
银行费用	64,255.26	9,626.72
合计	482,255.26	179,626.72

(15) 收益分配：

	登记日	分红率	现金 形式发放	再投资 形式发放	发放红利 合计
第一次中 期分红	07/01/15	每 10 份基 金份额 0.80 元	81,659,060.64	53,734,500.66	135,393,561.30
第二次中 期分红	07/08/07	每 10 份基 金份额 3.10 元	582,589,484.00	959,971,876.59	1,542,561,360.59
			664,248,544.64	1,013,706,377.25	1,677,954,921.89

10. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末因认购新发或增发证券而于期末持有的流通受限证券列示如下:

基金可使用以基金名义开设的股票账户, 比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股, 根据基金与上市公司所签订申购协议的规定, 在新股上市后的约定期限内不能自由转让; 基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股, 从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外, 基金还可作为特定投资者, 认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票, 所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额
601088	中国神华	2007-9-27	2008-1-9	网下	36.99	65.61	279,800	10,349,802.00	18,357,678.00
601601	中国太保	2007-12-18	2008-3-26	网下	30.00	49.45	638,742	19,162,260.00	31,585,791.90
601857	中国石油	2007-10-30	2008-2-5	网下	16.70	30.96	2,090,000	34,903,000.00	64,706,400.00
601999	出版传媒	2007-12-18	2008-3-21	网下	4.64	20.24	203,277	943,205.28	4,114,326.48
600125	铁龙物流	2007-12-27	2008-2-19	增发	11.67	13.14	1,200,000	14,004,000.00	15,768,000.00
002177	御银股份	2007-10-24	2008-2-1	网下	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00
002178	延华智能	2007-10-24	2008-2-1	网下	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80
002181	粤传媒	2007-11-7	2008-2-18	网下	7.49	26.68	12,421	93,033.29	331,392.28
002182	云海金属	2007-11-2	2008-2-13	网下	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08
002183	怡亚通	2007-11-2	2008-2-13	网下	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20
002184	海得控制	2007-11-7	2008-2-18	网下	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52
002185	华天科技	2007-11-8	2008-2-20	网下	10.55	21.44	33,697	355,503.35	722,463.68
002186	全聚德	2007-11-7	2008-2-20	网下	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
002187	广百股份	2007-11-12	2008-2-22	网下	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
002188	新嘉联	2007-11-12	2008-2-22	网下	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
002194	武汉凡谷	2007-11-28	2008-3-7	网下	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
002195	海隆软件	2007-12-4	2008-3-12	网下	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
002196	方正电机	2007-12-4	2008-3-12	网下	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
002199	东晶电子	2007-12-12	2008-3-21	网下	8.80	25.50	9,645	84,876.00	245,947.50
002201	九鼎新材	2007-12-13	2008-3-26	网下	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
002202	金风科技	2007-12-18	2008-3-26	网下	36.00	140.45	40,866	1,471,176.00	5,739,629.70
合 计								84,172,393.92	150,092,738.11

说明：“网下”是指新股网下申购流通受限，“增发”是指公开增发流通受限。

(2)、本基金截止本报告期末持有的暂时停牌股票列示如下：

无。

(3)、期末债券正回购交易中作为质押的债券：

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金从事银行间同业市场的债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元(2006 年：0.00 元)，质押债券： 无。

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元(2006 年：0.00 元)。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

(4) 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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

2007 年末和 2006 年末均无。

11. 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同责任，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证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

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

(c) 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除在附注 10 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金所持有的金融负债的合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。

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

(d) 市场风险

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

(i) 市场价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 60%—95%。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2007 年 12 月 31 日		2006 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值的比例	公允价值	占基金资产 净值的比例
交易性金融资产				
- 股票投资	14,384,462,879.00	86.44%	2,073,872,155.33	90.59%
- 债券投资	870,858,000.00	5.23%	126,274,180.00	5.52%
衍生金融资产	-	-	61,695,937.50	2.70%
	15,255,320,879.00	91.68%	2,261,842,272.83	98.80%

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准上升 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 7.64 亿元(2006 年：1.13 亿元)；反之，若本基金业绩比较基准下降 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 7.64 亿元(2006 年：1.13 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。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

2007 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	1 年至 5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,616,860,530.71	-	-	-	1,616,860,530.71
结算备付金	15,642,066.11	-	-	-	15,642,066.11
存出保证金	-	-	-	4,983,574.06	4,983,574.06
交易性金融资产	355,583,000.00	515,275,000.00	-	14,384,462,879.00	15,255,320,879.00
应收证券清算款	-	-	-	7,504,572.29	7,504,572.29
应收利息	-	-	-	12,699,620.13	12,699,620.13
应收申购款	-	-	-	91,788,017.10	91,788,017.10
资产总计	1,988,085,596.82	515,275,000.00	-	14,501,438,662.58	17,004,799,259.40

负债					
应付证券清算款	-	-	-	283,308,023.85	283,308,023.85
应付赎回款	-	-	-	48,799,224.43	48,799,224.43
应付管理人报酬	-	-	-	19,378,560.78	19,378,560.78
应付托管费	-	-	-	3,229,760.12	3,229,760.12
应付交易费用	-	-	-	8,504,225.87	8,504,225.87
其他负债	-	-	-	975,729.17	975,729.17
负债总计	-	-	-	364,195,524.22	364,195,524.22
利率敏感度缺口	1,988,085,596.82	515,275,000.00	-	14,137,243,138.36	16,640,603,735.18

2006 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	1 年至 5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	16,281,701.93	-	-	-	16,281,701.93
结算备付金	6,931,569.23	-	-	-	6,931,569.23
存出保证金	-	-	-	464,076.34	464,076.34
交易性金融资产		109,187,480.00	17,086,700.00	2,073,872,155.33	2,200,146,335.33
衍生金融资产	-	-	-	61,695,937.50	61,695,937.50
应收证券清算款	-	-	-	18,494,198.12	18,494,198.12
应收利息	-	-	-	151,504.29	151,504.29
应收申购款	-	-	-	15,916,124.77	15,916,124.77
资产总计	23,213,271.16	109,187,480.00	17,086,700.00	2,170,593,996.35	2,320,081,447.51
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	23,796,341.28	23,796,341.28
应付管理人报酬	-	-	-	2,841,115.32	2,841,115.32
应付托管费	-	-	-	473,519.22	473,519.22
应付交易费用	-	-	-	3,064,722.55	3,064,722.55
其他负债	-	-	-	669,684.84	669,684.84
负债总计	-	-	-	30,845,383.21	30,845,383.21
利率敏感度缺口	23,213,271.16	109,187,480.00	17,086,700.00	2,139,748,613.14	2,289,236,064.30

于 2007 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产的比例低于 10%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2006 年：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。

12. 首次执行企业会计准则

如附注所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，并已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的 2006 年 9 月 6 日(基金合同生效日)、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年 9 月 6 日(基金合



同生效日)至 2006 年 12 月 31 日止期间和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下:

项目	2006 年 9 月 6 日 (基金合同生效 日)所有者权益	2006 年 9 月 6 日(基 金合同生效日)至 2006 年 12 月 31 日 止期间净损益	2006 年 年末所有者权益
按原会计准则列报的金额	1,684,224,358.17	198,999,915.59	2,289,236,064.30
金融资产公允价值变动的调整数	0.00	460,838,805.45	0.00
按新会计准则列报的金额	1,684,224,358.17	659,838,721.04	2,289,236,064.30

项目	2007 年 年初所有者权益	2007 年 上半年净损益 (未经审计)	2007 年 上半年末所有者权益 (未经审计)
按原会计准则列报的金额	2,289,236,064.30	1,648,622,702.99	11,944,190,522.03
金融资产公允价值变动的 调整数	0.00	2,179,442,707.50	0.00
按新会计准则列报的金额	2,289,236,064.30	3,828,065,410.49	11,944,190,522.03

根据上述追溯调整,按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算,相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。于会计期末,按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额,现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

八、投资组合报告

(一)、报告期末基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	14,384,462,879.00	84.59%
2	债券	870,858,000.00	5.12%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款和结算备付金	1,632,502,596.82	9.60%
5	其它资产	116,975,783.58	0.69%
	合计	17,004,799,259.40	100.00%

(二)、报告期末股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	216,366,627.50	1.30%
B	采掘业	1,048,326,312.33	6.30%
C	制造业	6,472,574,049.06	38.90%



C0	食品、饮料	599,279,107.66	3.60%
C1	纺织、服装、皮毛	229,680,272.04	1.38%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,691,157,870.08	10.16%
C5	电子	310,262,903.98	1.86%
C6	金属、非金属	979,950,879.66	5.89%
C7	机械、设备、仪表	1,566,595,253.10	9.41%
C8	医药、生物制品	887,083,892.76	5.33%
C99	其他制造业	208,563,869.78	1.25%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,088,094,575.54	6.54%
F	交通运输、仓储业	1,502,783,657.76	9.03%
G	信息技术业	549,660,548.69	3.30%
H	批发和零售贸易	424,493,501.01	2.55%
I	金融、保险业	1,688,609,203.00	10.15%
J	房地产业	848,531,345.44	5.10%
K	社会服务业	299,000,892.50	1.80%
L	传播与文化产业	4,445,718.76	0.03%
M	综合类	241,576,447.41	1.45%
合计		14,384,462,879.00	86.44%

(三)、报告期末股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	600309	烟台万华	22,220,000	845,471,000.00	5.08%
2	601088	中国神华	11,999,953	787,316,916.33	4.73%
3	600036	招商银行	16,999,970	673,708,811.10	4.05%
4	600900	长江电力	30,777,777	599,858,873.73	3.60%
5	601919	中国远洋	14,030,389	598,536,394.74	3.60%
6	600030	中信证券	6,180,000	551,688,600.00	3.32%
7	600026	中海发展	12,190,000	451,273,800.00	2.71%
8	600786	东方锅炉	5,280,000	445,896,000.00	2.68%
9	000060	中金岭南	9,000,000	399,960,000.00	2.40%
10	600649	原水股份	18,199,911	366,000,210.21	2.20%
11	000651	格力电器	6,660,000	328,671,000.00	1.98%
12	600519	贵州茅台	1,259,868	289,769,640.00	1.74%
13	600269	赣粤高速	15,249,946	280,141,508.02	1.68%
14	600737	中粮屯河	14,379,755	275,228,510.70	1.65%
15	600325	华发股份	7,000,000	255,570,000.00	1.54%
16	601318	中国平安	2,390,000	253,579,000.00	1.52%
17	600315	上海家化	5,080,000	245,719,600.00	1.48%
18	600770	综艺股份	8,191,809	241,576,447.41	1.45%
19	600830	大红鹰	10,500,000	236,775,000.00	1.42%
20	600426	华鲁恒升	8,340,000	221,010,000.00	1.33%
21	600048	保利地产	3,390,000	219,739,800.00	1.32%
22	600271	航天信息	3,337,210	217,352,487.30	1.31%
23	600219	南山铝业	8,000,000	213,520,000.00	1.28%



24	000667	名流置业	14,135,460	205,529,588.40	1.24%
25	600535	天士力	8,888,800	195,642,488.00	1.18%
26	601699	潞安环能	2,690,000	193,061,300.00	1.16%
27	601398	工商银行	21,900,000	178,047,000.00	1.07%
28	600875	东方电气	2,000,000	178,000,000.00	1.07%
29	002022	科华生物	5,000,000	177,500,000.00	1.07%
30	600525	长园新材	3,763,900	175,811,769.00	1.06%
31	000565	渝三峡A	5,388,388	170,542,480.20	1.02%
32	000829	天音控股	6,362,125	167,705,615.00	1.01%
33	600549	厦门钨业	5,735,720	161,575,232.40	0.97%
34	002009	天奇股份	3,637,145	160,034,380.00	0.96%
35	002008	大族激光	5,185,100	159,182,570.00	0.96%
36	600588	用友软件	3,000,000	153,210,000.00	0.92%
37	600563	法拉电子	6,800,000	149,872,000.00	0.90%
38	600009	上海机场	3,880,000	145,577,600.00	0.87%
39	000963	华东医药	8,000,000	132,000,000.00	0.79%
40	002029	七匹狼	4,800,000	129,888,000.00	0.78%
41	600138	中青旅	3,890,000	129,692,600.00	0.78%
42	600828	*ST 成商	6,000,000	127,800,000.00	0.77%
43	600410	华胜天成	4,580,000	120,591,400.00	0.72%
44	600750	江中药业	5,999,970	110,399,448.00	0.66%
45	600323	南海发展	6,981,588	109,610,931.60	0.66%
46	600389	江山股份	3,699,998	107,521,941.88	0.65%
47	000608	阳光股份	7,089,838	106,914,757.04	0.64%
48	600054	黄山旅游	3,188,858	100,895,467.12	0.61%
49	600725	云维股份	2,905,900	100,892,848.00	0.61%
50	002122	天马股份	632,995	94,879,620.55	0.57%
51	600967	北方创业	5,222,998	89,208,805.84	0.54%
52	600555	九龙山	5,558,537	82,933,372.04	0.50%
53	600282	南钢股份	3,821,588	79,259,735.12	0.48%
54	000617	石油济柴	2,058,399	78,960,185.64	0.47%
55	600713	南京医药	4,880,000	77,689,600.00	0.47%
56	000157	中联重科	1,316,565	75,636,659.25	0.45%
57	600479	千金药业	1,597,083	69,824,468.76	0.42%
58	000028	一致药业	3,005,032	67,613,220.00	0.41%
59	002102	冠福家用	2,316,794	66,723,667.20	0.40%
60	601857	中国石油	2,090,000	64,706,400.00	0.39%
61	000978	桂林旅游	2,729,999	63,854,676.61	0.38%
62	600052	*ST 广厦	4,180,000	60,777,200.00	0.37%
63	002050	三花股份	1,899,999	57,284,969.85	0.34%
64	000997	新大陆	3,696,217	56,182,498.40	0.34%
65	002007	华兰生物	1,000,000	53,290,000.00	0.32%
66	600738	兰州民百	5,099,908	52,019,061.60	0.31%
67	600499	科达机电	1,994,082	50,968,735.92	0.31%
68	600075	新疆天业	2,578,750	48,661,012.50	0.29%



69	600001	邯郸钢铁	5,000,000	40,550,000.00	0.24%
70	600132	重庆啤酒	1,132,132	34,280,956.96	0.21%
71	002003	伟星股份	1,078,081	32,752,100.78	0.20%
72	601601	中国太保	638,742	31,585,791.90	0.19%
73	002036	宜科科技	799,000	16,858,900.00	0.10%
74	600125	铁龙物流	1,200,000	15,768,000.00	0.09%
75	601918	国投新集	793,000	12,624,560.00	0.08%
76	600456	宝钛股份	185,331	12,532,082.22	0.08%
77	600428	中远航运	294,900	11,486,355.00	0.07%
78	600327	大厦股份	500,000	7,050,000.00	0.04%
79	002202	金风科技	40,866	5,739,629.70	0.03%
80	000039	中集集团	177,179	4,585,392.52	0.03%
81	601999	出版传媒	203,277	4,114,326.48	0.02%
82	601808	中海油服	94,400	3,241,696.00	0.02%
83	002183	怡亚通	41,376	3,225,259.20	0.02%
84	000538	云南白药	90,100	3,124,668.00	0.02%
85	002194	武汉凡谷	33,001	1,713,081.91	0.01%
86	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.01%
87	002182	云海金属	32,956	920,461.08	0.01%
88	002187	广百股份	19,759	849,439.41	0.01%
89	002185	华天科技	33,697	722,463.68	0.00%
90	002177	御银股份	10,305	700,740.00	0.00%
91	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.00%
92	002169	智光电气	12,271	373,651.95	0.00%
93	002181	粤传媒	12,421	331,392.28	0.00%
94	002201	九鼎新材	10,176	324,309.12	0.00%
95	002178	延华智能	10,994	255,060.80	0.00%
96	002199	东晶电子	9,645	245,947.50	0.00%
97	002196	方正电机	9,880	240,874.40	0.00%
98	002188	新嘉联	11,180	239,922.80	0.00%
99	002195	海隆软件	6,796	223,316.56	0.00%

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% (报告期内基金合同生效的采用期末基金资产净值的 2%) 或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产 净值的比例
1	601398	工商银行	915,045,193.93	39.97%
2	600900	长江电力	891,495,188.93	38.94%
3	601088	中国神华	819,517,065.01	35.80%
4	600030	中信证券	739,672,162.03	32.31%
5	600309	烟台万华	718,091,623.76	31.37%
6	000060	中金岭南	704,882,825.24	30.79%
7	600219	南山铝业	694,559,363.59	30.34%



8	600028	中国石化	644,106,811.04	28.14%
9	601919	中国远洋	641,267,545.40	28.01%
10	600048	保利地产	599,214,658.25	26.18%
11	600036	招商银行	553,074,770.76	24.16%
12	600019	宝钢股份	516,839,340.17	22.58%
13	601628	中国人寿	498,971,659.89	21.80%
14	600269	赣粤高速	458,916,810.84	20.05%
15	601318	中国平安	434,922,220.48	19.00%
16	000039	中集集团	419,883,076.88	18.34%
17	600015	华夏银行	344,753,963.54	15.06%
18	600009	上海机场	335,794,821.07	14.67%
19	000088	盐田港	332,835,379.95	14.54%
20	600649	原水股份	324,563,995.21	14.18%
21	000651	格力电器	316,071,293.03	13.81%
22	600325	华发股份	284,309,811.83	12.42%
23	600026	中海发展	281,201,074.36	12.28%
24	600737	中粮屯河	269,784,273.78	11.78%
25	000538	云南白药	268,634,928.87	11.73%
26	600535	天士力	259,315,306.61	11.33%
27	600001	邯郸钢铁	254,618,550.46	11.12%
28	600271	航天信息	252,711,719.28	11.04%
29	600150	中国船舶	245,413,466.49	10.72%
30	000667	名流置业	219,667,477.34	9.60%
31	600456	宝钛股份	217,496,563.36	9.50%
32	600997	开滦股份	212,362,078.47	9.28%
33	000983	西山煤电	212,236,277.48	9.27%
34	600315	上海家化	207,967,900.82	9.08%
35	600770	综艺股份	206,839,127.61	9.04%
36	600786	东方锅炉	195,220,722.25	8.53%
37	600519	贵州茅台	187,180,043.97	8.18%
38	601166	兴业银行	179,507,052.98	7.84%
39	600050	中国联通	179,249,779.79	7.83%
40	600549	厦门钨业	174,831,940.32	7.64%
41	600508	上海能源	173,965,700.83	7.60%
42	600428	中远航运	167,732,671.38	7.33%
43	600830	大红鹰	164,145,416.50	7.17%
44	601001	大同煤业	161,591,623.09	7.06%
45	000829	天音控股	159,296,698.26	6.96%
46	600529	山东药玻	152,567,948.68	6.66%
47	600475	华光股份	148,244,729.49	6.48%
48	601699	潞安环能	144,940,676.66	6.33%
49	600787	中储股份	141,429,813.94	6.18%
50	000619	海螺型材	138,563,104.62	6.05%
51	000963	华东医药	136,783,918.03	5.98%
52	600750	江中药业	136,463,461.01	5.96%



53	000090	深 天 健	135,080,526.92	5.90%
54	600588	用友软件	134,910,789.59	5.89%
55	600563	法拉电子	131,871,607.90	5.76%
56	002029	七 匹 狼	126,824,932.09	5.54%
57	002022	科华生物	124,278,175.61	5.43%
58	600875	东方电气	118,572,660.00	5.18%
59	600426	华鲁恒升	115,974,093.16	5.07%
60	600132	重庆啤酒	114,358,091.96	5.00%
61	000157	中联重科	110,703,858.61	4.84%
62	600662	强生控股	109,351,202.31	4.78%
63	601988	中国银行	108,821,071.40	4.75%
64	600725	云维股份	108,717,899.73	4.75%
65	000548	湖南投资	107,988,944.25	4.72%
66	000565	渝三峡A	107,906,987.33	4.71%
67	002008	大族激光	107,327,529.82	4.69%
68	600383	金地集团	104,501,170.92	4.56%
69	600138	中青旅	103,770,962.11	4.53%
70	000002	万 科A	101,845,968.87	4.45%
71	600323	南海发展	101,000,322.37	4.41%
72	000978	桂林旅游	99,749,191.75	4.36%
73	002050	三花股份	97,126,099.36	4.24%
74	000617	石油济柴	96,685,331.73	4.22%
75	600738	兰州民百	96,187,418.78	4.20%
76	600125	铁龙物流	95,488,982.08	4.17%
77	600525	长园新材	93,440,853.37	4.08%
78	600389	江山股份	91,997,039.14	4.02%
79	600828	*ST 成商	91,870,548.01	4.01%
80	000608	阳光股份	89,662,747.01	3.92%
81	000422	湖北宜化	89,571,728.70	3.91%
82	600052	*ST 广厦	88,167,533.05	3.85%
83	000922	*ST 阿继	84,573,339.10	3.69%
84	600555	九龙山	84,392,277.38	3.69%
85	600000	浦发银行	82,751,841.47	3.61%
86	600100	同方股份	81,103,377.43	3.54%
87	600327	大厦股份	80,522,282.02	3.52%
88	600967	北方创业	77,224,583.60	3.37%
89	600054	黄山旅游	75,389,156.38	3.29%
90	002009	天奇股份	72,470,871.28	3.17%
91	600713	南京医药	72,058,703.47	3.15%
92	600131	岷江水电	70,396,583.21	3.08%
93	600849	上海医药	66,591,495.64	2.91%
94	600282	南钢股份	64,800,715.65	2.83%
95	000807	云铝股份	64,501,267.85	2.82%
96	600805	悦达投资	63,864,944.20	2.79%
97	002106	莱宝高科	63,334,776.55	2.77%



98	000960	锡业股份	61,898,615.56	2.70%
99	002122	天马股份	61,522,367.63	2.69%
100	002007	华兰生物	56,494,410.58	2.47%
101	600479	千金药业	55,415,725.72	2.42%
102	000581	威孚高科	54,802,474.77	2.39%
103	002102	冠福家用	54,195,312.70	2.37%
104	600497	驰宏锌锗	51,925,182.17	2.27%
105	600305	恒顺醋业	51,834,361.13	2.26%
106	000933	神火股份	51,361,060.93	2.24%
107	600058	五矿发展	50,553,779.25	2.21%
108	600075	新疆天业	48,847,710.05	2.13%
109	000690	宝新能源	48,282,196.30	2.11%
110	601006	大秦铁路	47,213,023.36	2.06%
111	600536	中国软件	46,961,272.31	2.05%
112	000028	一致药业	46,763,326.40	2.04%
113	000997	新大陆	46,712,131.68	2.04%
114	600280	南京中商	46,007,436.43	2.01%
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产 净值的比例
1	000039	中集集团	854,621,041.02	37.33%
2	600219	南山铝业	833,670,669.57	36.42%
3	601398	工商银行	816,050,304.66	35.65%
4	600028	中国石化	788,842,871.46	34.46%
5	000060	中金岭南	699,335,154.58	30.55%
6	600019	宝钢股份	688,305,823.54	30.07%
7	600428	中远航运	651,080,778.27	28.44%
8	601628	中国人寿	602,651,719.51	26.33%
9	600048	保利地产	577,749,038.03	25.24%
10	600009	上海机场	569,696,814.00	24.89%
11	600900	长江电力	562,692,797.93	24.58%
12	600015	华夏银行	416,708,219.50	18.20%
13	000088	盐田港	373,559,527.13	16.32%
14	000983	西山煤电	367,415,555.85	16.05%
15	601318	中国平安	347,553,320.46	15.18%
16	601699	潞安环能	338,593,226.25	14.79%
17	600456	宝钛股份	313,266,139.31	13.68%
18	600150	中国船舶	309,146,555.56	13.50%
19	601166	兴业银行	306,726,378.07	13.40%
20	000538	云南白药	304,661,893.97	13.31%
21	600997	开滦股份	292,052,035.54	12.76%
22	000619	海螺型材	273,535,005.62	11.95%
23	600508	上海能源	272,768,360.94	11.92%
24	600497	驰宏锌锗	272,073,559.94	11.88%
25	000548	湖南投资	270,827,946.95	11.83%
26	600269	赣粤高速	270,064,968.09	11.80%



27	600787	中储股份	265,411,761.18	11.59%
28	600475	华光股份	249,487,726.63	10.90%
29	600271	航天信息	242,958,767.12	10.61%
30	600050	中国联通	242,232,046.94	10.58%
31	600030	中信证券	221,073,434.64	9.66%
32	600875	东方电气	209,099,475.96	9.13%
33	000829	天音控股	208,459,162.27	9.11%
34	600309	烟台万华	188,878,103.93	8.25%
35	600001	邯郸钢铁	181,647,174.89	7.93%
36	600125	铁龙物流	177,300,622.27	7.74%
37	601001	大同煤业	159,901,419.21	6.98%
38	600662	强生控股	153,648,731.39	6.71%
39	600529	山东药玻	149,152,074.98	6.52%
40	000157	中联重科	149,033,331.30	6.51%
41	000090	深天健	138,432,992.13	6.05%
42	000002	万科A	137,421,206.09	6.00%
43	600786	东方锅炉	134,599,445.48	5.88%
44	600026	中海发展	133,272,595.50	5.82%
45	000651	格力电器	133,100,913.65	5.81%
46	600383	金地集团	123,639,158.47	5.40%
47	600426	华鲁恒升	117,670,184.99	5.14%
48	601988	中国银行	117,247,261.23	5.12%
49	600100	同方股份	105,966,231.09	4.63%
50	600131	岷江水电	105,175,021.52	4.59%
51	600737	中粮屯河	102,413,777.03	4.47%
52	000422	湖北宜化	100,452,902.55	4.39%
53	600725	云维股份	96,499,809.33	4.22%
54	600535	天士力	93,981,488.48	4.11%
55	600132	重庆啤酒	89,068,125.63	3.89%
56	000922	*ST 阿继	87,882,413.59	3.84%
57	600000	浦发银行	87,565,911.54	3.83%
58	000022	深赤湾A	85,721,073.79	3.74%
59	600325	华发股份	79,913,420.65	3.49%
60	000807	云铝股份	77,850,264.46	3.40%
61	000778	新兴铸管	77,060,310.50	3.37%
62	000960	锡业股份	75,717,488.97	3.31%
63	000963	华东医药	69,632,353.70	3.04%
64	002009	天奇股份	69,396,362.31	3.03%
65	002050	三花股份	66,171,909.69	2.89%
66	600059	古越龙山	66,124,984.67	2.89%
67	600327	大厦股份	64,921,648.21	2.84%
68	002007	华兰生物	64,819,531.24	2.83%
69	002018	华星化工	64,418,711.66	2.81%
70	600849	上海医药	63,813,638.09	2.79%
71	600410	华胜天成	61,867,383.12	2.70%



72	600058	五矿发展	60,687,020.06	2.65%
73	002106	莱宝高科	60,416,738.72	2.64%
74	600805	悦达投资	57,645,125.25	2.52%
75	600305	恒顺醋业	56,393,334.60	2.46%
76	600887	伊利股份	56,359,426.16	2.46%
77	600268	国电南自	56,212,467.20	2.46%
78	000978	桂林旅游	53,636,670.06	2.34%
79	002056	横店东磁	53,574,112.54	2.34%
80	000690	宝新能源	53,316,509.86	2.33%
81	601006	大秦铁路	53,187,557.21	2.32%
82	000402	金融街	52,574,364.14	2.30%
83	600280	南京中商	52,549,970.51	2.30%
84	000581	威孚高科	51,275,258.05	2.24%
85	600379	宝光股份	49,671,253.82	2.17%
86	000530	大冷股份	47,897,825.57	2.09%
87	000933	神火股份	47,161,489.64	2.06%

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：	23,953,706,294.08 元
卖出股票的收入总额：	20,065,120,130.01 元

(五)、报告期末债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	279,070,000.00	1.68%
2	金融债券	79,968,000.00	0.48%
3	企业债券	0.00	0.00%
4	央行票据	511,820,000.00	3.08%
5	可转换债券	0.00	0.00%
	合计	870,858,000.00	5.23%

(六)、报告期末前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	0701139	07 央票 139	1,500,000	144,180,000.00	0.87%
2	070009	07 国债 09	1,000,000	99,590,000.00	0.60%
3	0701006	07 央票 06	1,000,000	97,280,000.00	0.58%
4	0701087	07 央票 87	1,000,000	96,530,000.00	0.58%
5	070402	07 农发 02	800,000	79,968,000.00	0.48%

(七)、报告期末权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	市值(元)	占资产净值比例
-	-	-	-	-	-

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日（或最近交易日）的市场收盘价计算，已发行未上市股票采用成本价计算，未上市交易的权证投资（包括配股权证）按公允价值估值。

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深交所交易结算保证金	4,983,574.06
2	上海权证担保金	-
3	深圳权证担保金	-
4	应收证券清算款	7,504,572.29
5	应收股利	-
6	应收利息	12,699,620.13
7	应收基金申购款	91,788,017.10
	合计	116,975,783.58

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
-	-	-	-	-	-

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额(元)	获得途径
1	580003	邯钢 JTB1	9,990,000.00	31,618,042.95	主动投资
2	580005	万华 HXB1	500,000.00	16,244,095.23	主动投资
3	030002	五粮 YGC1	9,899,647.00	249,976,358.10	主动投资



4	580010	马钢 CWB1	2,800,000.00	15,585,898.37	主动投资
5	038010	赤湾 NSP1	1,454,545	0.00	股权分置改革被动持有
6	580009	伊利 CWB1	611,936.00	15,131,639.74	主动投资

九、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	221,561	
平均每户持有基金份额	23,637.39	
机构投资者持有的基金份额	1,727,773,442.30	32.99%
个人投资者持有的基金份额	3,509,350,693.70	67.01%

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	2,387,248.13	0.05%

十、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	1,684,224,358.17
期初基金份额总额	1,637,980,896.86
加：本期申购基金份额总额	9,626,863,694.96
其中：红利再投资份额总额	380,131,583.34
减：本期赎回基金份额总额	6,027,720,455.82
期末基金份额总额	5,237,124,136.00

十一、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). 2007 年 3 月 22 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经华安基金管理有限公司股东会议决议，同意张军先生因个人原因辞去本公司董事职务。

(2). 2007 年 5 月 11 日，本基金管理人发布关于高管人员变动的公告，经华安基金管理有限公司董事会审议通过，同意姚毓林先生由于个人原因辞去华安基金管理有限公司副总经理职务。

(3). 2007 年 7 月 26 日，本基金管理人发布关于聘任总经理、副总经理的公告，经华安基金管理有限公司第三届董事会审议通过，决定聘请俞妙根先生担任公司总经理职务，聘请韩勇先生担任副总经理职务。

(4). 2007 年 3 月 14 日, 本基金管理人发布关于基金经理调整的公告, 增聘陈俏宇女士为华安宏利股票型证券投资基金的基金经理, 尚志民先生仍继续担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。

(5). 2008 年 2 月 13 日, 本基金管理人发布关于基金经理调整的公告, 陈俏宇女士不再担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理, 聘任汪光成先生为华安宏利股票型证券投资基金的基金经理, 尚志民先生仍任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下: 无。

(三)、 本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)、 基金投资策略的改变: 无。

(五)、 基金收益分配事项:

	公告日期	权益登记日、除息日	红利划出日、红利再投资日	每10份基金份额收益分配金额
本年内第1次分红	2007-1-8	2007-1-15	2007-1-16	0.80 元
本年内第2次分红	2007-7-30	2007-8-7	2007-8-8	3.10 元

(六)、 基金改聘为其审计的会计师事务所情况: 本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况如下: 120,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限: 自基金合同生效日起至今。

(七)、 基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形: 无。

(八)、 本报告期间租用证券公司交易单元情况如下:

1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

新增交易

单元:

	券商名称	交易单元所在地
1	中信证券股份有限公司	上交所交易单元

2. 交易成交量及佣金情况:

(1). 股票交易情况:

券商名称	租用交易单元数量	成交量 (元)	占总成交量比例	佣金 (元)	占总佣金比例
兴业证券股份有限公司	1	2,750,687,923.77	6.28%	2,255,512.23	6.35%
国泰君安证券股份有限公司	1	2,333,411,639.33	5.32%	1,825,911.09	5.14%
申银万国股份有限公司	1	8,568,218,721.58	19.55%	6,704,683.96	18.87%
招商证券股份有限公司	1	8,867,796,485.09	20.23%	7,270,195.26	20.47%
长江证券股份有限公司	1	3,511,330,192.13	8.01%	2,878,921.96	8.10%
中信建投证券有限责任公司	1	7,037,732,855.27	16.06%	5,768,855.17	16.24%

中信证券股份有限公司	1	10,757,600,404.32	24.55%	8,820,442.85	24.83%
合 计	7	43,826,778,221.49	100.00%	35,524,522.52	100.00%

(2). 债券、回购及权证交易情况:

券商名称	债券成交量 (元)	占总成交 总量比例	回购成交量 (元)	占总成交 总量比例	权证成交量 (元)	占总成交 总量比例
兴业证券股份有限公司	0.00	0.00%	9,600,000.00	1.30%	31,615,592.65	4.62%
国泰君安证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	48,078,505.12	7.03%
申银万国股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	494,925,755.23	72.36%
招商证券股份有限公司	75,939,015.70	28.17%	300,000,000.00	40.69%	2,617,980.56	0.38%
长江证券股份有限公司	0.00	0.00%	73,000,000.00	9.90%	43,287,387.33	6.33%
中信建投证券有限责任公司	109,706,344.00	40.70%	189,600,000.00	25.72%	32,198,548.40	4.71%
中信证券股份有限公司	83,914,724.70	31.13%	165,000,000.00	22.38%	31,211,763.79	4.56%
合 计	269,560,084.40	100.00%	737,200,000.00	100.00%	683,935,533.08	100.00%

3. 券商专用交易单元选择标准:

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

- (1) 资历雄厚, 信誉良好;
- (2) 财务状况良好, 经营行为规范;
- (3) 内部管理规范、严格, 具备健全的内控制度, 并能满足基金运作高度保密的要求;
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要, 并能为本基金提供全面的信息服务;
- (5) 证券研究或市场研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面研究报告及周到的信息服务, 并能根据基金投资的特定要求, 提供专题研究报告。

4. 券商专用交易单元选择程序:

- (1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估
由研究发展部等部门组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》, 对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部等部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果, 择优选出拟新增交易单元, 填写《新增交易单元申请审核表》, 对拟新增交易单元的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审批

公司分管副总对研究发展部等部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核, 并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易交易单元使用协议》, 并通知基金托管人。

(九)、其他事项:

1. 基金分红事项:

	公告事项	披露日期
1	关于华安宏利股票型证券投资基金第一次分红公告, 按每 10 份基金份额派发现金红利 0.80 元。	[2007-01-08]
2	关于华安宏利股票型证券投资基金第二次分红公告, 按每 10 份基金份额派发现金红利 3.10 元。	[2007-07-30]

2. 变更基金份额发售机构:

	公告事项	披露日期
1	关于华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金在中信建投证券有限责任公司开展网上申购费率优惠活动的公告	[2007-01-19]
2	关于新增渤海证券有限责任公司为华安宏利股票型证券投资基金代销机构的公告	[2007-03-16]
3	关于新增中信金通证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-04-06]
4	关于新增中信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-04-12]
5	关于增加中国农业银行金穗卡持有人办理基金网上交易业务的公告	[2007-06-08]
6	关于新增德邦证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-08-01]
7	关于新增上海银行为华安宏利股票型证券投资基金代销机构以及开通定期定额申购业务的公告	[2007-08-07]
8	关于新增东方证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-08-10]
9	关于开通中国建设银行股份有限公司代销旗下六只开放式基金定期定额申购业务的公告	[2007-08-10]
10	关于新增招商银行股份有限公司代销华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金的公告	[2007-08-24]
11	关于增加中国光大银行为开放式基金代销机构的公告	[2007-08-28]
12	关于新增深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告	[2007-09-19]
13	关于华安基金管理有限公司在深圳发展银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告	[2007-09-19]
14	关于参加交通银行基金定期定额申购优惠活动的公告	[2007-09-28]
15	关于新增财富证券有限责任公司为华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金和华安策略优选股票型证券投资基金代销机构的公告	[2007-10-17]
16	关于新增长江证券有限责任公司为华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现	[2007-10-19]

- 金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金代销机构的公告
- 17 关于新增上海证券有限责任公司为华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-19]
 - 18 关于新增北京银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-10-25]
 - 19 关于新增中信银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-11-06]
 - 20 关于新增国都证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-11-08]
 - 21 关于新增宏源证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-11-08]
 - 22 关于在中国工商银行股份有限公司开通华安宏利股票型证券投资基金、华安创新证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金定期定额投资计划的公告 [2008-01-14]
 - 23 关于增加旗下三只基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告 [2008-01-14]
 - 24 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]
 - 25 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]
 - 26 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]
 - 27 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]
 - 28 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]
 - 29 关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告 [2008-02-25]
 - 30 华安基金管理有限公司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 [2008-03-12]
 - 31 华安基金管理有限公司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 [2008-03-21]
 - 32 华安基金管理有限公司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]
 - 33 华安基金管理有限公司关于新增深圳平安银行为开放式基金代销机构的公告 [2008-03-24]
 - 34 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海银行基金定期定额申购业务优惠推广活动的公告 [2008-03-24]

3. 股权变动:

- 1 经华安基金管理有限公司股东会会议审议通过，并经中国证监会审核批准（证监基金字[2007]282 号），本公司原股东上海广电（集团）有限公司将其持有的本公司 20% 股权全部转让给上海锦江国际投资管理有限公司。上述股权转让 [2007-11-20]

- 让事宜的工商变更登记手续已办理完毕。
- 2 接我司股东单位上海国际信托投资有限公司通知，经中国银行业监督管理委员会批准，“上海国际信托投资有限公司”已更名为“上海国际信托有限公司”。目前，我司股东更名事项已经完成工商变更登记。 [2007-11-20]
4. 基金合同修改：
- 1 关于修改旗下基金基金合同的公告，本基金的申购费用及申购份额的计算条款修改为：“本基金采用“外扣法”计算申购费用及申购份额，具体计算公式如下： [2007-05-11]
- $$\text{净申购金额} = \text{申购金额} / (1 + \text{申购费率})$$
- $$\text{申购费用} = \text{申购金额} - \text{净申购金额}$$
- $$\text{申购份额} = \text{净申购金额} / \text{T 日基金份额净值}$$
- 2 关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告，自 2007 年 5 月 15 日起，本基金的申购费用及申购份额统一调整为“外扣法”计算。 [2007-05-11]
- 3 关于调整华安基金管理有限公司旗下基金基金转换计算方法的公告，自 2007 年 6 月 1 日起，，我公司旗下华安创新证券投资基金（简称“华安创新”，基金代码 040001），华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金（简称“华安中国 A 股”，基金代码 040002）、华安宝利配置证券投资基金（简称“华安宝利”，基金代码 040004）和华安宏利股票型证券投资基金（简称“华安宏利”，基金代码 040005）之间及其与我公司旗下华安现金富利投资基金（简称“华安富利”，基金代码 040003）之间的基金转换费用中涉及的申购补差费计算将根据各基金不同的申购费率或固定费用统一调整为“外扣法”计算。 [2007-05-29]
- 4 关于证券投资基金实施新的会计准则的公告，根据中国证监会的相关规定，我公司管理的所有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后，基金将全面采用公允价值进行会计计量，请投资者关注相关法规的规定。 [2007-07-02]
- 实施新会计准则后，基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。
- 5 关于修改华安宏利股票型证券投资基金的基金合同和托管协议的公告，根据中国证监会《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》（证监会计字[2006]23 号），证券投资基金自 2007 年 7 月 1 日起执行新会计准则。为了维护投资者利益，经与华安宏利股票型证券投资基金的托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并经向中国证监会备案，根据相关法律法规的规定及基金合同的约定，对华安宏利基金的基金合同中的基金资产估值的条款和基金收益构成的条款进行修改。 [2007-09-29]

5. 公司固有资金申购基金：



- 1 关于运用固有资金进行开放式基金投资的公告, 于 2007 年 11 月 22 日通过申银万国证券股份有限公司申购华安宏利股票型证券投资基金(基金代码 040005) 1400 万元。 [2007-11-20]
- 2 关于运用固有资金进行开放式基金投资的公告, 从 2007 年 12 月 13 日开始, 通过申银万国证券股份有限公司申购华安宏利股票型证券投资基金(基金代码 040005) 3400 万元。 [2007-12-11]

6. 其他公告:

- 1 关于总机变更的公告, 华安基金管理有限公司的电话总机自 2007 年 5 月 28 日起由 (021) 58881111 变更为 (021) 38969999。 [2007-05-25]

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》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

6、本基金托管人于2007年9月25日在上海证券交易所上市及开始交易, 股票代码为601939。



十二、备查文件目录

- 1、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宏利股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宏利股票型证券投资基金设立的文件；
- 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 3 月 27 日