



# 华安中小盘成长股票型证券投资基金 2007 年年度报告摘要 (原安瑞证券投资基金转型)

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

签发日期：二〇〇八年三月二十七日

## 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2008 年 3 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

2007 年 3 月 1 日,华安中小盘成长股票型证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过,并于 2007 年 3 月 23 日获中国证监会《关于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》(证监基金字[2007]81 号)核准。自 2007 年 4 月 10 日起,安瑞证券投资基金在上海证券交易所终止上市,由《安瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。

本报告会计期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 12 月 31 日止。自 2007 年 4 月 10 日安瑞证券投资基金终止上市之日起,原安瑞证券投资基金基金名称变更为华安中小盘成长股票型证券投资基金。原安瑞证券投资基金报告期自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止,华安中小盘成长股票型证券投资基金报告期自 2007 年 4 月 10 日起至 2007 年 12 月 31 日止。

本年度财务报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

## 二、基金产品概况

### (一)、基金概况

#### 1. 华安成长基金概况

|          |                  |
|----------|------------------|
| 基金名称:    | 华安中小盘成长股票型证券投资基金 |
| 基金简称:    | 华安成长             |
| 交易代码:    | 040007           |
| 深交所行情代码: | 160407           |
| 基金运作方式:  | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日: | 2007 年 4 月 10 日  |

期末基金份额总额: 12,327,960,308.94 份  
基金存续期: 不定期

## 2. 基金安瑞基金概况

基金名称: 安瑞证券投资基金  
基金简称: 基金安瑞  
交易代码: 500013  
基金运作方式: 契约型封闭式  
基金合同生效日: 本基金由金龙基金、沈阳万利基金、沈阳富民基金清理规范后合并而成。  
2000 年 7 月 18 日华安基金管理有限公司开始管理基金安瑞。  
期末基金份额总额: 5 亿份  
基金存续期: 15 年(1992 年 4 月 29 日至 2007 年 4 月 9 日)  
基金上市地点: 上海证券交易所  
基金上市日期: 2001 年 8 月 30 日

## (二)、基金的投资

### 1. 华安成长基金的投资

投资目标: 主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票,在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的持续增值。  
投资策略: 主要依靠基金管理人的研究优势,将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中,在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上,积极把握备选股票的投资机会,为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。  
业绩比较基准:  $40\% \times \text{天相中盘成长指数} + 40\% \times \text{天相小盘成长指数} + 20\% \times \text{中债-国债总指数}$   
风险收益特征: 本基金是积极成长型股票基金,属于证券投资基金中的较高风险和较高预期收益品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

### 2. 基金安瑞基金的投资

投资目标: 本基金投资于小型上市公司,即公司市值低于市场平均市值的上市公司。投资目标是发掘小型上市公司中的投资机会,通过积极的投资策略,获取长期的资本增值。  
投资策略: 本基金为小市值基金,本基金的主要投资方向是小型上市公司,指投资时上市公司的总市值或流通市值低于市场平均水平。本基金的证券资产将

不低于基金资产总额的 80%，其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的 20-50%，股票资产的比例控制在 40-80%，现金比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，70%投资于合同规定的小市值股票，30%投资于包括新股在内的其他上市公司股票，在此基础上各自上下浮动 10%。当投资的股票市值因价格上涨等因素高于市场平均水平的 50%时，将作为非小市值股票进行统计。

业绩比较基准：无  
风险收益特征：无

### (三)、 基金管理人

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

### (四)、 基金托管人

基金托管人：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号  
邮政编码：100032  
法定代表人：姜建清  
信息披露负责人：蒋松云  
联系电话：010-66106912  
传真：010-66106904  
电子邮箱：custody@icbc.com.cn

### (五)、 信息披露

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

## (六)、 其他有关资料

### 1. 华安成长其他有关资料

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

### 2. 基金安瑞其他有关资料

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：中国证券登记结算有限责任公司上海分公司  
办公地点：上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

## 三、 主要财务指标和基金净值表现

### (一)、 主要财务指标

#### 1. 华安成长主要财务指标

| 财务指标                 | 2007 年（2007 年 4 月 10 日<br>至 2007 年 12 月 31 日止期间） |
|----------------------|--------------------------------------------------|
| 本期利润                 | 8,460,937,860.00                                 |
| 本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额 | 5,298,188,043.69                                 |
| 加权平均份额本期利润           | 0.6144                                           |
| 期末可供分配利润             | 8,039,203,513.18                                 |
| 期末可供分配份额利润           | 0.6521                                           |
| 期末基金资产净值             | 19,544,161,732.53                                |
| 期末基金份额净值             | 1.5854                                           |
| 加权平均净值利润率            | 45.58%                                           |
| 本月份净值增长率             | 73.04%                                           |
| 份额累计净值增长率            | 73.04%                                           |

提示：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。

注：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. 基金安瑞主要财务指标

| 财务指标      | 2007 年（2007 年 1 月<br>1 日至 2007 年 4 月 9 日<br>止期间） | 2006 年         | 2005 年         |
|-----------|--------------------------------------------------|----------------|----------------|
| 基金本期净收益   | 323,359,919.38                                   | 251,156,864.32 | -10,507,404.86 |
| 基金份额本期净收益 | 0.6467                                           | 0.5023         | -0.0210        |

|              |                  |                |                |
|--------------|------------------|----------------|----------------|
| 期末可供分配基金收益   | 325,228,312.58   | 196,868,393.20 | -54,288,471.12 |
| 期末可供分配基金份额收益 | 0.6505           | 0.3937         | -0.1086        |
| 期末基金资产净值     | 1,060,436,162.37 | 880,751,434.24 | 463,476,899.59 |
| 期末基金份额净值     | 2.1209           | 1.7615         | 0.9270         |
| 基金加权平均净值收益率  | 32.83%           | 39.22%         | -2.39%         |
| 本期基金份额净值增长率  | 43.64%           | 90.02%         | 2.36%          |
| 基金份额累计净值增长率  | 194.85%          | 105.27%        | 8.02%          |

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

## （二）、 净值表现

### 1. 华安成长净值表现

#### A、历史各时间段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<br>增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①-③    | ②-④    |
|----------------|----------------|---------------|--------------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -0.40%         | 1.72%         | -2.85%             | 1.52%                 | 2.45%  | 0.20%  |
| 过去六个月          | 38.22%         | 1.76%         | 29.77%             | 1.60%                 | 8.45%  | 0.16%  |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 73.04%         | 1.77%         | 52.40%             | 1.84%                 | 20.64% | -0.07% |

#### B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

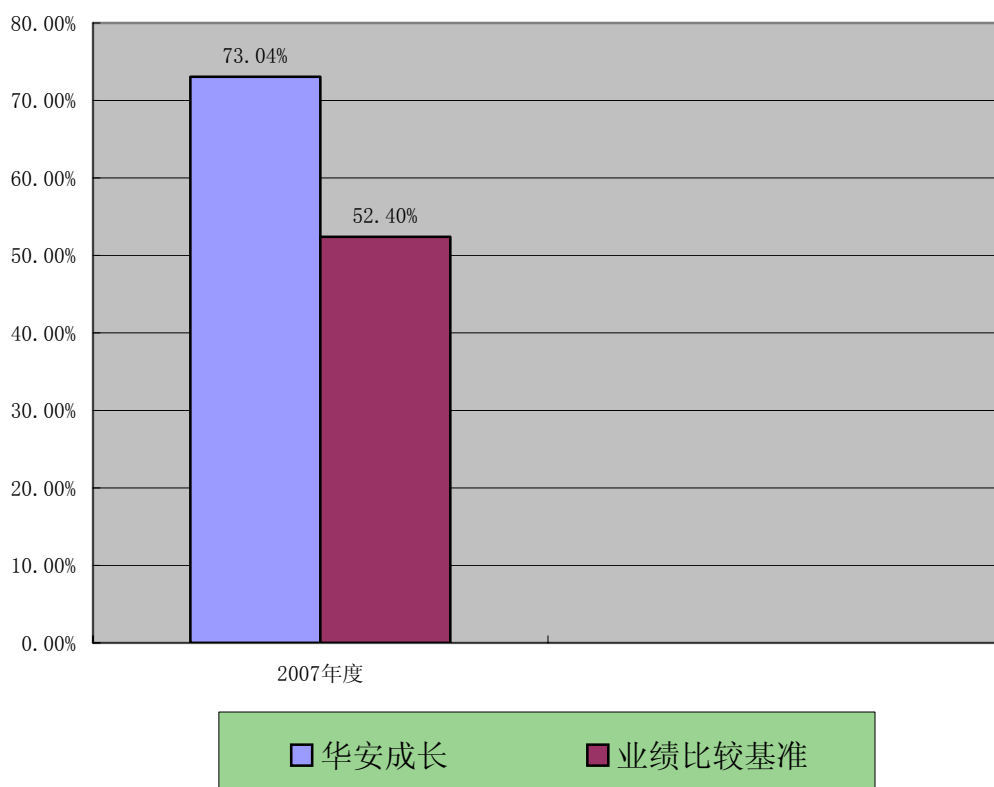
#### 基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华安成长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  
2007/4/10---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



## 2. 基金安瑞净值表现

### A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

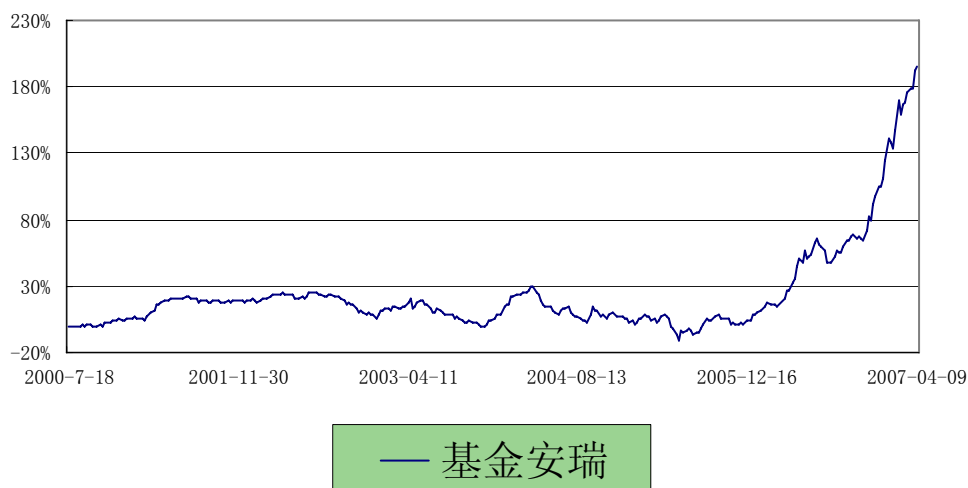
| 阶段                                | 净值<br>增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较<br>基准收益<br>率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-----------------------------------|----------------|---------------|--------------------|-----------------------|-----|-----|
| 2007 年 4 月 1 日至<br>2007 年 4 月 9 日 | 5.89%          | 2.72%         | -                  | -                     | -   | -   |
| 2007 年 1 月 1 日至<br>2007 年 4 月 9 日 | 43.64%         | 3.77%         | -                  | -                     | -   | -   |
| 2006 年 7 月 1 日至<br>2007 年 4 月 9 日 | 81.08%         | 3.19%         | -                  | -                     | -   | -   |
| 2004 年 7 月 1 日至<br>2007 年 4 月 9 日 | 165.14%        | 2.86%         | -                  | -                     | -   | -   |
| 2002 年 7 月 1 日至<br>2007 年 4 月 9 日 | 136.43%        | 2.51%         | -                  | -                     | -   | -   |
| 自基金合同生效起<br>至 2007 年 4 月 9 日      | 194.85%        | 2.17%         | -                  | -                     | -   | -   |

备注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

## B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

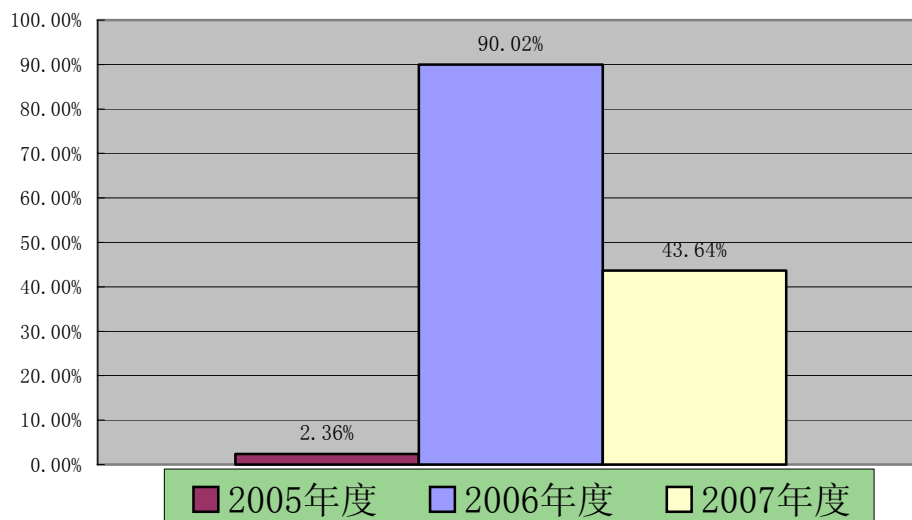
### 基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

基金安瑞份额累计净值增长率历史走势图  
2000/7/18--2007/4/9



## 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



### (三)、 过往三年基金收益分配情况

| 年度                                             | 每 10 份基金份额<br>分红数 (元) | 备注 |
|------------------------------------------------|-----------------------|----|
| 2007 年 转型后 (2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日) | 0.00                  |    |
| 2007 年 转型前 (2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日)    | 3.90                  |    |
| 2006 年                                         | 0.00                  |    |
| 2005 年                                         | 0.00                  |    |
| 合计                                             | 3.90                  |    |

## 四、 管理人报告

### (一)、 基金管理人及基金经理简介

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

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

刘光华 先生：MBA，10 年银行、基金从业经历。曾在农业银行上海分行国际部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 年加入华安基金管理公司，曾任研究部高级研究员，2006 年 4 月至 2007 年 3 月担任上证 180ETF 基金经理，2005 年 5 月至今担任华安 MSCI 中国 A 股指数基金经理，2007 年 3 月至今担任华安中小盘成长（原安瑞证券投资基金）基金经理。

## （二）、 基金运作合规性声明

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

## （三）、 基金经理工作报告

### （1） 行情回顾

07 年，我国的 A 股市场延续了 06 年的大牛市，出现了更大幅度的上涨。其中沪深 300 指数的全年涨幅为 161.55%，同期天相中盘成长指数上涨 165.94%，天相小盘成长指数上涨 209.88%。

07 年，实体经济保持较快的增长速度。GDP 同比增长 11.4%，为连续第五年出现二位数的增长。在经济保持高速增长的同时，07 年与过去几年不同的是，物价涨幅较大。全年 CPI 上涨 4.8%，且临近年末的月度数据更是加剧了市场对宏观调控的担忧。

07 年的前 10 个月，虽然经历了 5.30 的短暂调整，基本上是呈现单边上扬的，上证综指更是在 10 月份创下了 6124 点的历史新高。我们认为，07 年市场超预期的涨幅，主要是由于三方面的因素。

其一，上市公司盈利超预期增长。根据统计，07 年的一季报、中报、三季报，可比上市公司同比的净利润增幅，均出现了超市场预期增长。除了内生性的增长外，资产注入、整体上市、及股市上涨所带来的投资收益等，都对最终的盈利增长作出了贡献。

其二，基金规模的快速发展，为股市提供了现实的流动性。06 年基金总体的良好表现、及在负利率背景下居民理财意愿的加强，使得大量的资金通过基金进入股票市场。截止 07 年末，基金净值超过 100 亿元的开放式基金达 109 只，最大的接近 500 亿元；而 06 年底，净值过百亿的开放式基金只有 12 只。

其三，在牛市的氛围下，部分行业的估值出现了显著的提升。煤炭是最典型的例子，在 07 年，煤炭行业的估值与历史上比，有数倍的变化。这当中，既隐含了投资者对资产注入的预期，也与产品价格持续上涨有关。

## （2）操作回顾

本基金在 07 年的运作分为两个阶段。自 1 月 1 日至 4 月 9 日，封转开之前的安瑞基金净值增长了 43.64%，期间实施了一次分红，每份额分配 0.39 元。这段期间，安瑞基金的净值涨幅，在全部封闭式基金中排第二名。

4 月 10 日，安瑞基金退市，华安中小盘成长基金成立。4 月 16 日，本基金实施集中申购。4 月 18 日，为原安瑞基金持有人的份额折算日，折算后基金的单位净值为 1 元。自 4 月 10 日至 4 月 18 日，华安成长的净值增长了 9.15%。4 月 19 日开始，集中申购的资金与原安瑞转型而来的资金合并运作。截止 12 月底，本基金的单位净值为 1.5854 元。自 4 月 10 日至 12 月底，华安成长基金的净值增长率为 73.04%，同期比较基准增长了 52.40%。07 年全年，本基金两个阶段的复合净值增长率为 148.56%。

从安瑞基金到华安中小盘成长基金，是一次成功的转型。封转开之后，根据新的基金合同的要求，我们结合市场的实际，在风格上以中盘成长股作为本基金投资的重点。

在行业配置上，本基金按照 GICS 的二级行业分类，基本采取均衡配置的策略。而在行业内部，则以自下而上的选股方法，精选个股，集中投资。

## （3）展望

进入 08 年，在次贷风波的影响下，以美国为代表的全球资本市场出现了较大的波动，A 股也未能例外。

我们相信，在全球一体化的背景下，美国经济逐步走入衰退，必将对包括中国在内的其他经济体产生影响。当然，中国作为正在崛起的大国经济，自身的调节机制也比较强。

从宏观的角度，虽然面临 CPI 上涨较快、环保和资源的压力增大等不利因素，但是，基于中国在全球的竞争力，我们对实体经济仍然充满信心。

经历了 06、07 年的大幅上涨后，A 股投资者必须面对的现实是，上市公司的业绩增长能否跟上估值提升后对隐含成长性的要求。同时，在 08 年，一个新的因素是，限售股的解禁理论上将大幅增加市场的供给。

华安中小盘成长基金在 08 年，将继续以中盘成长股为投资的重点。在选股时，兼顾当前估值和未来的成长性。08 年之初，市场出现了较大的波动，我们认为，这样的环境也给基金经理选股提供了机会。我们希望，通过发挥基金管理人强大投研团队的优势，坚持自下而上选股，为持有人提供长期的投资回报。

#### (四)、 内部监察报告

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

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

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

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

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

(4) 进一步完善投资交易系统控制功能，防范合规风险，提高合规监察效率；

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

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

#### 五、 托管人报告

2007 年，本托管人在对华安中小盘成长股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2007 年，华安中小盘成长股票型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安中小盘成长股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在所有重要方面的运作严格按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在 2007 年所编制和披露的华安中小盘成长股票型证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部  
2008 年 3 月 18 日

## 六、 审计报告

### (一)、 华安成长审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师薛竞、金毅签字出具了普华永道中天审字(2008)第 20246 号标准无保留意见的审计报告。

### (二)、 基金安瑞审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师薛竞、金毅签字出具了普华永道中天审字(2008)第 20245 号标准无保留意见的审计报告。

## 七、 华安成长财务会计报告

### (一)、 资产负债表

二零零七年十二月三十一日

单位: 人民币元

| 项 目        | 附注 | 2007年12月31日           |
|------------|----|-----------------------|
| <b>资产:</b> |    |                       |
| 银行存款       |    | 1, 303, 315, 527. 90  |
| 结算备付金      |    | 6, 756, 437. 83       |
| 存出保证金      |    | 8, 449, 269. 92       |
| 交易性金融资产    |    | 18, 248, 140, 141. 47 |
| 其中: 股票投资   |    | 17, 449, 162, 141. 47 |
| 债券投资       |    | 798, 978, 000. 00     |
| 资产支持证券投资   |    | 0. 00                 |
| 衍生金融资产     |    | 0. 00                 |
| 买入返售金融资产   |    | 0. 00                 |
| 应收证券清算款    |    | 43, 186, 567. 31      |
| 应收利息       |    | 18, 444, 852. 55      |
| 应收股利       |    | 0. 00                 |
| 应收申购款      |    | 104, 455, 187. 34     |
| 其他资产       |    | 0. 00                 |
| 资产合计       |    | 19, 732, 747, 984. 32 |
| <b>负债:</b> |    |                       |

|           |                |
|-----------|----------------|
| 短期借款      | 0.00           |
| 交易性金融负债   | 0.00           |
| 衍生金融负债    | 0.00           |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00           |
| 应付证券清算款   | 32,195,154.79  |
| 应付赎回款     | 107,753,873.59 |
| 应付管理人报酬   | 23,394,519.40  |
| 应付托管费     | 3,899,086.55   |
| 应付销售服务费   | 0.00           |
| 应付交易费用    | 20,117,512.67  |
| 应交税费      | 0.00           |
| 应付利息      | 0.00           |
| 应付利润      | 0.00           |
| 其他负债      | 1,226,104.79   |
| 负债合计      | 188,586,251.79 |

**所有者权益：**

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 实收基金       | 5,325,438,362.03  |
| 未分配利润      | 14,218,723,370.50 |
| 所有者权益合计    | 19,544,161,732.53 |
| 负债和所有者权益总计 | 19,732,747,984.32 |
| 基金份额总额(份)  | 12,327,960,308.94 |
| 基金份额净值     | 1.5854            |

所附附注为本会计报表的组成部分

**(二)、 利润表**

自二零零七年四月十日至二零零七年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

| 项 目        | 附注 | 2007年4月10日至<br>2007年12月31日止期间 |
|------------|----|-------------------------------|
| 一、收入       |    |                               |
| 1、利息收入（合计） |    | 32,375,341.14                 |
| 其中：存款利息收入  |    | 21,084,546.19                 |
| 债券利息收入     |    | 11,290,794.95                 |
| 资产支持证券利息收入 |    | 0.00                          |
| 买入返售金融资产收入 |    | 0.00                          |
| 2、投资收益（合计） |    | 5,661,087,497.75              |
| 其中：股票投资收益  |    | 5,446,847,184.68              |
| 债券投资收益     |    | 15,613,473.22                 |
| 资产支持证券投资收益 |    | 0.00                          |
| 衍生工具收益     |    | 107,880,676.48                |
| 股利收益       |    | 90,746,163.37                 |
| 3、公允价值变动收益 |    | 3,162,749,816.31              |

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 4、其他收入        | 14,059,651.61    |
| 收入合计          | 8,870,272,306.81 |
| 二、费用          |                  |
| 1、管理人报酬       | 201,827,878.44   |
| 2、托管费         | 33,637,979.73    |
| 3、销售服务费       | 0.00             |
| 4、交易费用        | 162,361,010.23   |
| 5、利息支出        | 11,197,697.37    |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 11,197,697.37    |
| 6、其他费用        | 309,881.04       |
| 费用合计          | 409,334,446.81   |
| 三、利润总额        | 8,460,937,860.00 |

所附附注为本会计报表的组成部分

### (三)、 所有者权益(基金净值)变动表

自二零零七年四月十日至二零零七年十二月三十一日止期间  
单位：人民币元

| 项目                               | 2007年4月10日至<br>2007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<br>(基金净值)                | 500,000,000.00                | 560,436,162.37    | 1,060,436,162.37   |
| 本年经营活动产生<br>的基金净值变动数<br>(本年净利润)  | 0.00                          | 8,460,937,860.00  | 8,460,937,860.00   |
| 本年基金份额交易<br>产生的基金净值变<br>动数       | 4,825,438,362.03              | 5,197,349,348.13  | 10,022,787,710.16  |
| 其中：基金申购款                         | 8,382,162,439.72              | 12,880,741,723.17 | 21,262,904,162.89  |
| 基金赎回款                            | -3,556,724,077.69             | -7,683,392,375.04 | -11,240,116,452.73 |
| 本年向基金份额持<br>有人分配利润产生<br>的基金净值变动数 | 0.00                          | 0.00              | 0.00               |
| 年末所有者权益<br>(基金净值)                | 5,325,438,362.03              | 14,218,723,370.50 | 19,544,161,732.53  |

所附附注为本会计报表的组成部分

### (四)、 会计报表附注

#### 1. 基金的基本情况

华安中小盘成长股票型证券投资基金是根据原安瑞证券投资基金(以下简称“基金安瑞”)基金份额持有人大会 2007 年 3 月 1 日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中

国证监会”)证监基金字[2007]81 号《于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,由原安瑞证券投资基金转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金,于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市,存续期限至 2007 年 6 月 30 日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字[2007]21 号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》,原基金安瑞于 2007 年 4 月 9 日进行终止上市权利登记,自 2007 年 4 月 10 日起,原基金安瑞终止上市;原基金华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司,基金注册登记人为华安基金管理有限公司。

原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为 1,060,436,162.37 元,已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 4 月 18 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:2.314909165,并于 2007 年 4 月 18 日进行了变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 4 月 16 日开放集中申购,共募集 9,883,484,414.21 元,业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第 11233 号验资报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 4 月 18 日基金份额转换后的基金份额净值 1.000 元折合为 9,883,484,414.21 份基金份额,并于 2007 年 4 月 18 日进行了确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中,股票投资比例为基金资产的 60-95%,股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票;债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%;现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:天相中盘成长指数收益率×40%+天相小盘成长指数收益率×40%+中国债券总指数收益率×20%-国债总指数收益率。

## 2. 基本会计假设

本年度会计报表的编制遵守基本会计假设。

## 3. 主要会计政策、会计估计及其变更

(1) 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

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”)、《华安中小盘成长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,本基金开始执行财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间财务报表为本基金

首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安中小盘成长股票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规定编制的财务报表。

在编制 2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日止期间的财务报表时, 2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)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 2007 年 6 月 30 日的所有者权益以及 2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)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 9。

#### (2) 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日。

#### (3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### (4) 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。

#### (5) 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；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

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

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

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

自 2006 年 11 月 13 日起基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，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；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，以确定公允价值并估值。

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

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

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

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入成交日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从实际取得日起到卖出成交日或行权日止，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，且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，以确定公允价值并估值。

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

(iv) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基金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。

#### (6) 证券投资基金成本计价方法

##### (i) 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。于 2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按成交日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接记入当期损益。

卖出股票于成交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成交日结转。

##### (ii) 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，后于权证实际取得日按附注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。

##### (iii) 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实际取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。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。

(iv) 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。

(v) 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。

(7) 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益/(损失)于卖出股票成交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)于卖出债券成交日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/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

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

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。

(8) 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。

#### (9) 实收基金

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

#### (10) 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)。

#### (11) 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至多四次，基金收益分配比例每次不低于可分配收益的 50%；如当年基金成立未满三个月，则不需分配收益。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金当期可分配收益先弥补以前年度亏损后，方可进行当年收益分配。基金当年亏损，则不进行收益分配。基金收益分配后，基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

(12) 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。

(13) 重大会计差错的内容和更正金额：无。

### 4. 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收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。

## 5. 资产负债表日后事项

无。

## 6. 关联方关系和关联方交易

(1). 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

| 关 联 人                       | 关 系                          | 交易性质           | 法律依据 |
|-----------------------------|------------------------------|----------------|------|
| 华安基金管理有限公司                  | 基金管理人<br>注册登记机构<br>基金销售机构    | 提取管理费<br>持有本基金 | 基金合同 |
| 中国工商银行股份有限公司                | 基金托管人<br>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) | 基金管理人股东                      |                |      |
| 上海电气(集团)总公司                 | 基金管理人股东                      |                |      |
| 上海工业投资(集团)有限公司              | 基金管理人股东                      |                |      |
| 上海沸点投资发展有限公司                | 基金管理人股东                      |                |      |
| 上海锦江国际投资管理有限公司              | 基金管理人股东(2007 年 11 月 20 日起)   |                |      |
| 上海广电(集团)有限公司                | 基金管理人原股东(2007 年 11 月 20 日之前) |                |      |

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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2). 通过关联方交易单元进行的交易

①本报告期(2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止期间)本基金没有通过上述关联方交易单元进行股票、债券、回购和权证交易。

②本报告期(2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止期间)与基金托管人中国工商银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下：

4,567,281,148.12

|            |              |
|------------|--------------|
| 卖出回购证券协议金额 | 6,844,700.93 |
| 卖出回购证券利息支出 |              |

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金在本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止期间）需支付基金管理费 201,827,878.44 元。

② 基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 2.5% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金在本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止期间）需支付基金托管费 33,637,979.73 元。

③ 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计算。基金托管人于 2007 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 1,303,315,527.90 元。本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止期间）由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 20,042,175.70 元。

(4). 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：

本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止期间）基金管理公司投资本基金的情况：

|           | 基金份额(份)       |
|-----------|---------------|
| 2007年4月9日 | 6,318,119.00  |
| 基金拆分增加份额  | 8,307,751.68  |
| 本期买入      | 12,706,627.20 |

|             |               |
|-------------|---------------|
| 实施份额激励减少份额  | 2,592,010.12  |
| 本期卖出        | 0.00          |
| 2007年12月31日 | 24,740,487.76 |

基金管理人华安基金管理有限公司在本会计期间运用自有资金 18,000,000.00 元经代销机构购入本基金 12,706,627.20 份基金份额，申购费 2,000.00 元，适用费率为每笔申购 1,000 元。于 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 0.2%。

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：无。

## 7. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票如下：

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。

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

| 股票代码   | 股票名称 | 成功申购日期   | 可流通日期    | 流通受限类型 | 申购价格  | 期末估值单价 | 数量        | 期末成本总额         | 期末估值总额         |
|--------|------|----------|----------|--------|-------|--------|-----------|----------------|----------------|
| 601088 | 中国神华 | 07/09/27 | 08/01/09 | 新股网下申购 | 36.99 | 65.61  | 1,538,900 | 56,923,911.00  | 100,967,229.00 |
| 601857 | 中国石油 | 07/10/30 | 08/02/05 | 新股网下申购 | 16.70 | 30.96  | 2,507,800 | 41,880,260.00  | 77,641,488.00  |
| 601601 | 中国太保 | 07/12/18 | 08/03/26 | 新股网下申购 | 30.00 | 49.45  | 734,554   | 22,036,620.00  | 36,323,695.30  |
| 600383 | 金地集团 | 07/07/09 | 08/07/04 | 非公开增发  | 26.00 | 33.40  | 776,923   | 20,199,998.00  | 25,949,228.20  |
| 002186 | 全聚德  | 07/11/07 | 08/02/20 | 新股网下申购 | 11.39 | 59.03  | 18,259    | 207,970.01     | 1,077,828.77   |
| 002182 | 云海金属 | 07/11/02 | 08/02/13 | 新股网下申购 | 10.79 | 27.93  | 32,956    | 355,595.24     | 920,461.08     |
| 002187 | 广百股份 | 07/11/12 | 08/02/22 | 新股网下申购 | 11.68 | 42.99  | 19,759    | 230,785.12     | 849,439.41     |
| 002185 | 华天科技 | 07/11/08 | 08/02/20 | 新股网下申购 | 10.55 | 21.44  | 33,697    | 355,503.35     | 722,463.68     |
| 002181 | 粤传媒  | 07/11/07 | 08/02/18 | 新股网下申购 | 7.49  | 26.68  | 17,421    | 130,483.29     | 464,792.28     |
| 002184 | 海得控制 | 07/11/07 | 08/02/18 | 新股网下申购 | 12.90 | 23.01  | 16,852    | 217,390.80     | 387,764.52     |
| 002189 | 利达光电 | 07/11/19 | 08/03/03 | 新股网下申购 | 5.10  | 14.70  | 24,710    | 126,021.00     | 363,237.00     |
| 002201 | 九鼎新材 | 07/12/13 | 08/03/26 | 新股网下申购 | 10.19 | 31.87  | 10,176    | 103,693.44     | 324,309.12     |
| 002190 | 成飞集成 | 07/11/19 | 08/03/03 | 新股网下申购 | 9.90  | 21.16  | 14,098    | 139,570.20     | 298,313.68     |
| 002199 | 东晶电子 | 07/12/12 | 08/03/21 | 新股网下申购 | 8.80  | 25.50  | 9,645     | 84,876.00      | 245,947.50     |
| 002196 | 方正电机 | 07/12/04 | 08/03/12 | 新股网下申购 | 7.48  | 24.38  | 9,880     | 73,902.40      | 240,874.40     |
| 002188 | 新嘉联  | 07/11/12 | 08/02/22 | 新股网下申购 | 10.07 | 21.46  | 11,180    | 112,582.60     | 239,922.80     |
| 002195 | 海隆软件 | 07/12/04 | 08/03/12 | 新股网下申购 | 10.49 | 32.86  | 6,796     | 71,290.04      | 223,316.56     |
| 002180 | 万力达  | 07/10/31 | 08/02/13 | 新股网下申购 | 13.88 | 34.39  | 5,500     | 76,340.00      | 189,145.00     |
| 合计     |      |          |          |        |       |        |           | 143,326,792.49 | 247,429,456.30 |

截至 2007 年 12 月 31 日，本基金股票投资部分持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌 | 期末估值 | 停牌原因 | 复牌 | 复牌开盘 | 数量 | 期末成本 | 期末估值 |
|------|------|----|------|------|----|------|----|------|------|
|------|------|----|------|------|----|------|----|------|------|

|        |      | 日期       | 单价    |              | 日期       | 单价    |           | 总额            | 总额             |
|--------|------|----------|-------|--------------|----------|-------|-----------|---------------|----------------|
| 600331 | 宏达股份 | 07/09/27 | 80.20 | 筹划定向增<br>发事宜 | 未定       | 未定    | 1,302,237 | 54,833,973.73 | 104,439,407.40 |
| 000400 | 许继电气 | 07/09/08 | 18.90 | 未按时披露<br>信息  | 08/01/07 | 20.79 | 500,000   | 7,768,011.95  | 9,450,000.00   |
| 合计     |      |          |       |              |          |       |           | 62,601,985.68 | 113,889,407.40 |

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

(3)、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。

## 8. 风险管理

### (1). 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。

### (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。

### (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。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 7 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的国债资产的公允价值。

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

#### (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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

##### (i) 市场价格风险

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

本基金投资组合中股票投资比例为基金资产的 60-95%，债券及其它金融工具投资比例合计为 0-40%，现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

| 2007 年 12 月 31 日 |                          |                |
|------------------|--------------------------|----------------|
|                  | 公允价值                     | 占基金资产<br>净值的比例 |
| <b>交易性金融资产</b>   |                          |                |
| - 股票投资           | 17,449,162,141.47        | 89.28%         |
| - 债券投资           | 798,978,000.00           | 4.09%          |
|                  | <u>18,248,140,141.47</u> | <u>93.37%</u>  |

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准的公允价值上升 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约 7.03 亿元(2006 年：无)；反之，若本基金业绩比较基准的公允价值下降 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约 7.03 亿元(2006 年：无)。

##### (ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合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 至 5 年 | 不计息               | 合计                |
|------------------|------------------|---------------|---------|-------------------|-------------------|
| <b>资产</b>        |                  |               |         |                   |                   |
| 银行存款             | 1,303,315,527.90 | -             | -       | -                 | 1,303,315,527.90  |
| 结算备付金            | 6,756,437.83     | -             | -       | -                 | 6,756,437.83      |
| 存出保证金            | 98,780.49        | -             | -       | 8,350,489.43      | 8,449,269.92      |
| 交易性金融资产          | 702,468,000.00   | 96,510,000.00 | -       | 17,449,162,141.47 | 18,248,140,141.47 |
| 应收证券清算款          | -                | -             | -       | 43,186,567.31     | 43,186,567.31     |
| 应收利息             | -                | -             | -       | 18,444,852.55     | 18,444,852.55     |
| 应收申购款            | -                | -             | -       | 104,455,187.34    | 104,455,187.34    |
| 资产总计             | 2,012,638,746.22 | 96,510,000.00 | -       | 17,623,599,238.10 | 19,732,747,984.32 |
| <b>负债</b>        |                  |               |         |                   |                   |
| 应付证券清算款          | -                | -             | -       | 32,195,154.79     | 32,195,154.79     |
| 应付赎回款            | -                | -             | -       | 107,753,873.59    | 107,753,873.59    |
| 应付管理人报酬          | -                | -             | -       | 23,394,519.40     | 23,394,519.40     |
| 应付托管费            | -                | -             | -       | 3,899,086.55      | 3,899,086.55      |
| 应付交易费用           | -                | -             | -       | 20,117,512.67     | 20,117,512.67     |
| 其他负债             | -                | -             | -       | 1,226,104.79      | 1,226,104.79      |
| 负债总计             | -                | -             | -       | 188,586,251.79    | 188,586,251.79    |
| 利率敏感度缺口          | 2,012,638,746.22 | 96,510,000.00 | -       | 17,435,012,986.31 | 19,544,161,732.53 |

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

### (iii) 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

## 9. 首次执行企业会计准则

本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)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 2007 年 6 月 30 日的所有者权益以及 2007 年 4 月 10 日(基金合同生效日)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：

|                        | 2007 年 4 月 10 日至 2007<br>年 6 月 30 日止期间净损<br>益 | 2007 年 6 月 30 日<br>所有者权益 |
|------------------------|-----------------------------------------------|--------------------------|
| 按原会计准则和制度列报的金额         | 500,836,218.01                                | 20,413,976,527.24        |
| 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产 | 1,225,200,381.60                              | -                        |
| 按企业会计准则列报的金额           | 1,726,036,599.61                              | 20,413,976,527.24        |

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、基金安瑞财务会计报告

### (一)、 资产负债表

二零零七年四月九日

单位：人民币元

| 项 目        | 附注 | 2007年4月9日        | 2006年12月31日    |
|------------|----|------------------|----------------|
| <b>资产：</b> |    |                  |                |
| 银行存款       |    | 98,124,045.19    | 63,229,737.13  |
| 清算备付金      |    | 5,789,255.31     | 4,091,842.11   |
| 交易保证金      |    | 1,536,292.13     | 598,780.49     |
| 应收证券清算款    |    | 0.00             | 9,996,265.73   |
| 应收股利       |    | 0.00             | 0.00           |
| 应收利息       |    | 3,743,391.16     | 1,786,538.52   |
| 其他应收款      |    | 0.00             | 0.00           |
| 股票投资市值     |    | 819,410,344.29   | 657,864,561.29 |
| 其中：股票投资成本  |    | 589,237,368.32   | 474,710,601.27 |
| 债券投资市值     |    | 208,710,577.56   | 180,249,649.30 |
| 其中：债券投资成本  |    | 208,667,698.66   | 179,719,601.13 |
| 权证投资市值     |    | 26,110,489.61    | 397,761.00     |
| 其中：权证投资成本  |    | 21,118,494.69    | 198,728.15     |
| 买入返售债券     |    | 0.00             | 0.00           |
| 待摊费用       |    | 0.00             | 0.00           |
| 其他资产       |    | 0.00             | 0.00           |
| 资产合计       |    | 1,163,424,395.25 | 918,215,135.57 |
| <b>负债：</b> |    |                  |                |
| 应付证券清算款    |    | 0.00             | 34,719,025.43  |
| 应付管理人报酬    |    | 404,552.72       | 1,042,079.26   |
| 应付托管费      |    | 67,425.46        | 173,679.90     |
| 应付佣金       |    | 2,042,939.23     | 1,228,916.74   |
| 应付利息       |    | 38,220.00        | 0.00           |
| 应付收益       |    | 0.00             | 0.00           |
| 未交税金       |    | 0.00             | 0.00           |
| 其他应付款      |    | 250,000.00       | 250,000.00     |
| 卖出回购证券款    |    | 100,000,000.00   | 0.00           |
| 短期借款       |    | 0.00             | 0.00           |
| 预提费用       |    | 185,095.47       | 50,000.00      |
| 其他负债       |    | 0.00             | 0.00           |
| 负债合计       |    | 102,988,232.88   | 37,463,701.33  |

**所有者权益：**

|            |                  |                |
|------------|------------------|----------------|
| 实收基金       | 500,000,000.00   | 500,000,000.00 |
| 未实现利得      | 235,207,849.79   | 183,883,041.04 |
| 未分配收益      | 325,228,312.58   | 196,868,393.20 |
| 持有人权益合计    | 1,060,436,162.37 | 880,751,434.24 |
| 负债和所有者权益合计 | 1,163,424,395.25 | 918,215,135.57 |

所附附注为本会计报表的组成部分

**(二)、 经营业绩表**

自二零零七年一月一日至二零零七年四月九日止期间

单位：人民币元

| 项 目        | 附注 | 2007年1月1日至<br>2007年4月9日止期间 | 2006年度         |
|------------|----|----------------------------|----------------|
| <b>收入：</b> |    |                            |                |
| 股票差价收入     |    | 326,182,868.18             | 249,039,870.73 |
| 债券差价收入     |    | 125,357.26                 | -478,144.53    |
| 权证差价收入     |    | 1,646,249.22               | 3,416,511.65   |
| 债券利息收入     |    | 1,744,628.84               | 3,816,855.60   |
| 存款利息收入     |    | 224,050.69                 | 276,699.08     |
| 股利收入       |    | 179,299.93                 | 7,237,190.30   |
| 买入返售证券收入   |    | 0.00                       | 0.00           |
| 其他收入       |    | 0.00                       | 13,200.00      |
| 收入合计       |    | 330,102,454.12             | 263,322,182.83 |

**费用：**

|          |              |               |
|----------|--------------|---------------|
| 基金管理人报酬  | 4,378,236.53 | 9,486,369.57  |
| 基金托管费    | 729,706.11   | 1,581,061.57  |
| 卖出回购证券支出 | 878,417.86   | 718,926.61    |
| 利息支出     | 0.00         | 0.00          |
| 其他费用     | 756,174.24   | 378,960.76    |
| 其中：上市年费  | 20,000.00    | 60,000.00     |
| 信息披露费    | 65,095.47    | 240,000.00    |
| 审计费用     | 50,000.00    | 50,000.00     |
| 费用合计     | 6,742,534.74 | 12,165,318.51 |

|              |                |                |
|--------------|----------------|----------------|
| <b>基金净收益</b> | 323,359,919.38 | 251,156,864.32 |
| 加：未实现估值增值变动数 | 51,324,808.75  | 166,117,670.33 |
| 基金经营业绩       | 374,684,728.13 | 417,274,534.65 |

所附附注为本会计报表的组成部分

**(三)、 收益分配表**

自二零零七年一月一日至二零零七年四月九日止期间

单位：人民币元

| 项 目          | 附注 | 2007年1月1日至<br>2007年4月9日止期间 | 2006年度         |
|--------------|----|----------------------------|----------------|
| 本期基金净收益      |    | 323,359,919.38             | 251,156,864.32 |
| 加：期初未分配收益    |    | 196,868,393.20             | -54,288,471.12 |
| 可供分配基金净收益    |    | 520,228,312.58             | 196,868,393.20 |
| 减：本期已分配基金净收益 |    | 195,000,000.00             | 0.00           |
| 期末基金未分配净收益   |    | 325,228,312.58             | 196,868,393.20 |

所附附注为本会计报表的组成部分

#### (四)、 净值变动表

自二零零七年一月一日至二零零七年四月九日止期间

单位：人民币元

| 项 目            | 附注 | 2007年1月1日至<br>2007年4月9日止期间 | 2006年度         |
|----------------|----|----------------------------|----------------|
| 一、期初基金净值       |    | 880,751,434.24             | 463,476,899.59 |
| 二、本期经营活动：      |    |                            |                |
| 基金净收益          |    | 323,359,919.38             | 251,156,864.32 |
| 未实现估值增值变动数     |    | 51,324,808.75              | 166,117,670.33 |
| 经营活动产生的基金净值变动数 |    | 374,684,728.13             | 417,274,534.65 |
| 三、本期向持有人分配收益   |    | 195,000,000.00             | 0.00           |
| 四、期末基金净值       |    | 1,060,436,162.37           | 880,751,434.24 |

所附附注为本会计报表的组成部分

#### (五)、 会计报表附注

##### 1. 主要会计政策、会计估计及其变更：

本年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

##### 2. 重大会计差错的内容和更正金额：

无。

##### 3. 关联方关系和关联方交易

(1). 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

| 关 联 人        | 关 系     | 交易性质   | 法律依据 |
|--------------|---------|--------|------|
| 华安基金管理有限公司   | 基金管理人   | 提取管理费、 | 基金合同 |
|              | 基金发起人   | 持有本基金  |      |
| 中国工商银行股份有限公司 | 基金托管人   | 提取托管费  | 基金合同 |
| 上海国际信托投资有限公司 | 基金管理人股东 |        |      |

|                |         |
|----------------|---------|
| 上海电气(集团)总公司    | 基金管理人股东 |
| 上海广电(集团)有限公司   | 基金管理人股东 |
| 上海沸点投资发展有限公司   | 基金管理人股东 |
| 上海工业投资(集团)有限公司 | 基金管理人股东 |

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2). 通过关联方交易单元进行的交易

①本报告期(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)本基金通过关联人交易单元的股票、债券、回购和权证成交量:无。

上年度本基金通过关联人交易单元的股票、债券、回购和权证成交量:无。

②本报告期(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)本基金没有与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易。

上年度本基金没有与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费,按前一日基金资产净值的 1.5%的年费率计提,本基金成立三个月后,若持有现金比例超过本基金资产净值的 20%,超过部分不计提基金管理费。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(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

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(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)需支付基金管理费 4,378,236.53 元。(2006 年度: 9,486,369.57 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(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)需支付基金托管费 729,706.11 元。(2006 年度: 1,581,061.57 元)

③ 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 4 月 9 日保管的银行存款余额为 98,124,045.19 元, 2006 年 12 月 31 日为 63,229,737.13 元。本基金在本报告

期间（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间）由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 193,387.17 元（2006 年度：244,776.58 元）。

(4). 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：

本报告期间（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间）基金管理公司投资本基金的情况：

| 关联人        | 期初数       |       | 买入 | 卖出 | 期末数       |       | 适用费率 |
|------------|-----------|-------|----|----|-----------|-------|------|
|            | 持有份额      | 持有比例  |    |    | 持有份额      | 持有比例  |      |
| 华安基金管理有限公司 | 6,318,119 | 1.26% | —  | —  | 6,318,119 | 1.26% | —    |

2006 年度基金管理公司投资本基金的情况：

| 关联人        | 期初数       |       | 买入   | 卖出   | 期末数       |       | 适用费率 |
|------------|-----------|-------|------|------|-----------|-------|------|
|            | 持有份额      | 持有比例  |      |      | 持有份额      | 持有比例  |      |
| 华安基金管理有限公司 | 6,318,119 | 1.26% | 0.00 | 0.00 | 6,318,119 | 1.26% | —    |

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：无。

**4. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产**

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票如下：

本基金截至 2007 年 4 月 9 日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票，这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

| 股票代码   | 股票名称  | 停牌日期     | 期末估值单价 | 复牌日期     | 复牌开盘单价 | 数量      | 期末成本总额     | 期末估值总额       |
|--------|-------|----------|--------|----------|--------|---------|------------|--------------|
| 000728 | S*京化二 | 07/03/27 | 13.36  | 07/10/30 | 50.00  | 100,000 | 571,050.09 | 1,336,000.00 |

截至 2007 年 4 月 9 日（基金合同失效前日），本基金股票投资部分持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

| 股票代码   | 股票名称 | 停牌日期     | 期末估值单价 | 停牌原因   | 复牌日期      | 复牌开盘单价 | 数量      | 期末成本总额        | 期末估值总额        |
|--------|------|----------|--------|--------|-----------|--------|---------|---------------|---------------|
| 600089 | 特变电工 | 2007-2-3 | 19.84  | 公告重大事项 | 2007-6-19 | 22.34  | 600,000 | 7,706,243.02  | 11,904,000.00 |
| 000410 | 沈阳机床 | 2007-4-7 | 19.45  | 公告重大事项 | 2007-4-13 | 22.28  | 800,000 | 7,912,215.06  | 15,560,000.00 |
| 合计     |      |          |        |        |           |        |         | 15,618,458.08 | 27,464,000.00 |

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券如下：

| 债券代码   | 债券名称   | 成功申购日期   | 可流通日期    | 单位成本  | 期末估值单价 | 数量     | 期末成本总额       | 期末估值总额       |
|--------|--------|----------|----------|-------|--------|--------|--------------|--------------|
| 126005 | 07 武钢债 | 07/03/29 | 07/04/17 | 77.52 | 82.21  | 20,660 | 1,601,606.44 | 1,698,369.76 |

本基金截至 2007 年 4 月 9 日（基金合同失效前日）止从事证券交易所债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 100,000,000.00 元（2006 年：无），于 2007 年 4 月 17 日到期。该类交易要求本基金在回购申报前指定用于回购质押的证券

交易所交易债券，并提交转入质押库。在回购期内提交的质押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。

(3)、期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至 2007 年 4 月 9 日(基金合同失效前日)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 4 月 9 日(基金合同失效前日)和 2006 年末均无。

## 九、华安成长投资组合报告

报告期自 2007 年 4 月 10 日起至 12 月 31 日止

### (一)、基金资产组合

| 序号 | 资产组合         | 金额(元)             | 占总资产比例  |
|----|--------------|-------------------|---------|
| 1  | 股票           | 17,449,162,141.47 | 88.43%  |
| 2  | 债券           | 798,978,000.00    | 4.05%   |
| 3  | 权证           | 0.00              | 0.00%   |
| 4  | 银行存款和清算备付金合计 | 1,310,071,965.73  | 6.64%   |
| 5  | 其他资产         | 174,535,877.12    | 0.88%   |
|    | 合计           | 19,732,747,984.32 | 100.00% |

### (二)、股票投资组合

| 行业分类             | 市值(元)            | 占资产净值比例 |
|------------------|------------------|---------|
| A 农、林、牧、渔业       | 166,398,341.44   | 0.85%   |
| B 采掘业            | 531,999,338.90   | 2.72%   |
| C 制造业            | 8,969,622,076.81 | 45.89%  |
| C0 食品、饮料         | 159,369,189.10   | 0.82%   |
| C1 纺织、服装、皮毛      | 241,000.00       | 0.00%   |
| C3 造纸、印刷         | 356,004,000.00   | 1.82%   |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料   | 1,494,256,892.01 | 7.65%   |
| C5 电子            | 394,287,031.77   | 2.02%   |
| C6 金属、非金属        | 3,186,328,146.56 | 16.30%  |
| C7 机械、设备、仪表      | 2,846,355,879.37 | 14.56%  |
| C8 医药、生物制品       | 481,179,938.00   | 2.46%   |
| C99 其他制造业        | 51,600,000.00    | 0.26%   |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 32,464,891.36    | 0.17%   |
| E 建筑业            | 84,946,572.00    | 0.43%   |
| F 交通运输、仓储业       | 2,404,099,994.17 | 12.30%  |

|           |                          |               |
|-----------|--------------------------|---------------|
| G 信息技术业   | 442,491,846.39           | 2.26%         |
| H 批发和零售贸易 | 378,291,229.52           | 1.94%         |
| I 金融、保险业  | 2,323,165,237.05         | 11.89%        |
| J 房地产业    | 1,956,543,922.28         | 10.01%        |
| K 社会服务业   | 158,673,899.27           | 0.81%         |
| L 传播与文化产业 | 464,792.28               | 0.00%         |
| <b>合计</b> | <b>17,449,162,141.47</b> | <b>89.28%</b> |

### (三)、基金投资前十名股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 股票数量(股)    | 市值(元)            | 占资产净值比例 |
|----|--------|------|------------|------------------|---------|
| 1  | 601166 | 兴业银行 | 19,800,880 | 1,026,873,636.80 | 5.25%   |
| 2  | 600383 | 金地集团 | 24,576,923 | 996,989,228.20   | 5.10%   |
| 3  | 000157 | 中联重科 | 13,550,000 | 778,447,500.00   | 3.98%   |
| 4  | 600786 | 东方锅炉 | 8,458,600  | 714,328,770.00   | 3.65%   |
| 5  | 600660 | 福耀玻璃 | 17,750,000 | 636,515,000.00   | 3.26%   |
| 6  | 600282 | 南钢股份 | 27,950,000 | 579,683,000.00   | 2.97%   |
| 7  | 000422 | 湖北宜化 | 23,360,400 | 537,522,804.00   | 2.75%   |
| 8  | 600026 | 中海发展 | 13,368,300 | 494,894,466.00   | 2.53%   |
| 9  | 000898 | 鞍钢股份 | 16,200,000 | 488,916,000.00   | 2.50%   |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 10,699,100 | 401,430,232.00   | 2.05%   |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于华安基金管理有限公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 的年度报告正文。

### (四)、报告期内股票投资组合的重大变动

#### 1、累计买入、累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额         | 占期末基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|------------------|--------------|
| 1  | 601166 | 兴业银行 | 2,049,355,941.94 | 10.49%       |
| 2  | 600383 | 金地集团 | 1,617,004,144.65 | 8.27%        |
| 3  | 000157 | 中联重科 | 787,938,117.80   | 4.03%        |
| 4  | 600282 | 南钢股份 | 659,625,442.73   | 3.38%        |
| 5  | 000898 | 鞍钢股份 | 651,605,043.23   | 3.33%        |
| 6  | 600660 | 福耀玻璃 | 575,419,463.67   | 2.94%        |
| 7  | 600786 | 东方锅炉 | 568,243,128.39   | 2.91%        |
| 8  | 600028 | 中国石化 | 563,445,721.04   | 2.88%        |
| 9  | 000422 | 湖北宜化 | 562,574,772.24   | 2.88%        |
| 10 | 601328 | 交通银行 | 508,751,063.78   | 2.60%        |
| 11 | 600308 | 华泰股份 | 508,418,378.14   | 2.60%        |
| 12 | 600026 | 中海发展 | 471,659,119.50   | 2.41%        |
| 13 | 600019 | 宝钢股份 | 465,641,635.41   | 2.38%        |

|    |        |      |                |       |
|----|--------|------|----------------|-------|
| 14 | 000039 | 中集集团 | 437,017,287.24 | 2.24% |
| 15 | 600428 | 中远航运 | 424,376,623.15 | 2.17% |
| 16 | 600219 | 南山铝业 | 407,404,321.96 | 2.08% |
| 17 | 600009 | 上海机场 | 404,800,396.80 | 2.07% |
| 18 | 000063 | 中兴通讯 | 399,638,770.64 | 2.04% |
| 19 | 601939 | 建设银行 | 394,452,844.48 | 2.02% |
| 20 | 600325 | 华发股份 | 391,150,691.32 | 2.00% |

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额         | 占期末基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|------------------|--------------|
| 1  | 601166 | 兴业银行 | 1,623,428,139.26 | 8.31%        |
| 2  | 600383 | 金地集团 | 973,824,873.77   | 4.98%        |
| 3  | 600028 | 中国石化 | 811,864,707.95   | 4.15%        |
| 4  | 000983 | 西山煤电 | 603,528,751.54   | 3.09%        |
| 5  | 601006 | 大秦铁路 | 523,781,933.53   | 2.68%        |
| 6  | 600019 | 宝钢股份 | 518,268,504.39   | 2.65%        |
| 7  | 600015 | 华夏银行 | 518,059,941.81   | 2.65%        |
| 8  | 000157 | 中联重科 | 463,522,243.49   | 2.37%        |
| 9  | 600036 | 招商银行 | 426,554,705.44   | 2.18%        |
| 10 | 600000 | 浦发银行 | 369,570,117.78   | 1.89%        |
| 11 | 000898 | 鞍钢股份 | 359,108,276.92   | 1.84%        |
| 12 | 600219 | 南山铝业 | 343,979,965.95   | 1.76%        |
| 13 | 000878 | 云南铜业 | 330,972,000.36   | 1.69%        |
| 14 | 000612 | 焦作万方 | 322,154,818.63   | 1.65%        |
| 15 | 600428 | 中远航运 | 321,202,925.37   | 1.64%        |
| 16 | 601988 | 中国银行 | 320,397,819.39   | 1.64%        |
| 17 | 000063 | 中兴通讯 | 296,813,262.19   | 1.52%        |
| 18 | 601628 | 中国人寿 | 292,244,947.95   | 1.50%        |
| 19 | 601328 | 交通银行 | 289,642,894.65   | 1.48%        |
| 20 | 000651 | 格力电器 | 287,216,908.38   | 1.47%        |

## 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： | 26,945,548,713.62 |
| 卖出股票的收入总额： | 18,929,619,622.09 |

## (五)、 债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元)          | 占资产净值比例 |
|----|------|----------------|---------|
| 1  | 国家债券 | 99,570,000.00  | 0.51%   |
| 2  | 央行票据 | 699,408,000.00 | 3.58%   |
|    | 合计   | 798,978,000.00 | 4.09%   |

#### (六)、 基金投资前五名债券明细

| 序号 | 债券代码    | 债券名称     | 债券数量(张)   | 市值(元)          | 占资产净值比例 |
|----|---------|----------|-----------|----------------|---------|
| 1  | 0701002 | 07 央票 02 | 2,200,000 | 214,038,000.00 | 1.10%   |
| 2  | 0701018 | 07 央票 18 | 2,000,000 | 194,300,000.00 | 0.99%   |
| 3  | 010709  | 07 国债 09 | 1,000,000 | 99,570,000.00  | 0.51%   |
| 4  | 0701004 | 07 央票 04 | 1,000,000 | 97,280,000.00  | 0.50%   |
| 5  | 0701006 | 07 央票 06 | 1,000,000 | 97,280,000.00  | 0.50%   |

#### (七)、 权证投资组合

##### 1、 基金投资前五名权证明细

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

#### (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  | 深圳结算保证金 | 8,350,489.43   |
| 2  | 上海权证担保金 | 50,000.00      |
| 3  | 深圳权证担保金 | 48,780.49      |
| 4  | 应收股利    | 0.00           |
| 5  | 应收利息    | 18,444,852.55  |
| 6  | 应收证券清算款 | 43,186,567.31  |
| 7  | 应收基金申购款 | 104,455,187.34 |

合计

174,535,877.12

#### 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        | 成本总额(元)        | 获得途径      |
|----|--------|---------|-----------|----------------|-----------|
| 1  | 580009 | 伊利 CWB1 | 4,281,200 | 102,283,831.85 | 主动投资      |
| 2  | 030002 | 五粮 YGC1 | 7,072,150 | 196,555,119.83 | 主动投资      |
| 3  | 038010 | 赤湾 NSP1 | 2,239,870 |                | 0 深赤湾免费派发 |

#### 6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下：

|             | 基金份额(份)       |
|-------------|---------------|
| 2007年4月9日   | 6,318,119.00  |
| 基金拆分增加份额    | 8,307,751.68  |
| 本期买入        | 12,706,627.20 |
| 实施份额激励减少份额  | 2,592,010.12  |
| 本期卖出        | 0.00          |
| 2007年12月31日 | 24,740,487.76 |

### 十、基金安瑞投资组合报告

报告期自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止

#### (一)、基金资产组合

| 序号 | 资产组合         | 金额(元)            | 占总资产比例  |
|----|--------------|------------------|---------|
| 1  | 股票           | 819,410,344.29   | 70.43%  |
| 2  | 债券           | 208,710,577.56   | 17.94%  |
| 3  | 权证           | 26,110,489.61    | 2.24%   |
| 4  | 银行存款和清算备付金合计 | 103,913,300.50   | 8.93%   |
| 5  | 其他资产         | 5,279,683.29     | 0.45%   |
|    | 合计           | 1,163,424,395.25 | 100.00% |

#### (二)、股票投资组合

|   | 行业分类     | 市值(元)         | 占资产净值比例 |
|---|----------|---------------|---------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 50,547,603.34 | 4.77%   |
| B | 采掘业      | 53,928,110.50 | 5.09%   |

|     |                |                       |               |
|-----|----------------|-----------------------|---------------|
| C   | 制造业            | 534,445,674.25        | 50.40%        |
| C0  | 食品、饮料          | 12,404,206.12         | 1.17%         |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 118,917,153.10        | 11.21%        |
| C5  | 电子             | 81,539,495.00         | 7.69%         |
| C6  | 金属、非金属         | 112,967,894.62        | 10.65%        |
| C7  | 机械、设备、仪表       | 172,980,473.01        | 16.31%        |
| C8  | 医药、生物制品        | 7,626,022.40          | 0.72%         |
| C99 | 其他制造业          | 28,010,430.00         | 2.64%         |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 21,806,500.00         | 2.06%         |
| E   | 建筑业            | 5,526,927.34          | 0.52%         |
| F   | 交通运输、仓储业       | 73,749,539.16         | 6.95%         |
| H   | 批发和零售贸易        | 5,246,500.00          | 0.49%         |
| I   | 金融、保险业         | 43,525,500.00         | 4.10%         |
| J   | 房地产业           | 15,885,738.70         | 1.50%         |
| K   | 社会服务业          | 14,748,251.00         | 1.39%         |
|     | <b>合计</b>      | <b>819,410,344.29</b> | <b>77.27%</b> |

### (三)、 基金投资前十名股票明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 股票数量(股)   | 市值(元)         | 占资产净值比例 |
|----|--------|------|-----------|---------------|---------|
| 1  | 002021 | 中捷股份 | 5,400,000 | 77,382,000.00 | 7.30%   |
| 2  | 000829 | 天音控股 | 2,609,582 | 50,547,603.34 | 4.77%   |
| 3  | 600309 | 烟台万华 | 1,300,000 | 45,812,000.00 | 4.32%   |
| 4  | 600786 | 东方锅炉 | 766,413   | 34,205,012.19 | 3.23%   |
| 5  | 600428 | 中远航运 | 1,600,000 | 30,560,000.00 | 2.88%   |
| 6  | 600123 | 兰花科创 | 1,210,000 | 29,705,500.00 | 2.80%   |
| 7  | 002049 | 晶源电子 | 1,885,690 | 29,586,476.10 | 2.79%   |
| 8  | 002094 | 青岛金王 | 1,619,100 | 28,010,430.00 | 2.64%   |
| 9  | 000401 | 冀东水泥 | 3,082,032 | 27,892,389.60 | 2.63%   |
| 10 | 600009 | 上海机场 | 900,000   | 25,524,000.00 | 2.41%   |

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于华安基金管理有限公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 的年度报告正文。

### (四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额      | 占期初基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 600309 | 烟台万华 | 51,131,962.46 | 5.81%        |
| 2  | 600059 | 古越龙山 | 42,033,687.80 | 4.77%        |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 33,332,008.34 | 3.78%        |
| 4  | 000800 | 一汽轿车 | 32,136,263.71 | 3.65%        |
| 5  | 600786 | 东方锅炉 | 32,111,342.11 | 3.65%        |

|    |        |      |               |       |
|----|--------|------|---------------|-------|
| 6  | 000401 | 冀东水泥 | 26,722,647.05 | 3.03% |
| 7  | 000768 | 西飞国际 | 25,715,888.18 | 2.92% |
| 8  | 002092 | 中泰化学 | 23,851,376.61 | 2.71% |
| 9  | 002094 | 青岛金王 | 23,723,242.50 | 2.69% |
| 10 | 000690 | 宝新能源 | 21,833,425.78 | 2.48% |
| 11 | 600005 | 武钢股份 | 21,644,978.36 | 2.46% |
| 12 | 000731 | 四川美丰 | 19,672,169.22 | 2.23% |
| 13 | 600000 | 浦发银行 | 19,199,370.49 | 2.18% |
| 14 | 000060 | 中金岭南 | 18,975,749.50 | 2.15% |
| 15 | 600428 | 中远航运 | 17,559,330.01 | 1.99% |
| 16 | 600600 | 青岛啤酒 | 17,239,214.25 | 1.96% |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 15,066,629.08 | 1.71% |
| 18 | 002106 | 莱宝高科 | 14,852,432.81 | 1.69% |
| 19 | 600596 | 新安股份 | 14,483,238.08 | 1.64% |
| 20 | 000548 | 湖南投资 | 13,934,579.87 | 1.58% |

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值的比例 |
|----|--------|------|---------------|--------------|
| 1  | 000933 | 神火股份 | 67,080,304.27 | 7.62%        |
| 2  | 000157 | 中联重科 | 54,164,135.61 | 6.15%        |
| 3  | 600059 | 古越龙山 | 46,281,060.43 | 5.25%        |
| 4  | 600875 | 东方电机 | 45,810,431.61 | 5.20%        |
| 5  | 600428 | 中远航运 | 39,981,229.11 | 4.54%        |
| 6  | 000690 | 宝新能源 | 39,192,309.73 | 4.45%        |
| 7  | 002028 | 思源电气 | 37,816,087.90 | 4.29%        |
| 8  | 000800 | 一汽轿车 | 36,439,276.92 | 4.14%        |
| 9  | 002021 | 中捷股份 | 34,145,862.21 | 3.88%        |
| 10 | 600019 | 宝钢股份 | 32,742,241.66 | 3.72%        |
| 11 | 000625 | 长安汽车 | 29,282,270.88 | 3.32%        |
| 12 | 002025 | 航天电器 | 29,209,232.31 | 3.32%        |
| 13 | 600009 | 上海机场 | 29,079,586.03 | 3.30%        |
| 14 | 000768 | 西飞国际 | 28,862,019.72 | 3.28%        |
| 15 | 600153 | 建发股份 | 24,889,019.65 | 2.83%        |
| 16 | 000858 | 五粮液  | 24,662,560.92 | 2.80%        |
| 17 | 600219 | 南山铝业 | 22,474,690.19 | 2.55%        |
| 18 | 000410 | 沈阳机床 | 20,720,793.11 | 2.35%        |
| 19 | 601166 | 兴业银行 | 18,548,818.94 | 2.11%        |
| 20 | 600519 | 贵州茅台 | 14,256,589.12 | 1.62%        |

## 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： | 801,570,575.52   |
| 卖出股票的收入总额： | 1,014,069,438.96 |

### (五)、 债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 市值(元)          | 占资产净值比例 |
|----|------|----------------|---------|
| 1  | 国家债券 | 171,902,207.80 | 16.21%  |
| 2  | 金融债券 | 35,110,000.00  | 3.31%   |
| 3  | 企业债券 | 1,698,369.76   | 0.16%   |
|    | 合计   | 208,710,577.56 | 19.68%  |

### (六)、 基金投资前五名债券明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称      | 债券数量(张) | 市值(元)         | 占资产净值比例 |
|----|--------|-----------|---------|---------------|---------|
| 1  | 010214 | 02 国债(14) | 596,460 | 59,771,256.60 | 5.64%   |
| 2  | 010103 | 21 国债(3)  | 437,490 | 44,120,866.50 | 4.16%   |
| 3  | 010115 | 21 国债(15) | 377,600 | 37,922,368.00 | 3.58%   |
| 4  | 010010 | 20 国债(10) | 257,090 | 25,829,832.30 | 2.44%   |
| 5  | 050404 | 05 农发 04  | 250,000 | 24,990,000.00 | 2.36%   |

### (七)、 权证投资组合

#### 1、 基金投资前五名权证明细

| 序号 | 权证代码   | 权证名称    | 数量      | 市值(元)         | 占资产净值比例 |
|----|--------|---------|---------|---------------|---------|
| 1  | 030002 | 五粮 YGC1 | 500,000 | 10,966,500.00 | 1.03%   |
| 2  | 580005 | 万华 HXB1 | 230,000 | 8,944,470.00  | 0.84%   |
| 3  | 580009 | 伊利 CWB1 | 300,000 | 5,701,200.00  | 0.54%   |
| 4  | 580013 | 武钢 CWB1 | 200,402 | 498,319.61    | 0.05%   |

### (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)的市场平均价计算,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  | 深圳结算保证金 | 1,437,511.64 |
| 2  | 上海权证担保金 | 50,000.00    |
| 3  | 深圳权证担保金 | 48,780.49    |
| 4  | 应收利息    | 3,743,391.16 |
|    | 合计      | 5,279,683.29 |

### 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      | 成本总额(元)       | 获得途径        |
|----|--------|---------|---------|---------------|-------------|
| 1  | 580005 | 万华 HXB1 | 320,000 | 9,619,702.96  | 主动投资        |
| 2  | 580009 | 伊利 CWB1 | 300,000 | 5,475,434.67  | 主动投资        |
| 3  | 030002 | 五粮 YGC1 | 710,000 | 11,735,597.04 | 主动投资        |
| 4  | 580013 | 武钢 CWB1 | 200,402 | 464,393.56    | 投资 07 武钢债获赠 |

### 6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的情况如下：

|             | 基金份额(份)      |
|-------------|--------------|
| 2006年12月31日 | 6,318,119.00 |
| 本期买入        | 0.00         |
| 本期卖出        | 0.00         |
| 2007年4月9日   | 6,318,119.00 |

## 十一、基金份额持有人户数和持有人结构

### (一)、2007 年 12 月 31 日华安成长基金份额持有人户数和持有人结构

|              |                   |         |
|--------------|-------------------|---------|
| 基金份额持有人户数    | 717,228 户         |         |
| 平均每户持有基金份额   | 17,188.34 份       |         |
| 项目           | 份额(份)             | 占总份额的比例 |
| 机构投资者持有的基金份额 | 464,633,077.19    | 3.77%   |
| 个人投资者持有的基金份额 | 11,863,327,231.75 | 96.23%  |
| 其中：          |                   |         |
| 本公司员工持有的基金份额 | 42,756.38         | 0.00%   |

## (二)、 2007 年 4 月 9 日基金安瑞基金份额持有人户数和持有人结构

|              |                |                |
|--------------|----------------|----------------|
| 基金份额持有人户数    | 20,369 户       |                |
| 平均每户持有基金份额   | 24,547 份       |                |
| <b>项目</b>    | <b>份额(份)</b>   | <b>占总份额的比例</b> |
| 机构投资者持有的基金份额 | 320,146,031.00 | 64.03%         |
| 个人投资者持有的基金份额 | 179,853,969.00 | 35.97%         |

## (三)、 2007 年 4 月 9 日基金安瑞前十名持有人

| 序号 | 项目                                    | 份额(份)         | 占总份额的比例 |
|----|---------------------------------------|---------------|---------|
| 1  | 中国人寿保险(集团)公司                          | 49,042,797.00 | 9.81%   |
| 2  | 中国人寿保险股份有限公司                          | 45,453,575.00 | 9.09%   |
| 3  | 新华人寿保险股份有限公司                          | 44,049,784.00 | 8.81%   |
| 4  | 中国太平洋人寿保险股份有限公司                       | 24,263,617.00 | 4.85%   |
| 5  | 宋伟铭                                   | 17,770,000.00 | 3.55%   |
| 6  | 泰康人寿保险股份有限公司                          | 15,758,131.00 | 3.15%   |
| 7  | 国际金融一建行一中金股票策略集合资产管理计划                | 14,982,889.00 | 3.00%   |
| 8  | 中信信托投资有限责任公司一财富二号信托产品                 | 14,728,771.00 | 2.95%   |
| 9  | 中国太平洋保险公司                             | 13,689,178.00 | 2.74%   |
| 10 | 招商证券股份有限公司一招商银行股份有限公司一招商证券基金宝集合资产管理计划 | 12,900,000.00 | 2.58%   |

## 十二、华安成长开放式基金份额变动

| 序号 | 项目             | 份额(份)             |
|----|----------------|-------------------|
| 1  | 基金合同生效日的基金份额总额 | 500,000,000.00    |
| 2  | 期初基金份额总额       | 500,000,000.00    |
| 3  | 加: 本期申购基金份额总额  | 20,061,473,670.42 |
| 4  | 其中: 基金拆分折算份额总额 | 657,454,582.58    |
| 5  | 申购份额总额         | 19,404,019,087.84 |
| 6  | 减: 本期赎回基金份额总额  | 8,233,513,361.48  |
| 7  | 期末基金份额总额       | 12,327,960,308.94 |

## 十三、重大事件

### (一)、基金份额持有人大会决议:

本基金管理人于 2007 年 1 月 25 日, 发布安瑞证券投资基金召开基金份额持有人大会公告, 提请审议《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》。

本基金管理人于 2007 年 3 月 2 日，发布关于安瑞证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告，《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》获全票通过。

本基金管理人于 2007 年 3 月 28 日，发布关于安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告，中国证券监督管理委员会于 2007 年 3 月 23 日下发了《关于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》（证监基金字【2007】81 号），同意安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。

(二)、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

1、本基金管理人重大人事变动如下：

本基金管理人于 2007 年 3 月 14 日，发布由于林义将先生因个人原因提出辞职，经华安基金管理公司董事会审议批准，由刘光华先生担任安瑞证券投资基金的基金经理，林义将先生不再担任安瑞证券投资基金的基金经理。

本基金管理人于 2007 年 3 月 22 日，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。

本基金管理人于 2007 年 5 月 11 日，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。

本基金管理人于 2007 年 7 月 26 日，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。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

(三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼：无。

(四)、基金投资策略的改变：无。

(五)、基金收益分配事项：

1、安瑞基金本报告期基金收益分配事项：

|         | 分红公告日     | 权益登记日    | 除息日      | 每10份基金<br>份额收益分<br>配金额 | 收益分配金额         |
|---------|-----------|----------|----------|------------------------|----------------|
| 本期第1次分红 | 2007-3-28 | 2007-4-2 | 2007-4-3 | 3.90 元                 | 195,000,000.00 |

2、华安成长本报告期基金收益分配事项：无。

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况：

本基金管理人于 2007 年 6 月 5 日，发布关于更换旗下部分基金会计师事务所的公告，经华安基金管理有限公司董事会审议通过，本基金的会计师事务所由立信会计师事务所有限公司（原上海立信长江会计师事务所有限公司）更换为普华永道中天会计师事务所有限公司。上述事项已经基金托管人中国工商银行股份有限公司同意，并报中国证监会备案。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：160,000.00 元。

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

(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形，包括稽查或处罚的次数、原因及结论，如监管部门提出整改意见的，应简单说明整改情况：无。

(八)、基金租用证券公司专用交易单元的有关情况:

1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况:

新增交易单元:

| 券商名称           | 上交所交易单元数 | 深交所交易单元数 |
|----------------|----------|----------|
| 西部证券股份有限公司     | 1        | —        |
| 中银国际证券有限责任公司   | —        | 1        |
| 联合证券有限责任公司     | —        | 1        |
| 中国建银投资证券有限责任公司 | 1        | —        |
| 中信证券股份有限公司     | 1        | —        |
| 国信证券有限责任公司     | 1        | —        |

退租交易单元: 无

2. 交易成交量及佣金情况:

(1). 华安成长股票交易情况:

| 券商名称           | 交易单元数量 | 成交量               | 占总成交总量比例 | 佣金            | 占总佣金总量比例 |
|----------------|--------|-------------------|----------|---------------|----------|
| 长城证券有限责任公司     | 1      | 898,086,664.36    | 1.98%    | 734,607.54    | 2.01%    |
| 国泰君安证券股份有限公司   | 1      | 4,068,163,536.76  | 8.99%    | 3,183,361.05  | 8.69%    |
| 上海证券有限责任公司     | 1      | 2,712,121,899.04  | 5.99%    | 2,223,927.87  | 6.07%    |
| 西部证券股份有限公司     | 1      | 7,889,090,126.74  | 17.43%   | 6,469,031.68  | 17.66%   |
| 兴业证券股份有限公司     | 1      | 3,887,237,285.47  | 8.59%    | 3,187,528.48  | 8.70%    |
| 中国银河证券有限责任公司   | 1      | 5,376,613,026.92  | 11.88%   | 4,408,813.79  | 12.03%   |
| 招商证券股份有限公司     | 1      | 620,047,482.10    | 1.37%    | 485,189.79    | 1.32%    |
| 中银国际证券有限责任公司   | 1      | 2,201,776,476.57  | 4.86%    | 1,722,897.02  | 4.70%    |
| 国信证券有限责任公司     | 1      | 2,255,660,075.90  | 4.98%    | 1,849,639.30  | 5.05%    |
| 联合证券有限责任公司     | 1      | 5,853,234,530.65  | 12.93%   | 4,580,182.51  | 12.50%   |
| 中国建银投资证券有限责任公司 | 1      | 8,831,381,082.30  | 19.51%   | 7,241,719.46  | 19.77%   |
| 中信证券股份有限公司     | 1      | 672,341,721.03    | 1.49%    | 551,320.37    | 1.50%    |
| 合计             | 12     | 45,265,753,907.84 | 100.00%  | 36,638,218.86 | 100.00%  |

(2). 华安成长债券、回购及权证交易情况:

| 券商名称         | 债券成交量          | 占总成交总量比例 | 回购成交量         | 占总成交总量比例 | 权证成交量          | 占总成交总量比例 |
|--------------|----------------|----------|---------------|----------|----------------|----------|
| 长城证券有限责任公司   | 173,568,747.30 | 72.07%   | 14,800,000.00 | 100.00%  | 7,443,175.95   | 1.02%    |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 2,751,165.00   | 1.14%    | 0.00          | 0.00%    | 123,842,652.49 | 17.04%   |
| 上海证券有限责任公司   | 0.00           | 0.00%    | 0.00          | 0.00%    | 26,256,617.05  | 3.61%    |
| 西部证券股份有限公司   | 1,691,111.00   | 0.70%    | 0.00          | 0.00%    | 96,917,255.40  | 13.34%   |
| 兴业证券股份有限公司   | 55,554,485.60  | 23.07%   | 0.00          | 0.00%    | 0.00           | 0.00%    |

|                |                |         |               |         |                |         |
|----------------|----------------|---------|---------------|---------|----------------|---------|
| 中国银河证券有限责任公司   | 0.00           | 0.00%   | 0.00          | 0.00%   | 29,139,363.15  | 4.01%   |
| 招商证券股份有限公司     | 0.00           | 0.00%   | 0.00          | 0.00%   | 23,000,132.00  | 3.17%   |
| 中银国际证券有限责任公司   | 0.00           | 0.00%   | 0.00          | 0.00%   | 97,753,404.92  | 13.45%  |
| 国信证券有限责任公司     | 0.00           | 0.00%   | 0.00          | 0.00%   | 0.00           | 0.00%   |
| 联合证券有限责任公司     | 0.00           | 0.00%   | 0.00          | 0.00%   | 237,247,417.35 | 32.65%  |
| 中国建银投资证券有限责任公司 | 0.00           | 0.00%   | 0.00          | 0.00%   | 85,038,697.42  | 11.70%  |
| 中信证券股份有限公司     | 7,253,280.00   | 3.01%   | 0.00          | 0.00%   | 0.00           | 0.00%   |
| 合计             | 240,818,788.90 | 100.00% | 14,800,000.00 | 100.00% | 726,638,715.73 | 100.00% |

(3). 基金安瑞股票交易情况:

| 券商名称         | 交易<br>单元<br>数量 | 成交量              | 占总成交<br>总量比例 | 佣金           | 占总佣金<br>总量比例 |
|--------------|----------------|------------------|--------------|--------------|--------------|
| 长城证券有限责任公司   | 1              | 158,638,714.58   | 8.76%        | 128,262.73   | 8.87%        |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1              | 511,543,588.59   | 28.25%       | 400,286.85   | 27.69%       |
| 上海证券有限责任公司   | 1              | 303,356,151.63   | 16.75%       | 247,386.38   | 17.11%       |
| 兴业证券股份有限公司   | 1              | 160,714,528.89   | 8.88%        | 131,050.35   | 9.07%        |
| 中国银河证券有限责任公司 | 1              | 316,510,987.98   | 17.48%       | 256,849.34   | 17.77%       |
| 招商证券股份有限公司   | 1              | 359,944,180.40   | 19.88%       | 281,658.47   | 19.49%       |
| 合计           | 6              | 1,810,708,152.07 | 100.00%      | 1,445,494.12 | 100.00%      |

(4). 基金安瑞债券、回购及权证交易情况:

| 券商名称         | 债券成交量          | 占总成交<br>总量比例 | 回购成交量            | 占总成<br>交总量<br>比例 | 权证成交量         | 占总成<br>交总量<br>比例 |
|--------------|----------------|--------------|------------------|------------------|---------------|------------------|
| 长城证券有限责任公司   | 35,406,085.50  | 27.12%       | 371,500,000.00   | 32.39%           | 8,606,666.11  | 24.70%           |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 0.00           | 0.00%        | 0.00             | 0.00%            | 15,477,942.35 | 44.41%           |
| 上海证券有限责任公司   | 66,269,470.80  | 50.76%       | 140,000,000.00   | 12.21%           | 5,123,193.19  | 14.70%           |
| 兴业证券股份有限公司   | 0.00           | 0.00%        | 156,000,000.00   | 13.60%           | 0.00          | 0.00%            |
| 中国银河证券有限责任公司 | 28,881,840.70  | 22.12%       | 479,400,000.00   | 41.80%           | 5,475,010.40  | 15.71%           |
| 招商证券股份有限公司   | 0.00           | 0.00%        | 0.00             | 0.00%            | 167,900.00    | 0.48%            |
| 合计           | 130,557,397.00 | 100.00%      | 1,146,900,000.00 | 100.00%          | 34,850,712.05 | 100.00%          |

3. 券商专用交易单元选择标准:

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

- (1) 资历雄厚, 信誉良好;
- (2) 财务状况良好, 经营行为规范;

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

(4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

(5) 证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面研究报告及信息服务，并能根据基金投资研究的特定要求，提供专题研究报告。

#### 4. 券商专用交易单元选择程序：

##### (1) 对候选券商的综合服务进行评估

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

##### (2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

##### (3) 候选交易单元名单提交分管副总审批

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

##### (4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

#### (九)、其他重要事项：

##### 1. 修改基金合同：

|    | 公告重要事项                                                                                                                                                                           | 披露日期       |
|----|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 1) | 发布安瑞证券投资基金终止上市公告，本基金于 2007 年 4 月 10 日终止上市，自基金安瑞终止上市之日起，基金名称变更为华安中小盘成长股票型证券投资基金，由《安瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效，基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》为准。 | 2007-04-04 |
| 2) | 发布华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书、华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告。                                                                                                                           | 2007-04-11 |

- 3) 发布关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告, 2007-04-20  
经本基金托管人中国工商银行股份有限公司确认, 基金份额折算基准日(2007 年 4 月 18 日)折算前基金份额净值为 2.3149 元, 精确到小数点后第 9 位为 2.314909165 元(第 9 位以后舍去), 本基金管理人按照 1: 2.314909165 的折算比例将原基金安瑞的基金份额进行了折算。折算后, 基金份额净值转换为 1.0000 元, 相应地, 原基金安瑞每 1 份基金份额折算为 2.314909165 份, 基金份额计算结果四舍五入保留小数点后两位。原基金安瑞的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份。
- 4) 发布华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购确认比例和集中申购结果的公告, 经上海立信长江会计师事务所验资, 本次华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购的有效申购申请金额为 29,635,516,017.90 元人民币, 按照本基金在集中申购期内的最终有效申购确认金额折合基金份额拟不超过 100 亿份规模上限的规定, 本基金集中申购的确认比例为 33.7432963%, 本基金的最终有效申购确认金额为 10,000,000,066.56 元人民币, 扣除集中申购费后, 本基金的最终净有效集中申购确认金额为 9,883,484,414.21 元人民币, 折合基金份额 9,883,484,414.21 份。截至 2007 年 4 月 18 日止, 原安瑞证券投资基金的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份, 原安瑞证券投资基金基金份额持有人因暂未指定交易等原因产生的未领取现金红利 1,376,246.47 元人民币确认为基金份额 1,376,246.47 份。华安中小盘成长股票型证券投资基金基金总份额由 500,000,000 份变更为 11,042,315,243.26 份。
- 5) 关于证券投资基金实施新的会计准则的公告, 根据中国证监会的相关规定, 我公司管理的所有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后, 基金将全面采用公允价值进行会计计量, 请投资者关注相关法规的规定。实施新会计准则后, 基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。 2007-07-02
- 6) 关于修改华安中小盘成长股票型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, 经与华安中小盘成长股票型基金的托管人中国工商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, 对华安成长基金的基金合同中的基金资产估值条款进行修改。 2007-09-29

## 2. 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。上述股权转让事宜的工商变更登记手续已办理完毕。                                                                                           | 2007-11-20               |
| 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               |
| 3. | 公司固有资金申购:<br>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中小盘成长股票型证券投资基金(基金代码040007)1000万元,申购费用为单笔1000元。<br>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中小盘成长股票型证券投资基金(基金代码040007)2200万元,申购费用为单笔1000元。 | 2007-11-20<br>2007-12-11 |
| 4. | 其他重要事项:                                                                                                                                                                                                                |                          |
| 1) | 关于国信证券有限责任公司和渤海证券有限公司开通华安中小盘成长股票型证券投资基金代销和确权业务的公告                                                                                                                                                                      | 2007-04-26               |
| 2) | 华安中小盘成长股票型证券投资基金开放日常申购赎回业务公告,于2007年5月16日开始办理日常申购、赎回业务。                                                                                                                                                                 | 2007-05-14               |
| 3) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购业务的公告,自2007年5月17日起暂停华安成长基金的日常申购业务。                                                                                                                                                               | 2007-05-17               |
| 4) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金重新开放申购的公告,从2007年6月8日起(含)重新开放华安中小盘成长股票型证券投资基金的申购业务。                                                                                                                                                   | 2007-06-06               |
| 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) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金开通基金转换业务的公告                                                                                                                                                                                          | 2007-06-08               |
| 7) | 关于旗下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、华安中小盘成长股票型证券投资基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率活动的公告                                                                                                                                        | 2007-06-19               |
| 8) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购和转入业务的公告,自公告发布之日起暂停华安中小盘成长股票型证券投资基金(简称“本基金”)的申购和转入业务。                                                                                                                                            | 2007-06-21               |
| 9) | 关于旗下基金投资金地集团(600383)非公开发行股票的公告                                                                                                                                                                                         | 2007-07-11               |

- |     |                                                                                                                   |            |
|-----|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 10) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购和转入业务的第二次提示性公告                                                                              | 2007-07-19 |
| 11) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告                                                                               | 2007-08-02 |
| 12) | 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 |
| 13) | 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 |
| 14) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告                                                                               | 2007-08-16 |
| 15) | 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 |
| 16) | 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 |
| 17) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告                                                                               | 2007-08-30 |
| 18) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金继续暂停申购和转入业务的提示性公告                                                                               | 2007-09-13 |
| 19) | 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 |
| 20) | 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 |
| 21) | 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金重新开放申购和转入业务的公告                                                                                  | 2007-09-24 |
| 22) | 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 |
| 23) | 关于新增德邦证券有限责任公司为华安中小盘成长股票型证券投资基金代销机构的公告                                                                            | 2007-10-11 |
| 24) | 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 |
| 25) | 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 | 2007-10-19 |
| 26) | 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 |
| 27) | 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 |
| 28) | 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 |
| 29) | 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 |

- |     |                                                                                                                                                                                                                                 |            |
|-----|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------|
| 30) | 关于对原安瑞基金份额持有人实施第一次基金份额激励的公告，对在安瑞基金转型前即持有基金份额，并自本基金开放日常申购、赎回之日（即 2007 年 5 月 16 日）起，持有由原安瑞基金（基金代码：500013）基金份额转型而来的本基金份额满 6 个月的持有人（以下简称“原安瑞基金份额持有人”），按 0.5% 的比例增加其基金份额数量（本次新增激励份额不计入下次激励计算基数，按四舍五入保留至小数点后 2 位），同时扣减本基金管理人持有的本基金份额。 | 2007-11-20 |
| 31) | 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 |
| 32) | 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 |
| 33) | 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 |
| 34) | 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 |
| 35) | 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 |
| 36) | 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 |
| 37) | 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 |
| 38) | 关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告                                                                                                                                                                                                            | 2008-02-25 |
| 39) | 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                                                                                                                                                                                               | 2008-03-21 |
| 40) | 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 |
| 41) | 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                                                                                                                                                                                           | 2008-03-24 |
| 42) | 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                                                                                                                                                                                           | 2008-03-24 |

前款所涉重大事件已作为临时报告在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》或基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn> 上披露。

#### 十四、备查文件目录

- 1、《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》
- 4、《安瑞证券投资基金基金合同》
- 5、《安瑞证券投资基金扩募说明书》
- 6、《安瑞证券投资基金托管协议》
- 7、中国证监会批准安瑞证券投资基金设立的文件；
- 8、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；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 10、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 11、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