

华安宏利股票型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 3 月 23 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	36
8.1 期末基金资产组合情况	36
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股票投资明细	37
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	41
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	41
8.9 投资组合报告附注	41
§ 9 基金份额持有人信息	42
§ 10 开放式基金份额变动	42
§ 11 重大事件揭示	42
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 13 备查文件目录	53

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安宏利股票型证券投资基金	
基金简称	华安宏利	
交易代码	040005(前端)	041005(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 9 月 6 日	
报告期末基金份额总额	4,908,200,581.65	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益，以及分红所带来的红利收益，实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准 = 中信标普 300 指数收益率 × 90% + 同业存款利率 × 10%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的稳定增值。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）
信息披露负责人	姓名	冯颖	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	fengying@huan.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		40088-50099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833
注册地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东南路 360 号新	北京市西城区闹市口大

	上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼	街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100140
法定代表人	俞妙根	郭树清

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 9 月 6 日-2006 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,715,666,282.19	5,326,140,112.38	198,999,915.59
本期利润	-9,395,389,976.74	8,206,673,812.37	659,838,721.04
加权平均基金份额本期利润	-1.6151	1.9197	0.3929
本期加权平均净值利润率	-70.97%	72.56%	34.89%
本期基金份额净值增长率	-48.39%	166.25%	39.76%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年 9 月 6 日-2006 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	1,364,600,066.75	4,853,453,148.26	193,620,677.62
期末可供分配基金份额利润	0.2780	0.9267	0.1182
期末基金资产净值	8,048,764,980.44	16,640,603,735.18	2,289,236,064.30
期末基金份额净值	1.6399	3.1774	1.3976
3.1.3 累计期末指标	2008 年	2007 年	2006 年 9 月 6 日-2006 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	92.05%	272.11%	39.76%

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）。

4、本基金于 2006 年 9 月 6 日成立，合同生效日当年不满一个完整的报告期。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-11.29%	2.09%	-16.10%	2.70%	4.81%	-0.61%
过去六个月	-23.29%	1.95%	-30.70%	2.66%	7.41%	-0.71%
过去一年	-48.39%	2.05%	-58.12%	2.70%	9.73%	-0.65%
自基金合同生效起至今	92.05%	2.00%	35.02%	2.30%	57.03%	-0.30%

注：本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%。

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5%以上。

截至 2008 年 12 月 31 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 79.46%，债券的投资比例为基金资产净值的 15.78%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 21.75%。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

华安宏利股票型证券投资基金

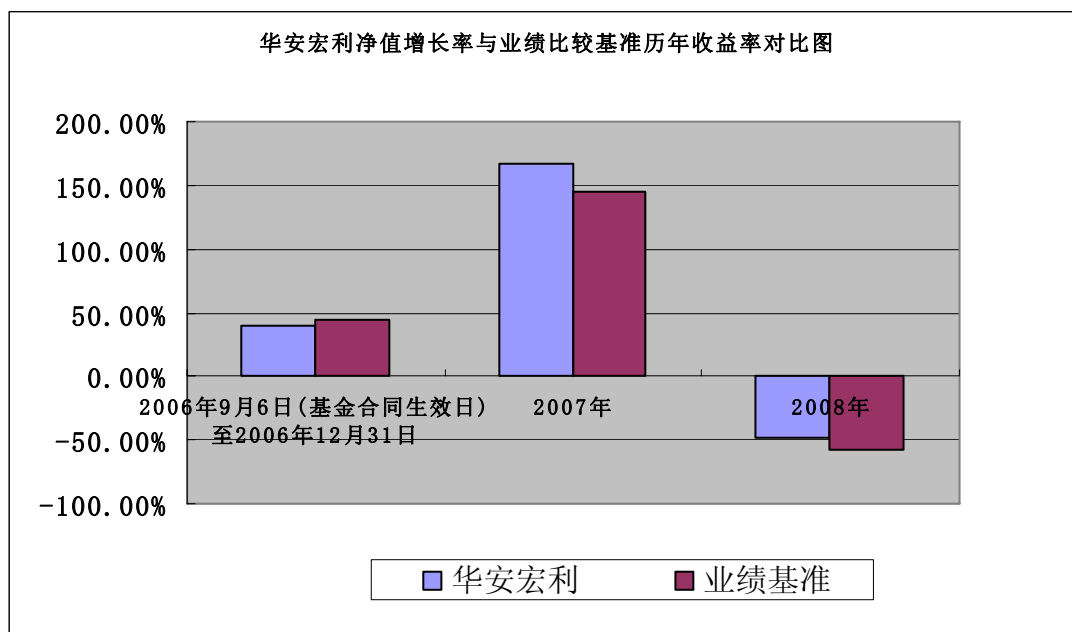
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2006 年 9 月 6 日至 2008 年 12 月 31 日）



注：1、根据《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》规定，本基金自基金合同生效日起6个月内基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分（二）投资范围、（七）投资限制的有关规定。

3.2.3 自合同生效以来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



注：合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年	—	—	—	—	—
2007年	3.900	664,248,544.64	1,013,706,377.25	1,677,954,921.89	—

2006年9月6日 (基金合同生效日)至2006 年12月31日	-	-	-	-	-
合计	3.900	664,248,544.64	1,013,706,377.25	1,677,954,921.89	-

§ 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		
尚志民	本基金的 基金经理 基金投资 部总经理	2006 年 9 月 6 日	-	12 年	工商管理硕士，12 年证券、基金从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任基金安顺的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月同时担任基金安瑞的基金经理，2001 年 9 月至 2003 年 9 月担任华安创新的基金经理，2003 年 9 月至今担任基金安顺的基金经理，2006 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。
陈俏宇	本基金的	2007 年 3	2008 年 2 月 13	13 年	工商管理硕士，中国注册

	基金经理	月 14 日	日		会计师事务所非执业会员，13 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、基金安顺和华安宏利基金经理助理，2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任本基金与基金安顺的基金经理，2008 年 2 月起担任基金安信的基金经理，2008 年 10 月 22 日起同时兼任华安核心基金的基金经理。
汪光成	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	-	7 年	管理学博士，持有基金从业资格证书，7 年证券、基金行业从业经历，2002 年 1 月加入华安基金管理有限公司后，曾先后在战略策划部、研究发展部工作，从事数量分析和行业研究工作。2008 年 2 月起担任基金安顺和本基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

按照华安宏利与华安核心的基金合同，华安宏利基金和华安核心都属于价值型基金，但由于华安核心基金成立于 2008 年 10 月 22 日，目前仍在建仓期内，因此其业绩与华安宏利基金没有可比性。

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

2008 年，美国次贷危机爆发引起全球金融体系与实体经济剧烈动荡，各国股市大幅下跌。中国经济虽然相对健康，但在全球化的背景下，也无法脱钩，在上半年过热与通货膨胀担忧之后，下半年形势急转直下，企业盈利增长速度大幅下降，某些行业甚至出现久违的全行业亏损现象。作为经济先行指标的股市，2008 年单边下跌，上证指数下跌 65.39%，深圳成指下跌 63.36%，创我国证券市场创建以来的年度跌幅记录。

报告期内，基于对经济的谨慎预期，本基金较早降低股票仓位，并在大部分时间将仓位维持在较低水平。在组合策略方面，更多采取自上而下的选股策略，侧重防御性。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为应对百年一遇的金融危机，各国政府都出台了大量的经济刺激政策。中国政府于 2008 年 11 月份出台了 4 万亿的投资计划，2009 年一季度，包括 10 大产业振兴计划在内的经济刺激政策陆续出台。与此同时，政府通过降低利率、降低存款准备金率等一系列措施来增加实体经济中的流动性。金融危机对我国经济的第一冲击波在 08 年四季度达到一个顶峰，之后国内生产逐步恢复正常。展望 2009 年，世界经济仍处于不确定中。首先，作为金融风暴起源的美国能否于 09 年下半年走出负增长仍不确定，而受次贷危机影响的欧洲等地区受损程度甚至超过美国，此次危机是一场全球性的金融危机，我们需要充分认识其破坏力。其次，中国 GDP 的 40% 依赖出口，外需减弱势必影响中国经济发展。但是，危机之中，我们也看到各国政府的救助措施力度之大前所未有，危中蕴藏机遇，各国经历此次危机之后，经济增长结构将会发生重大变化，一些行业的地位将大幅提高，一些公司将在危机中通过优胜劣汰成长为新的龙头，这都将为证券市场带来新的活力，从而使得 09 年的市场机会远远多于 08 年。

操作策略上，本基金将继续强调估值管理和组合的流动性，在行业和个股配置方面保持相对分散，重点关注政策刺激受益、经济结构性调整受益公司，构建部分主题投资组合。同时，在大类资产配置比例方面将采取相对灵活的策略，不断优化组合结构，控制组合整体风险，力求基金净值的稳定可持续增长。

感谢宏利的持有人在过去的艰难一年中对我们的信任与支持，我们将勤勉尽职，力争为投资人创造较好的回报。

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 -127,330,000.00 元，影响基金净值比例 -1.58%；

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公司，曾任基金安信的基金经理、华安华安 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公司，曾任固定收益

部债券投资经理，现任华安福利基金的基金经理、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等复核和核查的责任。

(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

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2009)第 20108 号

华安宏利股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安宏利股票型证券投资基金(以下简称“华安宏利基金”)的财务报表，包括 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宏利基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

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

二、注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华安宏利基金 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
注册会计师
金 毅

中国·上海市
2009 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安宏利股票型证券投资基金
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	588,516,531.02	1,616,860,530.71
结算备付金		8,096,042.80	15,642,066.11
存出保证金		249,669.89	4,983,574.06
交易性金融资产	7.4.7.2	7,665,639,744.09	15,255,320,879.00
其中：股票投资		6,395,659,744.09	14,384,462,879.00
基金投资		-	-
债券投资		1,269,980,000.00	870,858,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	7,504,572.29
应收利息	7.4.7.5	23,059,538.15	12,699,620.13
应收股利		-	-
应收申购款		45,985,438.84	91,788,017.10
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,331,546,964.79	17,004,799,259.40
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		250,376,240.52	283,308,023.85
应付赎回款		13,011,933.30	48,799,224.43

应付管理人报酬	7.4.10.2.1	10,623,427.49	19,378,560.78
应付托管费	7.4.10.2.2	1,770,571.25	3,229,760.12
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,314,319.91	8,504,225.87
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	685,491.88	975,729.17
负债合计		282,781,984.35	364,195,524.22
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,908,200,581.65	5,237,124,136.00
未分配利润	7.4.7.10	3,140,564,398.79	11,403,479,599.18
所有者权益合计		8,048,764,980.44	16,640,603,735.18
负债和所有者权益总计		8,331,546,964.79	17,004,799,259.40

注：1、报告截止日2008年12月31日，基金份额净值1.6399元，基金份额总额4,908,200,581.65份。

2、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：华安宏利股票型证券投资基金

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		-9,043,917,577.40	8,559,160,778.04
1. 利息收入		75,379,505.72	23,317,407.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	21,257,790.35	8,256,497.17
债券利息收入		52,080,906.02	15,060,910.79
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,040,809.35	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,448,024,999.64	5,637,184,599.26
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-3,539,350,898.49	5,553,764,149.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	5,915,572.14	4,732,581.71
资产支持证券投		-	-

资收益			
衍生工具收益	7.4.7.14	1,942,480.59	21,975,421.86
股利收益	7.4.7.15	83,467,846.12	56,712,446.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-5,679,723,694.55	2,880,533,699.99
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	8,451,611.07	18,125,070.83
二、费用（以“-”号填列）		-351,472,399.34	-352,486,965.67
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	-200,114,966.70	-167,216,034.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	-33,352,494.52	-27,869,339.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	-114,308,348.11	-150,198,408.72
5. 利息支出		-3,158,361.17	-6,720,928.37
其中：卖出回购金融资产支出		-3,158,361.17	-6,720,928.37
6. 其他费用	7.4.7.19	-538,228.84	-482,255.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,395,389,976.74	8,206,673,812.37
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,395,389,976.74	8,206,673,812.37

注：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：华安宏利股票型证券投资基金

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	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）	5,237,124,136.00	11,403,479,599.18	16,640,603,735.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,395,389,976.74	-9,395,389,976.74

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）	-328,923,554.35	1,132,474,776.35	803,551,222.00
其中：1. 基金申购款	3,265,039,694.28	5,554,050,039.82	8,819,089,734.10
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-3,593,963,248.63	-4,421,575,263.47	-8,015,538,512.10
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）	4,908,200,581.65	3,140,564,398.79	8,048,764,980.44
项目	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）	1,637,980,896.86	651,255,167.44	2,289,236,064.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	8,206,673,812.37	8,206,673,812.37
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）	3,599,143,239.14	4,223,505,541.26	7,822,648,780.40
其中：1. 基金申购款	9,626,863,694.96	12,789,153,072.57	22,416,016,767.53
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-6,027,720,455.82	-8,565,647,531.31	-14,593,367,987.13
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）	-	-1,677,954,921.89	-1,677,954,921.89
五、期末所有者权益（基金净值）	5,237,124,136.00	11,403,479,599.18	16,640,603,735.18

注：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

华安宏利股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 143 号《关于同意华安宏利股票型证券投资基金募集的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型

开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,683,963,683.51 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 112 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 6 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,684,224,358.17 份基金份额，其中认购资金利息折合 260,674.66 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5% 以上。本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数收益率 $\times 90\%$ + 金融同业存款利率 $\times 10\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 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》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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销

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。

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118,235,000.00元,相应调减本基金的净利润118,235,000.00元和基金资产净值118,235,000.00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 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	588,516,531.02	1,616,860,530.71
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	588,516,531.02	1,616,860,530.71

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		8,746,884,124.17	6,395,659,744.09	-2,351,224,380.08
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	1,257,106,809.03	1,269,980,000.00	12,873,190.97
	合计	1,257,106,809.03	1,269,980,000.00	12,873,190.97
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		10,003,990,933.20	7,665,639,744.09	-2,338,351,189.11
项目		上年度末 2007 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	估值增值
股票		11,043,340,189.46	14,384,462,879.00	3,341,122,689.54
债券	交易所市场	99,618,850.00	99,680,000.00	61,150.00
	银行间市场	770,989,334.10	771,178,000.00	188,665.90
	合计	870,608,184.10	870,858,000.00	249,815.90
资产支持证券		-	-	-
其他		-	-	-
合计		11,913,948,373.56	15,255,320,879.00	3,341,372,505.44

注：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的特殊事项停牌相关股票133,696,500.00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243,724,148.06元(2007年度：无)。

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12,684,525.07元(2007年度：公允价值变动收益188,665.90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
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2007年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	136,156.06	417,904.35
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	3,643.20	7,038.90
应收债券利息	22,919,260.28	12,264,128.76
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	478.61	10,548.12
其他	-	-
合计	23,059,538.15	12,699,620.13

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	6,304,219.91	8,494,784.02
银行间市场应付交易费用	10,100.00	9,441.85
合计	6,314,319.91	8,504,225.87

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	25,491.88	175,729.17
预提费用	160,000.00	300,000.00
合计	685,491.88	975,729.17

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	5,237,124,136.00	5,237,124,136.00
本期申购	3,265,039,694.28	3,265,039,694.28

本期赎回	-3,593,963,248.63	-3,593,963,248.63
本期末	4,908,200,581.65	4,908,200,581.65

注：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	4,853,453,148.26	6,550,026,450.92	11,403,479,599.18
本期利润	-3,715,666,282.19	-5,679,723,694.55	-9,395,389,976.74
本期基金份额交易产生的变动数	226,813,200.68	905,661,575.67	1,132,474,776.35
其中：基金申购款	2,885,311,894.40	2,668,738,145.42	5,554,050,039.82
基金赎回款	-2,658,498,693.72	-1,763,076,569.75	-4,421,575,263.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,364,600,066.75	1,775,964,332.04	3,140,564,398.79

7.4.7.11 存款利息收入

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	20,764,680.23	7,269,211.23
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	193,392.59	647,225.95
结算备付金利息收入	299,717.53	340,059.99
其他	-	-
合计	21,257,790.35	8,256,497.17

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	19,883,406,267.58	20,118,666,268.12
卖出股票成本总额	-23,422,757,166.07	-14,564,902,118.73
买卖股票差价收入	-3,539,350,898.49	5,553,764,149.39

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

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	3,287,666,240.10	1,186,222,506.01

付成交金额		
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-3,222,687,841.15	-1,161,444,962.18
应收利息总额	-59,062,826.81	-20,044,962.12
债券投资收益	5,915,572.14	4,732,581.71

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	5,624,124.76	355,407,887.42
卖出权证成本总额	-3,681,644.17	-333,432,465.56
买卖权证差价收入	1,942,480.59	21,975,421.86

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	83,467,846.12	56,712,446.30
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	83,467,846.12	56,712,446.30

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		
——股票投资	-5,692,347,069.62	2,905,375,122.58
——债券投资	12,623,375.07	287,784.74
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具		
——权证投资	-	-25,129,207.33
3. 其他	-	-
合计	-5,679,723,694.55	2,880,533,699.99

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	8,412,273.72	18,123,726.82
印花税手续费返还	39,337.35	-
利息补偿收入	-	1,344.01
合计	8,451,611.07	18,125,070.83

注：基金赎回费收入含赎回费收入和转换费收入。本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

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	114,279,123.11	150,183,149.42
银行间市场交易费用	29,225.00	15,259.30
合计	114,308,348.11	150,198,408.72

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	160,000.00	120,000.00
信息披露费	300,000.00	280,000.00
银行划款手续费	59,988.84	64,255.26
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行账户维护费	240.00	-
合计	538,228.84	482,255.26

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
中国建设银行股份有限公司 （“中国建设银行”）	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

注：本报告期（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）通过关联人交易单元的股票成交量：无；上年度通过关联人交易单元的股票成交量：无。

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）通过关联人交易单元的权证成交量：无；
上年度通过关联人交易单元的权证成交量：无

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

注：本报告期（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）应支付关联方的佣金：无
上年度应支付关联方的佣金：无

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	200,114,966.70	167,216,034.28
其中：当期已支付	189,491,539.21	147,837,473.50
期末未支付	10,623,427.49	19,378,560.78

注：1. 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 1.5% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。
其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 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	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	33,352,494.52	27,869,339.04
其中：当期已支付	31,581,923.27	24,639,578.92

期末未支付	1,770,571.25	3,229,760.12
-------	--------------	--------------

注：1. 支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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
中国建设银行	176,042,589.52	-	-	-	-	-
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
中国建设银行	-	-	-	-	126,400,000.00	65,705.00

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

份额单位：份

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
期初持有的基金份额	9,114,850.11	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	13,801,047.70	9,114,850.11
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	22,915,897.81	9,114,850.11
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.47%	0.17%

注：基金管理人华安基金管理有限公司在本年度运用固有资金 33,200,000 元经申银万国证券股份有限公司购入本基金份额共 13,801,047.70 份，申购费共 119,472.78 元，申购费率为 0.6%。

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

份额单位：份

关联方	本期末（2008年12月31日）	上年度末（2007年12月31日）
-----	------------------	-------------------

名称	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
-	-	-	-	-

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
中国建设银行	588,516,531.02	20,764,680.23	1,616,860,530.71	7,269,211.23

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内买入的，管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券；管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的股票等：无。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况

单位：人民币元

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通受限类型	认购 价格	期末估值 单价	数量 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额
002257	立立电子	08-06-30	未知	新股网下配售	21.81	21.81	43,974	959,072.94	959,072.94
002257	立立电子	08-06-30	未知	新股网上申购	21.81	21.81	26,500	577,965.00	577,965.00

注：1) 本报告期内本基金未持有流通受限债券以及其它证券类别

2) 根据宁波立立电子股份有限公司 2008 年 7 月 7 日发布的公告，有关监管部门要求保荐人等中介机构对媒体报道的有关问题进行核查，上市日期待定。

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	08-05-08	公告重大事项	7.35	未知	未知	18,190,000	298,952,543.19	133,696,500.00

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，本基金无正回购余额。

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

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，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。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本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建设银行，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的证券不

得超过该证券的 10%。

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。

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

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。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负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者

予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2008-12-31	6 个月以内	6 个月至 1 年	1 年至 5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	588,516,531.02	-	-	-	588,516,531.02
结算备付金	8,096,042.80	-	-	-	8,096,042.80
存出保证金	-	-	-	249,669.89	249,669.89
交易性金融资产	474,460,000.00	687,630,000.00	107,890,000.00	6,395,659,744.09	7,665,639,744.09
应收利息	-	-	-	23,059,538.15	23,059,538.15
应收申购款	-	-	-	45,985,438.84	45,985,438.84
资产总计	1,071,072,573.82	687,630,000.00	107,890,000.00	6,464,954,390.97	8,331,546,964.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	250,376,240.52	250,376,240.52
应付赎回款	-	-	-	13,011,933.30	13,011,933.30
应付管理人报酬	-	-	-	10,623,427.49	10,623,427.49
应付托管费	-	-	-	1,770,571.25	1,770,571.25
应付交易费用	-	-	-	6,314,319.91	6,314,319.91
其他负债	-	-	-	685,491.88	685,491.88
负债总计	-	-	-	282,781,984.35	282,781,984.35
利率敏感度缺口	1,071,072,573.82	687,630,000.00	107,890,000.00	6,182,172,406.62	8,048,764,980.44
本期末 2007-12-31	6 个月以内	6 个月至 1 年	1 年至 5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,616,860,530.71	-	-	-	1,616,860,530.71
结算备付金	15,642,066.11	-	-	-	15,642,066.11
存出保证金	-	-	-	4,983,574.06	4,983,574.06
交易性金融资产	355,583,000.00	515,275,000.00	-	14,384,462,879.00	15,255,320,879.00
应收证券清算款	-	-	-	7,504,572.29	7,504,572.29
应收利息	-	-	-	12,699,620.13	12,699,620.13
应收申购款	-	-	-	91,788,017.10	91,788,017.10
资产总计	1,988,085,596.82	515,275,000.00	-	14,501,438,662.58	17,004,799,259.40
负债					
应付证券清算款	-	-	-	283,308,023.85	283,308,023.85
应付赎回款	-	-	-	48,799,224.43	48,799,224.43
应付管理人报酬	-	-	-	19,378,560.78	19,378,560.78
应付托管费	-	-	-	3,229,760.12	3,229,760.12
应付交易费用	-	-	-	8,504,225.87	8,504,225.87
其他负债	-	-	-	975,729.17	975,729.17
负债总计	-	-	-	364,195,524.22	364,195,524.22

利率敏感度缺口	1,988,085,596.82	515,275,000.00	-	14,137,243,138.36	16,640,603,735.18
---------	------------------	----------------	---	-------------------	-------------------

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 15.78%(2007 年 12 月 31 日：5.23%)，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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。本基金投资组合中股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%。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	6,395,659,744.09	79.46	14,384,462,879.00	86.44
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,395,659,744.09	79.46	14,384,462,879.00	86.44

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：亿元）	
		本期末（2008 年 12 月 31 日）	上年度末（2007 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 3.06	增加约 7.64
	业绩比较基准下降 5%	下降约 3.06	下降约 7.64

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	6,395,659,744.09	76.76
	其中：股票	6,395,659,744.09	76.76
2	固定收益投资	1,269,980,000.00	15.24
	其中：债券	1,269,980,000.00	15.24
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的 买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付 金合计	596,612,573.82	7.16
6	其他资产	69,294,646.88	0.83
7	合计	8,331,546,964.79	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	723,183,700.27	8.99
C	制造业	2,509,507,812.79	31.18
C0	食品、饮料	335,095,045.08	4.16
C1	纺织、服装、皮毛	55,136,060.00	0.69
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—

C4	石油、化学、塑胶、塑料	996,546,593.72	12.38
C5	电子	56,566,604.09	0.70
C6	金属、非金属	109,194,444.22	1.36
C7	机械、设备、仪表	613,089,979.64	7.62
C8	医药、生物制品	280,500,240.18	3.49
C99	其他制造业	63,378,845.86	0.79
D	电力、煤气及水的生产和供应业	451,853,701.00	5.61
E	建筑业	59,845,313.30	0.74
F	交通运输、仓储业	260,473,031.08	3.24
G	信息技术业	344,149,191.04	4.28
H	批发和零售贸易	342,678,460.29	4.26
I	金融、保险业	1,075,995,043.56	13.37
J	房地产业	152,612,775.25	1.90
K	社会服务业	55,125,093.60	0.68
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	420,235,621.91	5.22
	合计	6,395,659,744.09	79.46

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	601088	中国神华	21,888,880	383,930,955.20	4.77
2	600309	烟台万华	28,446,088	284,460,880.00	3.53
3	002024	苏宁电器	15,199,919	272,230,549.29	3.38
4	601398	工商银行	69,990,000	247,764,600.00	3.08
5	000983	西山煤电	19,999,909	233,198,938.94	2.90
6	600649	城投控股	26,990,000	222,397,600.00	2.76
7	600519	贵州茅台	2,000,000	217,400,000.00	2.70
8	601166	兴业银行	14,188,880	207,157,648.00	2.57
9	600895	张江高科	20,690,109	206,694,188.91	2.57
10	600036	招商银行	16,990,000	206,598,400.00	2.57
11	601169	北京银行	22,999,900	204,929,109.00	2.55
12	600415	小商品城	3,519,900	193,172,112.00	2.40
13	600315	上海家化	6,189,787	173,499,729.61	2.16
14	600426	华鲁恒升	15,999,959	169,759,564.99	2.11
15	600428	中远航运	25,999,913	166,399,443.20	2.07
16	600196	复星医药	13,999,196	148,531,469.56	1.85
17	000651	格力电器	7,390,000	143,661,600.00	1.78
18	600588	用友软件	6,530,000	143,660,000.00	1.78
19	601328	交通银行	30,000,668	142,203,166.32	1.77
20	600900	长江电力	18,190,000	133,696,500.00	1.66
21	000698	沈阳化工	21,999,928	129,579,575.92	1.61

22	600271	航天信息	5,000,000	126,050,000.00	1.57
23	002202	金风科技	4,990,000	125,997,500.00	1.57
24	002122	天马股份	2,266,660	120,880,977.80	1.50
25	601958	金钼股份	10,531,659	106,053,806.13	1.32
26	600737	中粮屯河	11,999,000	105,711,190.00	1.31
27	600169	太原重工	7,199,734	102,236,222.80	1.27
28	000002	万科A	14,915,345	96,203,975.25	1.20
29	600323	南海发展	11,999,950	95,759,601.00	1.19
30	000028	一致药业	5,800,000	95,178,000.00	1.18
31	600486	扬农化工	3,616,600	90,704,328.00	1.13
32	600423	柳化股份	10,199,940	79,967,529.60	0.99
33	600005	武钢股份	15,000,000	71,700,000.00	0.89
34	600026	中海发展	8,590,000	70,008,500.00	0.87
35	002204	华锐铸钢	3,679,939	55,935,072.80	0.69
36	600325	华发股份	6,000,000	55,800,000.00	0.69
37	600054	黄山旅游	3,990,000	53,386,200.00	0.66
38	002029	七匹狼	4,788,000	50,369,760.00	0.63
39	600100	同方股份	5,000,000	49,650,000.00	0.62
40	601601	中国太保	4,416,027	49,106,220.24	0.61
41	000731	四川美丰	6,973,640	44,561,559.60	0.55
42	600828	成商集团	4,555,500	44,370,570.00	0.55
43	600525	长园集团	2,618,000	42,699,580.00	0.53
44	002008	大族激光	6,880,000	40,248,000.00	0.50
45	002080	中材科技	1,827,809	37,086,244.61	0.46
46	600820	隧道股份	2,999,937	32,699,313.30	0.41
47	600970	中材国际	800,000	25,600,000.00	0.32
48	600327	大厦股份	4,490,000	24,919,500.00	0.31
49	002050	三花股份	2,000,000	24,680,000.00	0.31
50	600561	江西长运	3,919,949	23,990,087.88	0.30
51	600410	华胜天成	1,996,615	21,323,848.20	0.26
52	000538	云南白药	618,060	21,267,444.60	0.26
53	002003	伟星股份	1,999,929	20,679,265.86	0.26
54	600770	综艺股份	2,999,900	20,369,321.00	0.25
55	600703	ST 三安	2,000,000	19,100,000.00	0.24
56	600030	中信证券	1,000,000	17,970,000.00	0.22
57	002197	证通电子	1,099,000	17,584,000.00	0.22
58	600479	千金药业	739,000	14,321,820.00	0.18
59	002214	大立科技	919,900	13,669,714.00	0.17
60	002074	东源电器	1,000,000	9,500,000.00	0.12
61	000887	中鼎股份	1,399,900	9,141,347.00	0.11
62	600887	伊利股份	919,700	7,357,600.00	0.09
63	002154	报喜鸟	433,300	4,766,300.00	0.06
64	002216	三全食品	159,800	4,424,862.00	0.05

65	600176	中国玻纤	280,000	3,866,800.00	0.05
66	002065	东华合创	190,171	2,753,676.08	0.03
67	002242	九阳股份	47,488	2,113,216.00	0.03
68	002183	怡亚通	82,752	1,597,113.60	0.02
69	002257	立立电子	70,474	1,537,037.94	0.02
70	000157	中联重科	111,918	1,251,243.24	0.02
71	002252	上海莱士	47,641	1,201,506.02	0.01
72	600058	五矿发展	99,900	1,157,841.00	0.01
73	601186	中国铁建	100,000	1,004,000.00	0.01
74	002215	诺普信	42,940	768,626.00	0.01
75	002179	中航光电	50,000	767,000.00	0.01
76	000402	金融街	80,000	608,800.00	0.01
77	601390	中国中铁	100,000	542,000.00	0.01
78	002232	启明信息	35,882	474,001.22	0.01
79	600585	海螺水泥	15,600	404,508.00	0.01
80	002241	歌尔声学	14,435	344,852.15	0.00
81	002258	利尔化学	20,000	278,000.00	0.00
82	601318	中国平安	10,000	265,900.00	0.00
83	002268	卫士通	11,179	237,665.54	0.00
84	002220	天宝股份	12,943	201,393.08	0.00
85	002210	飞马国际	17,375	141,780.00	0.00
86	002270	法因数控	10,000	108,800.00	0.00
87	601919	中国远洋	10,000	75,000.00	0.00
88	600660	福耀玻璃	949	3,691.61	0.00

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	601398	工商银行	1,478,338,817.11	8.88
2	600005	武钢股份	1,300,004,404.26	7.81
3	601088	中国神华	1,077,424,109.43	6.47
4	601919	中国远洋	1,034,685,117.88	6.22
5	600519	贵州茅台	885,266,372.65	5.32
6	601328	交通银行	716,969,692.01	4.31
7	600309	烟台万华	617,298,248.15	3.71
8	000983	西山煤电	583,460,754.21	3.51
9	600737	中粮屯河	490,042,333.13	2.94
10	600036	招商银行	473,716,964.68	2.85
11	601186	中国铁建	417,375,094.43	2.51
12	601898	中煤能源	415,823,056.13	2.50
13	002024	苏宁电器	412,231,862.29	2.48
14	601318	中国平安	409,849,264.08	2.46

15	600895	张江高科	384,760,154.48	2.31
16	600649	城投控股	370,880,983.84	2.23
17	600019	宝钢股份	346,811,263.38	2.08
18	000698	沈阳化工	338,851,036.15	2.04
19	600879	火箭股份	333,009,874.61	2.00
20	600428	中远航运	298,987,189.67	1.80

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	601919	中国远洋	1,187,743,460.46	7.14
2	601398	工商银行	1,140,378,191.77	6.85
3	600005	武钢股份	833,721,430.85	5.01
4	600036	招商银行	686,990,785.55	4.13
5	601088	中国神华	673,773,403.99	4.05
6	601318	中国平安	634,407,568.49	3.81
7	600030	中信证券	579,557,586.77	3.48
8	600519	贵州茅台	536,564,450.11	3.22
9	600737	中粮屯河	527,628,150.78	3.17
10	600309	烟台万华	462,378,112.78	2.78
11	600875	东方电气	435,138,024.70	2.61
12	601328	交通银行	404,877,250.88	2.43
13	000060	中金岭南	382,209,417.82	2.30
14	601186	中国铁建	364,067,359.91	2.19
15	601898	中煤能源	325,572,167.51	1.96
16	600900	长江电力	320,364,304.41	1.93
17	600649	城投控股	287,761,472.48	1.73
18	600019	宝钢股份	280,904,857.25	1.69
19	000538	云南白药	271,847,289.64	1.63
20	600325	华发股份	264,796,038.45	1.59

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

买入股票成本（成交）总额	21,126,301,100.78
卖出股票收入（成交）总额	19,883,406,267.58

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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	1,162,090,000.00	14.44
3	金融债券	107,890,000.00	1.34
	其中：政策性金融债	107,890,000.00	1.34
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,269,980,000.00	15.78

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	占基金资产净值比例（%）
1	0801110	08 央票 110	3,000,000	294,900,000.00	3.66
2	0801112	08 央票 112	2,000,000	196,780,000.00	2.44
3	0801034	08 央票 34	1,600,000	154,832,000.00	1.92
4	0801028	08 央票 28	1,300,000	125,658,000.00	1.56
5	080414	08 农发 14	1,000,000	107,890,000.00	1.34

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有权证

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
1	存出保证金	249,669.89
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	23,059,538.15

5	应收申购款	45,985,438.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	69,294,646.88

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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十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
239,265	20,513.66	1,623,751,132.04	33.08%	3,284,449,449.61	66.92%

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	3,530,926.25	0.07%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年9月6日)基金份额总额	1,684,224,358.17
报告期期初基金份额总额	5,237,124,136.00
报告期期间基金总申购份额	3,265,039,694.28
报告期期间基金总赎回份额	3,593,963,248.63
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
报告期期末基金份额总额	4,908,200,581.65

§ 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，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，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，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 2 月 13 日，关于基金经理调整的公告，陈俏宇女士不再担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，聘任汪光成先生为华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，尚志民先生仍任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。

2、本基金托管人重大人事变动如下：

2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准中国建设银行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

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为人民币 160,000 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	
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
中信证券股份有限公司	1	9,333,180,127.91	23.19%	7,933,191.52	23.37%

招商证券股份 有限公司	1	6,280,749,764.47	15.61%	5,338,630.62	15.73%
长江证券股份 有限公司	1	5,063,146,970.12	12.58%	4,303,657.69	12.68%
中信建投证券 有限责任公司	1	4,977,784,433.11	12.37%	4,231,107.56	12.47%
兴业证券股份 有限公司	1	4,007,750,916.17	9.96%	3,406,584.43	10.04%
齐鲁证券有限 公司	1	3,065,043,316.97	7.62%	2,490,372.73	7.34%
申银万国证券 股份有限公司	1	2,928,154,550.57	7.28%	2,379,147.73	7.01%
华泰证券股份 有限公司	1	1,981,709,226.36	4.92%	1,684,449.35	4.96%
国泰君安证券 股份有限公司	1	1,045,194,170.66	2.60%	849,225.74	2.50%
海通证券股份 有限公司	1	855,986,211.27	2.13%	727,588.05	2.14%
中国国际金融 有限公司	1	703,903,711.19	1.75%	598,316.53	1.76%
广发证券股份 有限公司	1	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-
德邦证券有限 责任公司	1	-	-	-	-
财富证券有限 责任公司	1	-	-	-	-
湘财证券有限 责任公司	1	-	-	-	-

债券、回购及权证交易情况

券商名称	交易单 元数量	债券交易		回购交易		权证交易	
		成交金额	占当期 债券成 交总额 的比例	成交金额	占当期 回购成 交总额 的比例	成交金额	占当期 权证成 交总额 的比例
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	1	-	-	1,440,400,000.00	100%	-	-
中信建投证	1	-	-	-	-	-	-

券有限责任公司							
兴业证券股份有限公司	1	11,257,226.60	100%	-	-	5,624,124.76	100%
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-

注：1. 本基金与华安核心优选股票型证券投资基金、华安稳定收益债券型证券投资基金共用席位。

2. 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。

4. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

- (1) 新增齐鲁证券有限公司深圳交易单元 1 个；
- (2) 新增中国国际金融有限公司上海交易单元 1 个；
- (3) 新增华泰证券股份有限公司上海交易单元 1 个；
- (4) 新增德邦证券有限责任公司上海交易单元 1 个；
- (5) 新增财富证券有限责任公司上海交易单元 1 个；
- (6) 新增广发证券股份有限公司上海交易单元 1 个；
- (7) 新增中银国际证券有限责任公司上海交易单元 1 个；
- (8) 新增海通证券股份有限公司上海交易单元 1 个；
- (9) 新增湘财证券有限责任公司深圳交易单元 1 个。

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	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-14
2	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	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-1-14
3	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
4	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
5	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
6	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
7	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

8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	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
14	关于参加中国建设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	2008-3-31
15	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
16	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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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》	2008-6-12

		和公司网站	
23	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
24	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
25	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
26	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
27	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
28	关于新增中国农业银行为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-7-14
29	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
30	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
31	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
32	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
33	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
34	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
35	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
36	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
37	关于新增国联证券股份有限公司为开放式基金代	《上海证券报》、《证券	2008-9-8

	销机构的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
38	关于运用自有资金进行开放式基金投资的公告，本公司从 2008 年 9 月 10 日开始的 6 个月内，通过申银万国证券股份有限公司每月进行等额投资。各基金的投资总额与申购费率如下：华安宏利股票型证券投资基金（基金代码 040005）1680 万元，单笔申购费率为 0.60%；华安创新证券投资基金（基金代码 040001）1260 万元，单笔申购费率为 0.60%；华安策略优选股票型证券投资基金（基金代码 040008）840 万元，单笔申购费率为 0.60%；华安中小盘成长股票型证券投资基金（基金代码 040007）420 万元，单笔申购费率为 0.60%。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-8
39	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，自 2008 年 9 月 16 日起，对我公司所管理的相关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，本基金管理人可以与基金托管人协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。 本基金管理人将聘请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。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-16
40	关于旗下基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》对基金净值影响的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-9-17
41	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
42	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
43	关于新增东北证券股份有限公司为开放式基金代	《上海证券报》、《证券	2008-10-6

	销机构的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
44	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
45	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
46	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
47	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
48	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
49	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
50	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
51	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
52	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
53	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
54	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
55	关于旗下基金投资太原重工（600169）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-1-6
56	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
57	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

58	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
59	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
60	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
61	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
62	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
63	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
64	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》和公司网站	2009-2-26
65	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
66	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
67	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
68	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
69	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
70	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 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

- 1、2008 年 5 月 27 日，中国建设银行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告，美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于 2005 年 6 月 17 日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权；
- 2、2008 年 9 月 23 日，中国建设银行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持中国建设银行股份的公告；
- 3、2008 年 11 月 17 日，中国建设银行公告美国银行公司行使认购期权的事宜；
- 4、2008 年 12 月 2 日，中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

§ 13 备查文件目录

- 1、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宏利股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宏利股票型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：

存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
2009年3月26日