

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资 基金

2008 年年度报告

2008 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2009 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6	审计报告	14
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
7.2	利润表	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4	报表附注	18
§ 8	投资组合报告	35
8.1	期末基金资产组合情况	35
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	36
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有指数股票投资和积极股票投资明细	37
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	43
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	45
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	45
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	45
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	45
8.9	投资组合报告附注	46
§ 9	基金份额持有人信息	46
§ 10	开放式基金份额变动	47
§ 11	重大事件揭示	47
§ 12	备查文件目录	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中国 A 股	
交易代码	040002（前端）	041002（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 日	
报告期末基金份额总额	7,020,648,015.92 份	

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。
投资策略	（1）资产配置：本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95% 。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下，可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况，适当调整基金资产分配比例。（2）股票投资：本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。（3）其它投资：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的收益。
业绩比较基准	$95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司 （简称“华安基金”）	中国工商银行股份有限公司 （简称“中国工商银行”）
信息披露负责	姓名	冯颖	蒋松云
	联系电话	021-38969999	010-66105799

人	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	40088-50099	95588	
传真	021-68863414	010-66105798	
注册地址	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	俞妙根	姜建清	

2.4、信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	华安基金管理有限公司
办公地址:	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
本期已实现收益	-1,432,998,451.59	590,498,564.57	416,895,175.52
本期利润	-4,884,700,075.95	1,793,730,568.59	844,639,224.91
加权平均基金份额本期利润	-2.2131	2.1896	0.9297
本期加权平均净值利润率	-99.32%	58.11%	79.75%
本期基金份额净值增长率	-62.45%	154.07%	121.21%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
期末可供分配利润	1,358,410,827.02	1,886,474,494.68	262,311,066.23
期末可供分配基金份额利润	0.1935	1.3350	0.5037
期末基金资产净值	3,627,316,273.50	6,386,096,840.97	979,872,398.98
期末基金份额净值	0.517	4.519	1.882
3.1.3 累计期末指标	2008 年	2007 年	2006 年
基金份额累计净值增长率	109.44%	457.82%	119.55%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金

交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	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	-16.75%	2.90%	-16.31%	2.81%	-0.44%	0.09%
过去六个月	-32.68%	2.77%	-32.10%	2.79%	-0.58%	-0.02%
过去一年	-62.45%	2.81%	-61.41%	2.86%	-1.04%	-0.05%
过去三年	111.02%	2.20%	96.21%	2.23%	14.81%	-0.03%
过去五年	91.16%	1.83%	68.11%	1.86%	23.05%	-0.03%
自基金合同生效起至今	109.44%	1.69%	65.90%	1.72%	43.54%	-0.03%

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

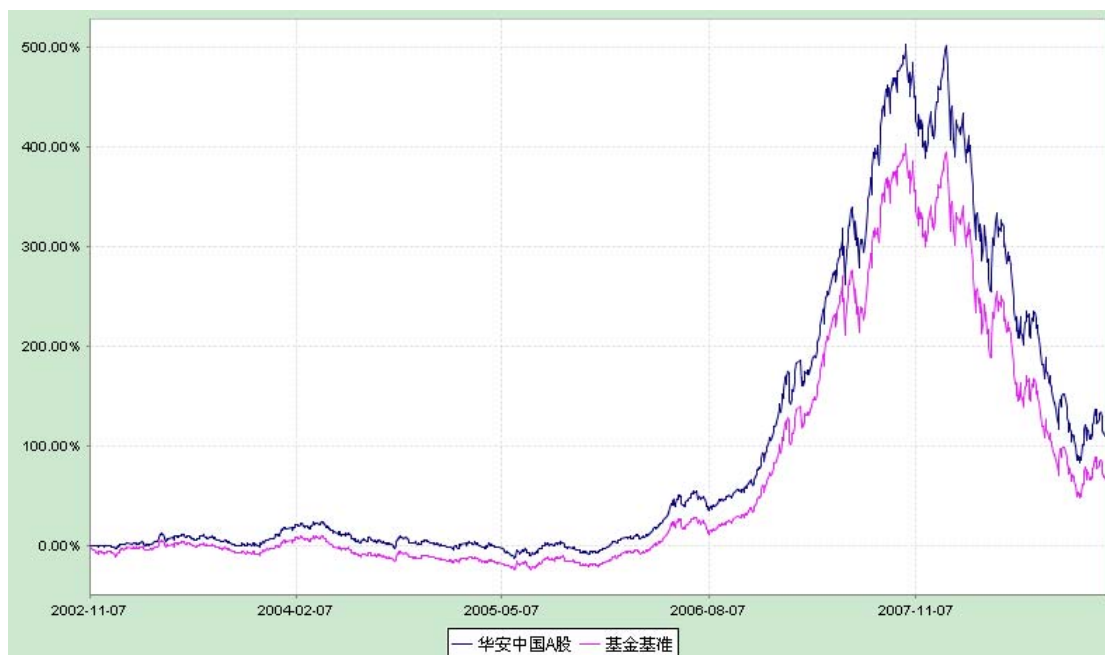
根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95%投资于股票，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。截至 2008 年 12 月 31 日，本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 93.81%，其中权证投资比例为 0.0334%。投资于债券和现金等固定收益类品种占基金净资产 5.85%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券占基金净资产为 2.7125%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

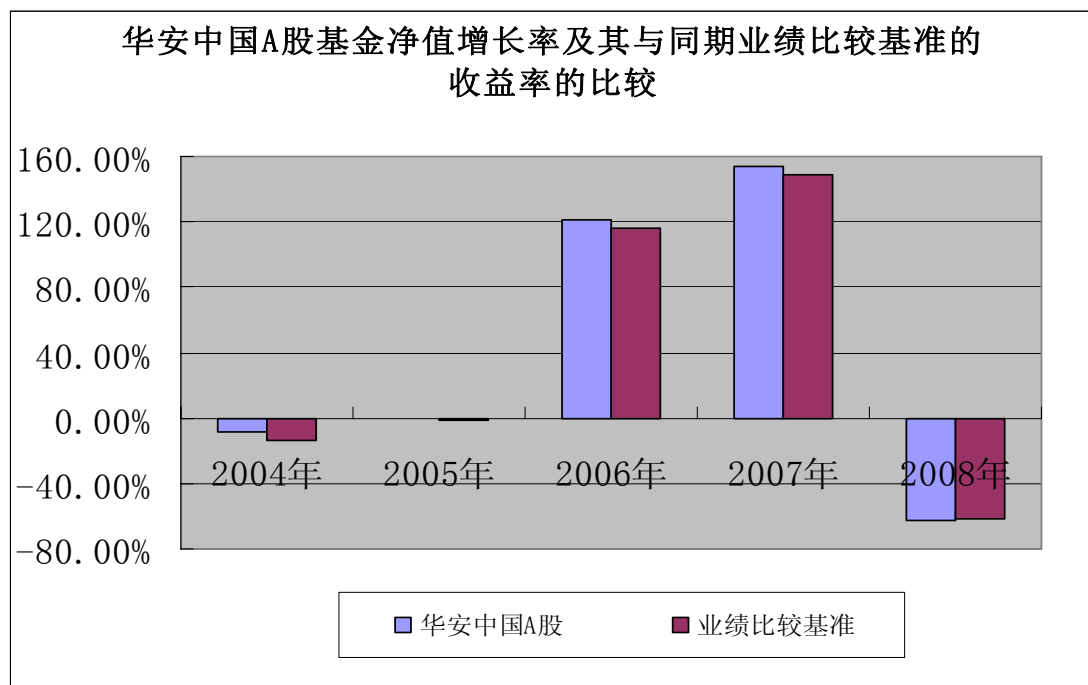
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2002 年 11 月 8 日至 2008 年 12 月 31 日）



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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基	现金形式发放	再投资形式发	年度利润分配合	备注
----	---------	--------	--------	---------	----

	金份额分 红数	总额	放总额	计	
2008 年	-	-	-	-	-
2007 年	2.000	62,442,687.18	88,310,408.85	150,753,096.03	-
2006 年	0.500	22,899,581.71	13,720,045.84	36,619,627.55	-
合计	2.500	85,342,268.89	102,030,454.69	187,372,723.58	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2008 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、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等 11 只开放式基金，管理资产规模达到 694.94 亿人民币、0.97 亿美元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘光华	本基金的基金经理	2005-5-25	2008-10-11	13 年	工商管理硕士，13 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 2008 年 10 月 11 日担任本基金的基金经理，2007 年 3 月起担任华安中小盘成长（原安瑞证券投资基金）基金经理。

许之彦	本基金的 基金经理、 金融工程 部负责人	2008-4-25	-	6 年	理学博士，6 年证券、基金从业经验。CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月起担任本基金的基金经理。
刘瓊	本基金的 基金经理	2008-4-25	-	8 年	管理学硕士，8 年证券从业经历。曾在交通银行工作，2001 年加入华安基金管理有限公司，历任市场部高级投资顾问、专户理财部客户主管、上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2007 年 3 月起担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2008 年 4 月起同时担任本基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易，公司《交易端基金间公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端基金间公平交易管理办法-银行间业务》以

及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

本报告期内 MSCI 中国 A 股指数下跌 64.69%，本基金比较基准下跌 61.41%，华安 MSCI 中国 A 基金下跌 62.45%，年度基金净值表现落后比较基准 1.04%，截至 2008 年 12 月 31 日，华安 MSCI 基金的跟踪偏离度为 0.1753%。

08 年，美国次贷危机逐步演化成全球经济危机，主要经济体逐步走向衰退，经济危机的程度远超预期。全球主要股票市场剧烈波动并呈现系统性大幅下跌。国内企业盈利能力面临巨大挑战，一方面，上半年企业付出了高额的原材料成本，部分企业积累了大量库存；另一方面，下半年国内外需求快速下降，库存较高的周期性行业以及出口相关度较高行业的盈利能力出现拐点。加上国内 A 股市场在 06-07 年大幅上涨后累积的估值风险，国内 A 股市场出现了大幅跌幅。

MSCI 中国 A 股基金在坚持有效跟踪指数的基础上，加强了仓位控制，以适度降低市场的系统风险。在 4 万亿经济刺激计划出台后，在操作上我们适度增强了与投资、基建等密切相关的行业，取得了一定的效果。不过，长江电力停牌带来的估值因素造成了基金落后基准 1.16%，“9.19”行情中的大额申购对基金也形成一定冲击。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

08 年以来，全球主要经济体陆续采取了前所未有的经济刺激政策，主要央行的基准利率几乎降低到了历史最低点，一方面体现了经济危机的程度可能是前所未有的，另一方面体现了主要经济体刺激经济的决心，这无疑对未来经济的恢复将会形成系统性的推动力。全球经济危机还可能持续蔓延，但由于政策的累积效应、企业去库存化的加快、资源和资金成本的降低，全球市场预期会逐步改变，市场信心也将逐步恢复。

国内经济所处的发展阶段决定了投资拉动经济增长的效应还会比较明显，内需有较大的提升空间，国内消费市场增长前景广阔，加上政府采取了强有力的刺激经济增长的措施和产业振兴方案，我们认为，国内经济有望逐步走出困境，我们依然对国内经济的增长前景充满信心。

对于 09 年的市场，尽管短期内还难以看到基本面明显改善，但随着去库存化的累积效应，加上适度的货币政策和宽松的财政政策，下半年企业盈利环比数据有望得到改善。我们认为，09 年市场整体上存在一定的机会。操作上，我们将坚持指数化投资理念，在有效跟踪拟合 MSCI 中国 A 指数和控制跟踪误差的前提下，及时把握市场波动的机会，增强符合国家能源政策的新能源行业、经济刺激计划的受益行业、出口依赖较低且持续受益于内需增长的行业等，通过一定程度的增强，在

有效拟合指数的基础上，争取为投资者获得一定的超越收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规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深化“主动合规”的管理理念，在完善公司合规政策的同时，颁布了公司《合规手册》，进一步明确了公司董事会、管理层、各部门的合规职责，细化了公司在业务运作、道德规范、反洗钱、利益冲突、客户信息保密、市场营销和客户投诉处理，投资和交易行为等环节的合规标准；

(2) 推行合规员制度，在各业务部门设立了部门合规员岗位，将合规控制、风险管理落实在业务第一线；

(3) 合规监察稽核部门经常性地组织员工进行法律法规的学习与培训，提高员工的合规意识；

(4) 组织投资、研究、交易等相关部门落实中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，开展基金交易价差分析，防范利益输送；

(5) 进一步完善投资交易系统控制功能，提高合规监察效率；

(6) 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。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化：

根据中国证监会 [2008] 年 38 号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，经与托管银行协商，自 2008 年 9 月 16 日起，对本基金的估值原则作如下调整：

(1) 估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停

牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

如有确凿证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实反映股票的公允价值，基金将与基金托管行协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响：

从 2008 年 9 月 16 日至 12 月 31 日，按照调整后的估值原则，本基金对持有的长期停牌的股票估值进行了调整，调整后对本基金的净值及本报告期损益产生的影响如下：

(1) 长江电力，影响本报告期损益-42,038,983.00 元，影响基金净值比例-1.16%；

(2) 盐湖钾肥，影响本报告期损益-168,800.00 元，影响基金净值比例-0.00%。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

(1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任基金安信的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

尚志民，基金投资部总经理，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理，现任基金安顺、华安宏利的基金经理，基金投资部总经理。

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

黄勤，固定收益部负责人，经济学硕士，12 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。

许之彦，金融工程部负责人，理学博士，曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股基金经理，金融工程部负责人。

朱永红，基金运营部总经理，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会

员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

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

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度：

本基金的基金经理作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突：

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息：

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期由于基金投资当期亏损，不进行收益分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2008 年，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2008 年，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2009)第 20104 号

华安 MSCI 中国 A 股指数增强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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数基金”)的财务报表，包括 2008 年 12 月 31 日的资产负债表、2008 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 MSCI 中国 A 股指数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 MSCI 中国 A 股指数基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 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

注册会计师
薛 竞

中国·上海市
2009 年 3 月 25 日

注册会计师
金 毅

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	113,788,300.35	236,558,224.18
结算备付金		4,967,149.32	5,400,322.55
存出保证金		1,063,506.47	909,192.84
交易性金融资产	7.4.7.2	3,501,309,826.34	6,146,472,250.98
其中：股票投资		3,402,919,826.34	5,921,604,704.98
基金投资		-	-
债券投资		98,390,000.00	224,867,546.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	1,213,172.35	538,709.32
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		36,671,883.36	412,066.15
应收利息	7.4.7.5	795,943.79	5,755,933.05
应收股利		-	-
应收申购款		9,329,630.21	43,166,105.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,669,139,412.19	6,439,212,804.74
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		23,396,735.82	12,168,138.62
应付赎回款		10,119,093.43	31,773,230.88
应付管理人报酬	7.4.10.2.1	3,287,087.66	4,900,531.16
应付托管费	7.4.10.2.2	657,417.52	980,106.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,734,804.26	2,493,956.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	628,000.00	800,000.00
负债合计		41,823,138.69	53,115,963.77
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,139,499,094.43	1,413,053,092.04
未分配利润	7.4.7.10	1,487,817,179.07	4,973,043,748.93
所有者权益合计		3,627,316,273.50	6,386,096,840.97
负债和所有者权益总计		3,669,139,412.19	6,439,212,804.74

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.517 元，基金份额总额 7,020,648,015.92 份。

后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

7.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2008年1月1日至2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年 12月31日
一、收入		-4,795,348,095.28	1,860,261,097.95
1. 利息收入		9,188,890.00	4,475,356.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	2,242,757.78	1,901,471.26
债券利息收入		6,946,132.22	2,573,884.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,352,856,454.63	652,553,737.84
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,404,414,736.30	630,542,137.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,392,485.81	1,430,491.53
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	495,588.54	4,207,637.72

股利收益	7.4.7.15	48,670,207.32	16,373,470.97
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-3,451,701,624.36	1,203,232,004.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	21,093.71	-
二、费用（以“-”号填列）		-89,351,980.67	-66,530,529.36
1、管理人报酬	7.4.10.2.1	-49,572,786.43	-30,288,335.00
2、托管费	7.4.10.2.2	-9,914,557.26	-6,057,667.05
3、销售服务费		-	-
4、交易费用	7.4.7.18	-28,442,966.82	-27,269,960.54
5、利息支出		-968,674.62	-2,495,146.19
其中：卖出回购金融资产支出		-968,674.62	-2,495,146.19
6、其他费用	7.4.7.19	-452,995.54	-419,420.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-4,884,700,075.95	1,793,730,568.59
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损“-”号填列）		-4,884,700,075.95	1,793,730,568.59

后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,413,053,092.04	4,973,043,748.93	6,386,096,840.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,884,700,075.95	-4,884,700,075.95
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	726,446,002.39	1,399,473,506.09	2,125,919,508.48
其中：1、基金申购款	3,011,392,958.86	5,359,351,301.06	8,370,744,259.92
2、基金赎回款(以“-”号填列)	-2,284,946,956.47	-3,959,877,794.97	-6,244,824,751.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-	-

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	2,139,499,094.43	1,487,817,179.07	3,627,316,273.50
	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	520,760,979.21	459,111,419.77	979,872,398.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,793,730,568.59	1,793,730,568.59
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	892,292,112.83	2,870,954,856.60	3,763,246,969.43
其中：1、基金申购款	2,531,617,679.97	6,947,976,237.01	9,479,593,916.98
2、基金赎回款（以“-”号填列）	-1,639,325,567.14	-4,077,021,380.41	-5,716,346,947.55
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-150,753,096.03	-150,753,096.03
五、期末所有者权益（基金净值）	1,413,053,092.04	4,973,043,748.93	6,386,096,840.97

后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

金，跟踪标的的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；此外，本基金可参与股票一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股，在成份股之外的股票投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率 $\times$ 95%+金融同业存款利率 $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2009 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2008 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 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(i) 金融资产的分类

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、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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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)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。除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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(ii) 金融负债的分类

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。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易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等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。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。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵消

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中列示。

7.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动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。

7.4.4.8 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损益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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 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。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见相关基金合同中的相关章节。

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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

1、计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

2、重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于特殊事项停牌股票，2008 年 9 月 16 日之前按停牌前最后交易日的收盘价估值；根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自 2008 年 9 月 16 日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自 2008 年 9 月 16 日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法，从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于 2008 年 9 月 16 日下调 64,076,159.61 元，相应调减本基金的净利润 64,076,159.61 元和基金资产净值 64,076,159.61 元。

7.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

7.4.6 税项

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

(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 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年

9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
活期存款	113,788,300.35	236,558,224.18
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	113,788,300.35	236,558,224.18

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2008 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		5,285,794,026.91	3,402,919,826.34	-1,882,874,200.57
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	97,493,200.00	98,390,000.00	896,800.00
	合计	97,493,200.00	98,390,000.00	896,800.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		5,383,287,226.91	3,502,522,998.69	-1,880,764,228.22
项目		上年度末 2007 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		4,351,123,937.72	5,921,604,704.98	1,570,480,767.26
债券	交易所市场	1,173,779.42	1,182,546.00	8,766.58
	银行间市场	223,302,626.44	223,685,000.00	382,373.56
	合计	224,476,405.86	224,867,546.00	391,140.14
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		4,575,600,343.58	6,146,472,250.98	1,570,871,907.40

注：1、于 2008 年 12 月 31 日，股票投资余额中包括按照指数收益法估值(附注 7.4.4.14)的特殊事项停牌相关股票 82,478,788.15 元(2007 年 12 月 31 日：无)。采用该估值技术的股票投资于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为 91,050,599.82 元(2007 年度：无)。

2、债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动收益为 514,426.44 元(2007 年度：公允价值变动收益

382,373.56 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注 (投资成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-无	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-无	-	-	-	-
权益衍生工具	-	1, 213, 172. 35	-	-
-权证		1, 213, 172. 35	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	1, 213, 172. 35	-	-
项目	上年度末 2007 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注 (投资成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
-无	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
-无	-	-	-	-
权益衍生工具	-	538, 709. 32	-	473, 220. 58
-权证	-	538, 709. 32	-	473, 220. 58
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	538, 709. 32	-	473, 220. 58

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2008 年 12 月 31 日）及比较报告期末（2007 年 12 月 31 日）买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2008 年 12 月 31 日）及比较报告期末（2007 年 12 月 31 日）买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	23,033.54	52,491.94
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	2,235.20	2,430.10
应收债券利息	762,904.11	5,673,800.09
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	7,770.94	27,210.92
其他	—	—
合计	795,943.79	5,755,933.05

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
其他应收款	—	—
待摊费用	—	—
合计	—	—

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,730,698.07	2,489,015.06
银行间市场应付交易费用	4,106.19	4,941.82
合计	3,734,804.26	2,493,956.88

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	—	—
预提费用	128,000.00	300,000.00
合计	628,000.00	800,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	
----	--

本期

	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1, 413, 053, 092. 04	1, 413, 053, 092. 04
本期申购	1, 023, 602, 147. 93	1, 023, 602, 147. 93
本期赎回	-685, 197, 382. 00	-685, 197, 382. 00
2008 年 4 月 29 日基金拆分/折算前	1, 751, 457, 857. 97	1, 751, 457, 857. 97
基金拆分/份额折算变动份额	3, 996, 488, 007. 87	-
本期申购	6, 522, 833, 301. 02	1, 987, 790, 810. 93
本期赎回	-5, 250, 131, 150. 94	-1, 599, 749, 574. 47
本期末	7, 020, 648, 015. 92	2, 139, 499, 094. 43

注：1、根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金的基金管理人华安基金管理有限公司确定 2008 年 4 月 29 日为本基金的基金份额拆分日。当日基金资产净值为 5,747,945,865.84 元，拆分前基金份额总额为 1,751,457,857.97 份，拆分前基金份额净值为 3.282 元。根据基金份额拆分公式，基金份额折算比例为 3.281806547，拆分后基金份额总额为 5,747,945,865.84 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。华安基金管理有限公司已根据上述拆分比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

2、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1, 886, 474, 494. 68	3, 086, 569, 254. 25	4, 973, 043, 748. 93
本期利润	-1, 432, 998, 451. 59	-3, 451, 701, 624. 36	-4, 884, 700, 075. 95
本期基金份额交易产生的变动数	904, 934, 783. 93	494, 538, 722. 16	1, 399, 473, 506. 09
其中：基金申购款	3, 564, 187, 844. 93	1, 795, 163, 456. 13	5, 359, 351, 301. 06
基金赎回款	-2, 659, 253, 061. 00	-1, 300, 624, 733. 97	-3, 959, 877, 794. 97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1, 358, 410, 827. 02	129, 406, 352. 05	1, 487, 817, 179. 07

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
活期存款利息收入	1, 854, 170. 15	1, 524, 742. 90
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	94, 387. 17	64, 449. 75

其他	294,200.46	312,278.61
合计	2,242,757.78	1,901,471.26

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,806,718,021.57	2,324,560,528.97
卖出股票成本总额	-6,211,132,757.87	-1,694,018,391.35
买卖股票差价收入	-1,404,414,736.30	630,542,137.62

注：本基金于本年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价（2007 年度：773.57 元）。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出债券及债券到期兑 付成交金额	882,209,666.58	203,496,737.24
卖出债券及债券到期兑 付成本总额	-864,435,610.70	-199,073,154.21
应收利息总额	-15,381,570.07	-2,993,091.50
债券投资收益	2,392,485.81	1,430,491.53

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出权证成交金额	6,808,484.28	4,762,434.61
卖出权证成本总额	-6,312,895.74	-554,796.89
买卖权证差价收入	495,588.54	4,207,637.72

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	48,670,207.32	16,373,470.97
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	48,670,207.32	16,373,470.97

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-3,452,849,307.97	1,203,166,515.28
——股票投资	-3,453,354,967.83	1,202,775,375.14
——债券投资	505,659.86	391,140.14
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	1,147,683.61	65,488.74
——权证投资	1,147,683.61	65,488.74
3. 其他	-	-
合计	-3,451,701,624.36	1,203,232,004.02

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
印花税手续费返还收入	21,093.71	-
合计	21,093.71	-

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	28,436,066.82	27,261,854.54
银行间市场交易费用	6,900.00	8,106.00
合计	28,442,966.82	27,269,960.54

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
审计费用	128,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	6,995.54	5,920.58
债券托管账户维护费	18,000.00	13,500.00
合计	452,995.54	419,420.58

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	49,572,786.43	30,288,335.00

其中：当期已支付	46,285,698.77	25,387,803.84
当期未支付	3,287,087.66	4,900,531.16

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.0% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	本期 2007 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	9,914,557.26	6,057,667.05
其中：当期已支付	9,257,139.74	5,077,560.82
当期未支付	657,417.52	980,106.23

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

单位：人民币元

本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	49,567,039.73	-	-	-	475,763,172.19	796,514.17

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期内（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间内（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日）均无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2008 年 12 月 31 日）和上年度末（2007 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	113,788,300.35	1,854,170.15	236,558,224.18	1,524,742.90

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间内（2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	利润分配 合计	备注
-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
600900	长江电力	2008-5-8	公告重大事项	7.35	未知	未知	6,005,569	91,537,110.29	44,140,932.15
600886	国投电力	2008-12-9	公告重大事项	9.13	2009-3-4	10.04	514,230	6,765,386.26	4,694,919.90
000625	长安汽车	2008-10-10	重大事项未披露	3.67	2009-2-16	4.04	666,232	7,376,999.19	2,445,071.44
000652	泰达股份	2008-12-30	公告重大事项	5.33	2009-1-20	5.28	547,400	3,501,990.40	2,917,642.00
000792	盐湖钾肥	2008-6-26	见备注	56.78	2008-12-26	78.23	675,200	38,900,574.83	38,337,856.00

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于 2008 年 12 月 31 日采用指数收益法估值。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板，当日的收盘价为每股 37.99 元。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止，本基金无债券正回购，因此无债券作为抵押。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数化增强性投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且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%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	113,788,300.35	-	-	-	113,788,300.35
结算备付金	4,967,149.32	-	-	-	4,967,149.32
存出保证金	-	-	-	1,063,506.47	1,063,506.47
交易性金融资产	98,390,000.00	-	-	3,402,919,826.34	3,501,309,826.34
衍生金融资产	-	-	-	1,213,172.35	1,213,172.35
应收证券清算款	-	-	-	36,671,883.36	36,671,883.36
应收利息	-	-	-	795,943.79	795,943.79
应收申购款	3,502,274.07	-	-	5,827,356.14	9,329,630.21
资产总计	220,647,723.74	-	-	3,448,491,688.45	3,669,139,412.19
负债					

应付证券清算款	-	-	-	23,396,735.82	23,396,735.82
应付赎回款	-	-	-	10,119,093.43	10,119,093.43
应付管理人报酬	-	-	-	3,287,087.66	3,287,087.66
应付托管费	-	-	-	657,417.52	657,417.52
应付交易费用	-	-	-	3,734,804.26	3,734,804.26
其他负债	-	-	-	628,000.00	628,000.00
负债总计	-	-	-	41,823,138.69	41,823,138.69
利率敏感度缺口	220,647,723.74	-	-	3,406,668,549.76	3,627,316,273.50
上年度末					
2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	236,558,224.18	-	-	-	236,558,224.18
结算备付金	5,400,322.55	-	-	-	5,400,322.55
存出保证金	-	-	-	909,192.84	909,192.84
交易性金融资产	223,685,000.00	-	1,182,546.00	5,921,604,704.98	6,146,472,250.98
衍生金融资产	-	-	-	538,709.32	538,709.32
应收证券清算款	-	-	-	412,066.15	412,066.15
应收利息	-	-	-	5,755,933.05	5,755,933.05
应收申购款	19,451,032.82	-	-	23,715,072.85	43,166,105.67
资产总计	485,094,579.55	-	1,182,546.00	5,952,935,679.19	6,439,212,804.74
负债					
应付证券清算款	-	-	-	12,168,138.62	12,168,138.62
应付赎回款	-	-	-	31,773,230.88	31,773,230.88
应付管理人报酬	-	-	-	4,900,531.16	4,900,531.16
应付托管费	-	-	-	980,106.23	980,106.23
应付交易费用	-	-	-	2,493,956.88	2,493,956.88
其他负债	-	-	-	800,000.00	800,000.00
负债总计	-	-	-	53,115,963.77	53,115,963.77
利率敏感度缺口	485,094,579.55	-	1,182,546.00	5,899,819,715.42	6,386,096,840.97

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2008 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净值的比例为 2.71%(2007 年 12 月 31 日：3.52%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。同时，本基金根据股票市场的具体情况，对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整以达到相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人

每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量,包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险,及时对风险进行跟踪和控制。

本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股,投资组合中股票投资的目标比例为基金资产净值的 95%,投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。于 2008 年 12 月 31 日,本基金面临的整体其他价格风险列示如下:

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日		上年度末 2007 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,402,919,826.34	93.81	5,921,604,704.98	92.73
衍生金融资产-权证投资	1,213,172.35	0.03	538,709.32	0.01
其他	-	-	-	-
合计	3,404,132,998.69	93.84	5,922,143,414.30	92.74

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币亿元)	
		本期末(2008 年 12 月 31 日)	上年度末(2007 年 12 月 31 日)
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 1.81	增加约 3.09
	2.业绩比较基准下降 5%	下降约 1.81	下降约 3.09

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,402,919,826.34	92.74
	其中: 股票	3,402,919,826.34	92.74

2	固定收益投资	98,390,000.00	2.68
	其中：债券	98,390,000.00	2.68
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	1,213,172.35	0.03
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	118,755,449.67	3.24
6	其他资产	47,860,963.83	1.30
7	合计	3,669,139,412.19	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产的净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,478,054.39	0.10
B	采掘业	376,784,156.86	10.39
C	制造业	1,031,486,534.09	28.44
C0	食品、饮料	137,125,024.74	3.78
C1	纺织、服装、皮毛	20,482,189.07	0.56
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	10,500,072.00	0.29
C4	石油、化学、塑胶、塑料	151,361,708.61	4.17
C5	电子	6,500,014.40	0.18
C6	金属、非金属	231,398,177.95	6.38
C7	机械、设备、仪表	345,485,801.38	9.52
C8	医药、生物制品	124,389,493.25	3.43
C99	其他制造业	4,244,052.69	0.12
D	电力、煤气及水的生产和供应业	128,172,659.74	3.53
E	建筑业	102,719,743.70	2.83
F	交通运输、仓储业	163,961,317.18	4.52
G	信息技术业	203,413,963.58	5.61
H	批发和零售贸易	118,461,542.33	3.27
I	金融、保险业	880,718,158.17	24.28
J	房地产业	237,379,294.40	6.54
K	社会服务业	19,601,982.39	0.54
L	传播与文化产业	9,619,315.52	0.27
M	综合类	79,013,532.25	2.18
	合计	3,354,810,254.60	92.49

8.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产的净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	7,075,000.00	0.20
C	制造业	25,850,982.33	0.71
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	23,354,416.80	0.64
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	2,496,565.53	0.07
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	844,272.00	0.02
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	14,339,317.41	0.40
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	48,109,571.74	1.33

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有指数股票投资和积极股票投资明细

8.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	13,789,630	167,681,900.80	4.62
2	600030	中信证券	8,809,607	158,308,637.79	4.36
3	000002	万科A	17,379,836	112,099,942.20	3.09
4	601328	交通银行	23,551,741	111,635,252.34	3.08
5	601088	中国神华	6,293,273	110,384,008.42	3.04
6	600000	浦发银行	8,107,479	107,424,096.75	2.96
7	600028	中国石化	10,970,171	77,010,600.42	2.12
8	600050	中国联通	15,249,508	76,705,025.24	2.11
9	601166	兴业银行	5,197,984	75,890,566.40	2.09
10	601939	建设银行	19,016,001	72,831,283.83	2.01
11	601318	中国平安	2,660,354	70,738,812.86	1.95
12	600005	武钢股份	13,820,393	66,061,478.54	1.82

13	000983	西山煤电	5,175,950	60,351,577.00	1.66
14	601857	中国石油	5,210,708	52,992,900.36	1.46
15	600048	保利地产	3,303,709	47,573,409.60	1.31
16	601628	中国人寿	2,511,981	46,848,445.65	1.29
17	600900	长江电力	6,005,569	44,140,932.15	1.22
18	002024	苏宁电器	2,413,636	43,228,220.76	1.19
19	600519	贵州茅台	368,044	40,006,382.80	1.10
20	600019	宝钢股份	8,330,973	38,655,714.72	1.07
21	601006	大秦铁路	4,805,650	38,541,313.00	1.06
22	000792	盐湖钾肥	675,200	38,337,856.00	1.06
23	600309	烟台万华	3,796,883	37,968,830.00	1.05
24	600588	用友软件	1,583,980	34,847,560.00	0.96
25	600196	复星医药	3,175,008	33,686,834.88	0.93
26	601186	中国铁建	3,106,227	31,186,519.08	0.86
27	000527	美的电器	3,468,195	28,716,654.60	0.79
28	600895	张江高科	2,866,185	28,633,188.15	0.79
29	600271	航天信息	1,060,276	26,729,557.96	0.74
30	000063	中兴通讯	981,134	26,686,844.80	0.74
31	601390	中国中铁	4,905,500	26,587,810.00	0.73
32	600015	华夏银行	3,596,856	26,149,143.12	0.72
33	600269	赣粤高速	3,265,647	25,472,046.60	0.70
34	000001	深发展 A	2,634,592	24,923,240.32	0.69
35	000422	湖北宜化	3,214,388	24,847,219.24	0.69
36	600089	特变电工	1,007,058	24,048,545.04	0.66
37	000425	徐工科技	1,494,516	23,239,723.80	0.64
38	600550	天威保变	1,113,747	22,464,276.99	0.62
39	000402	金融街	2,901,070	22,077,142.70	0.61
40	600820	隧道股份	1,990,734	21,699,000.60	0.60
41	000858	五粮液	1,574,845	21,008,432.30	0.58
42	000651	格力电器	1,079,977	20,994,752.88	0.58
43	600795	国电电力	3,673,563	20,461,745.91	0.56
44	000568	泸州老窖	1,088,738	19,815,031.60	0.55
45	600009	上海机场	1,663,225	18,744,545.75	0.52
46	600031	三一重工	1,312,049	18,381,806.49	0.51
47	000157	中联重科	1,631,303	18,237,967.54	0.50
48	600583	海油工程	1,185,711	18,058,378.53	0.50
49	600456	宝钛股份	1,551,136	17,651,927.68	0.49
50	000024	招商地产	1,312,870	17,224,854.40	0.47
51	600316	洪都航空	1,228,554	16,646,906.70	0.46
52	600547	山东黄金	324,043	15,735,528.08	0.43
53	000680	山推股份	2,064,830	15,651,411.40	0.43
54	002007	华兰生物	394,820	15,200,570.00	0.42
55	600016	民生银行	3,669,961	14,936,741.27	0.41
56	601333	广深铁路	3,950,000	14,654,500.00	0.40
57	600276	恒瑞医药	374,904	14,437,553.04	0.40
58	600320	振华港机	1,758,261	14,364,992.37	0.40
59	600832	东方明珠	2,064,234	14,098,718.22	0.39

60	600489	中金黄金	362,994	13,517,896.56	0.37
61	600383	金地集团	2,066,498	13,452,901.98	0.37
62	600066	宇通客车	1,494,198	13,447,782.00	0.37
63	600649	城投控股	1,567,427	12,915,598.48	0.36
64	600717	天津港	1,485,201	12,891,544.68	0.36
65	600177	雅戈尔	1,785,352	12,872,387.92	0.35
66	000768	西飞国际	1,006,189	12,567,300.61	0.35
67	000898	鞍钢股份	1,805,068	12,545,222.60	0.35
68	600026	中海发展	1,500,970	12,232,905.50	0.34
69	600011	华能国际	1,730,842	11,977,426.64	0.33
70	600415	小商品城	213,440	11,713,587.20	0.32
71	000423	东阿阿胶	857,140	11,571,390.00	0.32
72	000027	深圳能源	1,397,971	11,365,504.23	0.31
73	600169	太原重工	765,602	10,871,548.40	0.30
74	600737	中粮屯河	1,230,111	10,837,277.91	0.30
75	600100	同方股份	1,080,799	10,732,334.07	0.30
76	600881	亚泰集团	1,861,580	10,573,774.40	0.29
77	000060	中金岭南	1,338,280	10,438,584.00	0.29
78	600008	首创股份	2,374,958	10,426,065.62	0.29
79	600600	青岛啤酒	514,975	10,294,350.25	0.28
80	000839	中信国安	1,662,732	9,909,882.72	0.27
81	000869	张裕A	197,648	9,585,928.00	0.26
82	000541	佛山照明	1,637,418	9,578,895.30	0.26
83	600188	兖州煤业	1,122,345	9,248,122.80	0.26
84	600104	上海汽车	1,688,698	9,051,421.28	0.25
85	600517	置信电气	398,013	8,911,511.07	0.25
86	600808	马钢股份	2,743,820	8,862,538.60	0.24
87	000629	攀钢钢钒	963,950	8,849,061.00	0.24
88	600887	伊利股份	1,100,000	8,800,000.00	0.24
89	000825	太钢不锈	2,437,345	8,798,815.45	0.24
90	600879	火箭股份	1,000,000	8,670,000.00	0.24
91	600694	大商股份	471,457	8,467,367.72	0.23
92	600062	双鹤药业	346,370	8,344,053.30	0.23
93	600068	葛洲坝	931,312	8,232,798.08	0.23
94	600325	华发股份	859,068	7,989,332.40	0.22
95	600690	青岛海尔	887,199	7,975,919.01	0.22
96	600500	中化国际	996,909	7,765,921.11	0.21
97	600859	王府井	407,048	7,733,912.00	0.21
98	600655	豫园商城	759,737	7,536,591.04	0.21
99	600058	五矿发展	617,510	7,156,940.90	0.20
100	600267	海正药业	469,678	7,016,989.32	0.19
101	600428	中远航运	1,074,157	6,874,604.80	0.19
102	000729	燕京啤酒	519,812	6,866,716.52	0.19
103	600596	新安股份	211,270	6,621,201.80	0.18
104	601919	中国远洋	875,001	6,562,507.50	0.18
105	000800	一汽轿车	884,700	6,352,146.00	0.18
106	600312	平高电气	455,381	6,261,488.75	0.17

107	600631	百联股份	735,537	6,244,709.13	0.17
108	000401	冀东水泥	629,014	6,227,238.60	0.17
109	600628	新世界	908,300	6,194,606.00	0.17
110	600308	华泰股份	1,013,520	6,182,472.00	0.17
111	000539	粤电力 A	1,003,644	6,172,410.60	0.17
112	600161	天坛生物	420,000	6,098,400.00	0.17
113	000338	潍柴动力	331,261	5,956,072.78	0.16
114	000912	泸天化	747,050	5,946,518.00	0.16
115	600315	上海家化	207,270	5,809,778.10	0.16
116	000759	武汉中百	588,000	5,527,200.00	0.15
117	600010	包钢股份	2,165,600	5,500,624.00	0.15
118	600037	歌华有线	567,180	5,382,538.20	0.15
119	600797	浙大网新	1,683,482	5,370,307.58	0.15
120	000089	深圳机场	964,200	5,110,260.00	0.14
121	600352	浙江龙盛	807,618	5,087,993.40	0.14
122	600350	山东高速	1,003,000	4,864,550.00	0.13
123	600642	申能股份	808,328	4,841,884.72	0.13
124	600875	东方电气	161,281	4,807,786.61	0.13
125	000999	三九医药	325,000	4,696,250.00	0.13
126	600886	国投电力	514,230	4,694,919.90	0.13
127	600362	江西铜业	462,799	4,618,734.02	0.13
128	600170	上海建工	510,000	4,610,400.00	0.13
129	000528	柳工	477,958	4,521,482.68	0.12
130	000012	南玻 A	524,900	4,461,650.00	0.12
131	000698	沈阳化工	749,300	4,413,377.00	0.12
132	000031	中粮地产	918,760	4,410,048.00	0.12
133	600001	邯郸钢铁	1,343,615	4,366,748.75	0.12
134	600219	南山铝业	706,231	4,364,507.58	0.12
135	000488	晨鸣纸业	840,000	4,317,600.00	0.12
136	600535	天士力	348,649	4,312,788.13	0.12
137	600018	上港集团	1,300,000	4,303,000.00	0.12
138	000088	盐田港	903,000	4,298,280.00	0.12
139	600361	华联综超	695,509	4,284,335.44	0.12
140	600718	东软集团	361,487	4,240,242.51	0.12
141	000917	电广传媒	314,068	4,236,777.32	0.12
142	600635	大众公用	730,184	4,227,765.36	0.12
143	600970	中材国际	130,000	4,160,000.00	0.11
144	600085	同仁堂	336,313	4,140,013.03	0.11
145	600118	中国卫星	231,700	4,117,309.00	0.11
146	000039	中集集团	663,721	4,115,070.20	0.11
147	600770	综艺股份	604,295	4,103,163.05	0.11
148	000731	四川美丰	637,071	4,070,883.69	0.11
149	600348	国阳新能	410,000	3,989,300.00	0.11
150	600331	宏达股份	782,146	3,988,944.60	0.11
151	000876	新希望	620,000	3,937,000.00	0.11
152	000951	中国重汽	307,768	3,914,808.96	0.11
153	600780	通宝能源	1,115,075	3,902,762.50	0.11

154	600256	广汇股份	421,000	3,839,520.00	0.11
155	600685	广船国际	309,906	3,814,942.86	0.11
156	600123	兰花科创	318,891	3,797,991.81	0.10
157	600033	福建高速	749,250	3,663,832.50	0.10
158	600004	白云机场	513,900	3,622,995.00	0.10
159	600153	建发股份	557,338	3,555,816.44	0.10
160	600812	华北制药	584,566	3,548,315.62	0.10
161	600598	北大荒	324,143	3,478,054.39	0.10
162	000726	鲁 泰 A	558,960	3,432,014.40	0.09
163	600027	华电国际	884,423	3,378,495.86	0.09
164	600528	中铁二局	410,000	3,357,900.00	0.09
165	600643	爱建股份	596,092	3,350,037.04	0.09
166	600688	S 上石化	582,000	3,218,460.00	0.09
167	600811	东方集团	778,878	3,185,611.02	0.09
168	600521	华海药业	260,391	3,166,354.56	0.09
169	600739	辽宁成大	259,257	3,152,565.12	0.09
170	600138	中青旅	398,223	3,046,405.95	0.08
171	600660	福耀玻璃	772,452	3,004,838.28	0.08
172	000652	泰达股份	547,400	2,917,642.00	0.08
173	600997	开滦股份	241,961	2,794,649.55	0.08
174	600581	八一钢铁	558,532	2,781,489.36	0.08
175	000559	万向钱潮	868,500	2,683,665.00	0.07
176	600582	天地科技	194,994	2,667,517.92	0.07
177	600761	安徽合力	387,801	2,664,192.87	0.07
178	000933	神火股份	203,094	2,660,531.40	0.07
179	600357	承德钒钛	576,089	2,632,726.73	0.07
180	600839	四川长虹	812,000	2,614,640.00	0.07
181	600143	金发科技	565,326	2,600,499.60	0.07
182	000895	双汇发展	73,841	2,546,037.68	0.07
183	000623	吉林敖东	131,353	2,453,674.04	0.07
184	000625	长安汽车	666,232	2,445,071.44	0.07
185	000538	云南白药	70,213	2,416,029.33	0.07
186	000707	双环科技	453,986	2,397,046.08	0.07
187	600299	蓝星新材	323,050	2,371,187.00	0.07
188	600098	广州控股	500,000	2,370,000.00	0.07
189	600675	中华企业	386,384	2,179,205.76	0.06
190	000758	中色股份	318,579	2,102,621.40	0.06
191	600067	冠城大通	507,939	2,036,835.39	0.06
192	600022	济南钢铁	454,710	2,018,912.40	0.06
193	600249	两面针	428,850	2,015,595.00	0.06
194	000400	许继电气	152,300	2,001,222.00	0.06
195	600183	生益科技	429,100	1,986,733.00	0.05
196	600616	金枫酒业	179,070	1,912,467.60	0.05
197	000410	沈阳机床	392,232	1,890,558.24	0.05
198	601168	西部矿业	297,125	1,868,916.25	0.05
199	600064	南京高科	200,000	1,866,000.00	0.05
200	600220	江苏阳光	495,975	1,849,986.75	0.05

201	000036	华联控股	920,000	1,830,800.00	0.05
202	000778	新兴铸管	325,248	1,824,641.28	0.05
203	600755	厦门国贸	200,000	1,724,000.00	0.05
204	000501	鄂武商 A	341,100	1,712,322.00	0.05
205	600602	广电电子	718,960	1,682,366.40	0.05
206	600849	上海医药	230,730	1,661,256.00	0.05
207	600779	水井坊	145,400	1,628,480.00	0.04
208	600601	方正科技	616,174	1,626,699.36	0.04
209	600418	江淮汽车	550,000	1,606,000.00	0.04
210	600508	上海能源	181,568	1,586,904.32	0.04
211	000677	山东海龙	580,000	1,571,800.00	0.04
212	000581	威孚高科	310,790	1,553,950.00	0.04
213	600406	国电南瑞	76,106	1,551,801.34	0.04
214	600210	紫江企业	501,485	1,519,499.55	0.04
215	600006	东风汽车	500,000	1,465,000.00	0.04
216	000937	金牛能源	100,000	1,400,000.00	0.04
217	000932	华菱钢铁	300,000	1,371,000.00	0.04
218	600307	酒钢宏兴	293,488	1,364,719.20	0.04
219	600663	陆家嘴	100,000	1,328,000.00	0.04
220	000900	现代投资	112,100	1,318,296.00	0.04
221	600497	驰宏锌锗	131,600	1,304,156.00	0.04
222	600132	重庆啤酒	98,728	1,289,387.68	0.04
223	000690	宝新能源	204,459	1,277,868.75	0.04
224	600020	中原高速	468,510	1,241,551.50	0.03
225	000518	四环生物	566,600	1,229,522.00	0.03
226	600835	上海机电	152,308	1,227,602.48	0.03
227	600569	安阳钢铁	395,379	1,194,044.58	0.03
228	000046	泛海建设	200,000	1,170,000.00	0.03
229	600584	长电科技	400,000	1,156,000.00	0.03
230	600150	中国船舶	30,000	1,147,200.00	0.03
231	000878	云南铜业	134,317	1,074,536.00	0.03
232	000630	铜陵有色	160,000	1,064,000.00	0.03
233	000659	珠海中富	236,200	987,316.00	0.03
234	600651	飞乐音响	220,000	972,400.00	0.03
235	000987	广州友谊	90,000	952,200.00	0.03
236	000822	山东海化	193,469	947,998.10	0.03
237	600585	海螺水泥	35,941	931,950.13	0.03
238	000897	津滨发展	300,000	921,000.00	0.03
239	000793	华闻传媒	300,000	915,000.00	0.03
240	600270	外运发展	154,032	905,708.16	0.03
241	600282	南钢股份	310,270	902,885.70	0.02
242	000682	东方电子	346,100	896,399.00	0.02
243	000751	锌业股份	298,448	814,763.04	0.02
244	000807	云铝股份	180,096	810,432.00	0.02
245	000061	农产品	50,429	801,821.10	0.02
246	601588	北辰实业	282,600	794,106.00	0.02
247	600266	北京城建	111,654	782,694.54	0.02

248	600747	大连控股	264,800	773,216.00	0.02
249	000969	安泰科技	66,946	708,958.14	0.02
250	600549	厦门钨业	91,000	702,520.00	0.02
251	600863	内蒙华电	243,000	673,110.00	0.02
252	600102	莱钢股份	111,679	651,088.57	0.02
253	600748	上实发展	100,000	611,000.00	0.02
254	600823	世茂股份	90,838	610,431.36	0.02
255	600029	南方航空	189,901	605,784.19	0.02
256	000503	海虹控股	138,413	588,255.25	0.02
257	000709	唐钢股份	154,560	570,326.40	0.02
258	000612	焦作万方	75,627	559,639.80	0.02
259	000970	中科三环	137,700	510,867.00	0.01
260	000554	泰山石油	117,909	510,545.97	0.01
261	600597	光明乳业	120,000	510,000.00	0.01
262	600884	杉杉股份	100,000	497,000.00	0.01
263	600072	中船股份	43,556	438,608.92	0.01
264	600432	吉恩镍业	41,914	413,691.18	0.01
265	600380	健康元	90,000	409,500.00	0.01
266	000959	首钢股份	120,000	345,600.00	0.01
267	000069	华侨城 A	42,049	343,960.82	0.01
268	000717	韶钢松山	100,000	312,000.00	0.01
269	000636	风华高科	99,200	273,792.00	0.01
270	600151	航天机电	50,000	221,500.00	0.01
271	600740	山西焦化	40,000	174,800.00	0.00
272	600639	浦东金桥	20,000	153,400.00	0.00
273	000762	西藏矿业	10,824	82,695.36	0.00
274	000960	锡业股份	2,499	23,590.56	0.00
275	000009	中国宝安	520	2,069.60	0.00

8.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002008	大族激光	3,992,208	23,354,416.80	0.64
2	601169	北京银行	1,609,351	14,339,317.41	0.40
3	601899	紫金矿业	800,000	3,840,000.00	0.11
4	601898	中煤能源	500,000	3,235,000.00	0.09
5	002152	广电运通	84,429	2,496,565.53	0.07
6	600536	中国软件	93,600	844,272.00	0.02

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	285,037,189.56	4.46

2	600000	浦发银行	283,467,637.03	4.44
3	601318	中国平安	251,613,831.65	3.94
4	600030	中信证券	211,753,000.65	3.32
5	601328	交通银行	192,364,320.80	3.01
6	600005	武钢股份	191,382,458.84	3.00
7	601088	中国神华	157,665,987.71	2.47
8	000063	中兴通讯	157,364,851.04	2.46
9	600028	中国石化	140,768,223.91	2.20
10	000002	万科A	137,461,914.08	2.15
11	000983	西山煤电	136,622,980.82	2.14
12	601919	中国远洋	134,172,275.35	2.10
13	000001	深发展A	131,991,896.70	2.07
14	601939	建设银行	127,413,415.74	2.00
15	000422	湖北宣化	125,932,978.61	1.97
16	600019	宝钢股份	115,347,818.61	1.81
17	600050	中国联通	109,776,260.73	1.72
18	601166	兴业银行	109,068,010.37	1.71
19	601006	大秦铁路	104,751,422.12	1.64
20	600048	保利地产	98,518,596.87	1.54

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600000	浦发银行	204,152,421.64	3.20
2	000063	中兴通讯	157,848,614.68	2.47
3	601318	中国平安	144,821,917.45	2.27
4	600036	招商银行	143,480,691.47	2.25
5	600030	中信证券	123,228,933.47	1.93
6	600016	民生银行	108,256,103.25	1.70
7	601166	兴业银行	104,285,805.32	1.63
8	600028	中国石化	96,663,440.00	1.51
9	600383	金地集团	96,644,331.07	1.51
10	000422	湖北宣化	90,563,514.85	1.42
11	600005	武钢股份	83,418,318.20	1.31
12	600015	华夏银行	81,316,975.39	1.27
13	600019	宝钢股份	76,759,164.65	1.20
14	601919	中国远洋	75,742,405.12	1.19
15	600489	中金黄金	75,443,638.78	1.18
16	600550	天威保变	73,021,193.60	1.14
17	000538	云南白药	72,153,126.91	1.13
18	000001	深发展A	72,050,842.30	1.13
19	000002	万科A	66,853,056.71	1.05
20	600048	保利地产	65,661,884.07	1.03

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额：	7,145,802,847.06
卖出股票的收入（成交）总额：	4,806,718,021.57

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	98,390,000.00	2.71
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	98,390,000.00	2.71

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	0801112	08央票112	1,000,000	98,390,000.00	2.71
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

序号	权证代码	权证名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产的净值比例（%）
1	031007	阿胶EJC1	139,285	1,213,172.35	0.03
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

8.9 投资组合报告附注

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

8.9.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,063,506.47
2	应收证券清算款	36,671,883.36
3	应收股利	—
4	应收利息	795,943.79
5	应收申购款	9,329,630.21
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	47,860,963.83

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前指数投资或积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资或积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
243,634	28,816.37	1,726,000,237.04	24.58%	5,294,647,778.88	75.42%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项 目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有 本开放式基金	1,052,455.56	0.015%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2002 年 11 月 8 日）基金份额总额	3,094,001,262.00
报告期期初基金份额总额	1,413,053,092.04
报告期期间基金总申购份额	7,546,435,448.95
报告期期间基金总赎回份额	5,935,328,532.94
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	3,996,488,007.87
报告期期末基金份额总额	7,020,648,015.92

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

(2). 2009 年 1 月 12 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(3). 2009 年 2 月 19 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

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

(5). 2008 年 10 月 11 日，本基金管理人发布关于调整基金经理的公告，刘光华先生不再担任华安 MSCI 中国 A 股指数型证券投资基金的基金经理，许之彦、刘璎女士继续担任该基金的基金经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 128,000.00 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况：

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	791,019,940.72	6.70%	672,365.06	6.78%	
招商证券股份有限公司	1	1,227,553,006.66	10.40%	997,392.90	10.06%	
广发证券股份有限公司	1	2,024,589,084.22	17.15%	1,644,986.31	16.60%	
中信建投证券有限责任公司	1	2,461,288,604.82	20.85%	2,092,090.78	21.11%	
国泰君安证券股份有限公司	1	2,144,731,002.03	18.17%	1,823,018.48	18.40%	
宏源证券股份有限公司	1	—	—	—	—	
中国银河证券股份有限公司	1	3,152,890,476.24	26.71%	2,679,947.28	27.04%	

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		权证交易		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	638,580.00	2.80%	—	—	—
招商证券股份有限公司	1	649,437.60	2.85%	—	—	—
广发证券股份有限公司	1	770,853.30	3.38%	—	—	—
中信建投证券有限责任公司	1	5,948,063.60	26.07%	2,597,153.88	38.15%	—
国泰君安证券股份有限公司	1	12,500,521.70	54.79%	4,211,330.40	61.85%	—
宏源证券股份有限公司	1	—	—	—	—	—
中国银河证券股份有限公司	1	2,306,226.00	10.11%	—	—	—

注：1、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

退租国金证券有限责任公司上海交易单元1个。

2、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元使用协议》，并通知基金托管人。

11.8 其他重大事件：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于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	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-15
2	关于参加中国光大银行基金定投优惠推广活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-18
3	关于参加建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-25
4	关于参加建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-28

5	关于新增安信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-31
6	关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-2-25
7	关于新增中原证券股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-3-3
8	关于参加上海银行基金定期定额申购业务优惠推广活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-3-12
9	关于新增深圳平安银行为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-3-21
10	关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-3-24
11	关于新增华安证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-3-24
12	关于新增华泰证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-3-24
13	关于新增东莞证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-4-11
14	关于新增平安证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-4-17
15	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-4-26
16	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-4-28
17	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续销售活动及修改基金合同的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网	2008-4-29

		站	
18	关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-5-5
19	关于新增广东发展银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-5-5
20	关于参加民生银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-5-8
21	关于参加北京银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-3
22	关于开通北京银行定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-3
23	关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-3
24	关于参加交通银行基金定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-12
25	关于网上交易系统开通招商银行网上直销业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-17
26	关于新增广州证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-25
27	关于参加中信银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-26
28	关于新增瑞银证券有限责任公司为开放式基金代销机构及参加瑞银证券有限责任公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-6-27
29	关于参加中信银行网上银行基金申购费率优惠活动的更正公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-1
30	关于新增中国银行股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中	2008-7-1

		国证券报》和公司网站	
31	关于在中国民生银行股份有限公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-10
32	关于新增中银国际证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-21
33	关于参加广州证券有限责任公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-22
34	关于参加长江证券股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-25
35	关于新增中山证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-25
36	关于参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动与定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-8-1
37	关于新增齐鲁证券有限公司为开放式基金代销机构及参加齐鲁证券有限公司网上交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-8-13
38	关于推出手机基金交易/查询业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-1
39	关于暂停参加齐鲁证券有限公司网上交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-3
40	关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-16
41	关于新增国联证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-8
42	关于新增西部证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-17
43	关于旗下基金执行《关于进一步规范证券投资	《上海证券报》、	2008-9-17

	资基金估值业务的指导意见》对基金净值影响的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
44	关于参加齐鲁证券有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-25
45	关于新增东北证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-10-6
46	关于新增国元证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-10-15
47	关于参加光大证券股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-10-27
48	关于在广东发展银行开通旗下基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-11-3
49	关于新增华龙证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-11-17
50	关于新增中国建银投资证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-11-25
51	关于新增山西证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-3
52	关于旗下部分基金开通基金定期定额投资业务后端收费模式和调整赎回适用持有期的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-10
53	关于参加深圳平安银行股份有限公司网上申购费率优惠活动和定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-13
54	关于新增红塔证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-18
55	关于旗下基金对盐湖钾肥继续采用指数收益法进行估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-27

56	关于参加中国工商银行基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-30
57	关于参加中国建设银行定期定额申购长期费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-31
58	关于在中国邮政储蓄银行有限责任公司延长定期定额投资优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-31
59	关于恢复旗下基金持有的“盐湖钾肥”股票进行市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-6
60	关于参加深圳发展银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-9
61	关于新增东海证券为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-9
62	关于参加中国光大银行基金定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-20
63	关于基金电子直销推出中国农业银行金穗卡持有人定期定额申购业务及相关交易费率调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-21
64	关于新增江南证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-21
65	关于新增上海农村商业银行开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-2-5
66	关于提请投资者及时更新身份证明文件的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-2-14
67	关于参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-2-25
68	关于参加中国工商银行股份有限公司基智定投业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网	2009-2-26

		站	
69	关于新增恒泰证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-3-12
70	关于参加江海证券经纪有限责任公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-3-13
71	关于新增江海证券经纪有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-3-13
72	关于新增兴业银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-3-18
73	关于参加兴业银行股份有限公司电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-3-18
74	关于新增国盛证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-3-24

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

§ 12 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 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
2009 年 3 月 26 日