巨田货币市场基金 2007年半年度报告摘要

基金管理人:巨田基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示

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

基金托管人交通银行根据本基金合同规定,于 2007 年 8 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

一、基金简介

（一）基金基本情况

1、基金名称:巨田货币市场基金

2、基金简称:巨田货币

3、交易代码:163303

4、基金运作方式:契约型开放式

5、基金合同生效日:2006 年 8 月 17 日

6、报告期末基金份额总额:125,731,519.88 份

7、基金投资目标:

在力争本金安全和保证资产高流动性的前提下,追求高于业绩比较基准的收益率。

8、投资策略:

本基金主要为投资人提供短期现金管理工具,最主要的投资策略是,通过优化以久期为核心的资产配置和品种选择,在保证安全性和流动性的前提下,最大限度地提升基金资产的收益。投资策略分为两个层次:战略资产配置和战术资产配置。

战略资产配置:根据对宏观经济指标、国家财政与货币政策、资金供需、利率期限结构等因素的研究和分析,预测短期市场利率水平,从而确定投资组合的久期和品种配置。

战术资产配置:主要包括对交易市场、投资品种、投资时机、套利的选择与操作,并根据市场环境变化,寻找价值被低估的投资品种和无风险套利机会,努力实现超额收益。

9、业绩比较基准

一年期银行定期储蓄存款的税后利率 =（1– 利息税率）× 一年期银行定期储蓄存款利率。

本基金管理人在合理的市场化利率基准推出的情况下,可根据投资目标、投资方向和投资策略,确定变更业绩比较基准,并提前公告。

10、风险收益特征

本基金属于证券投资基金中高流动性、低风险的品种,预期风险和预期收益都低于债券基金、混合基金和股票基金。

（二）基金管理人情况

1、基金管理人名称:巨田基金管理有限公司

2、信息披露负责人:李锦

3、联系电话:0755 – 82993636

4、传真:0755 – 82990384

5、电子邮箱:xxpl@jtfund.com

（三）基金托管人

1、基金托管人名称:交通银行股份有限公司

2、信息披露负责人:张咏东

3、联系电话:021–68888917

4、传真:021–58408836

5、电子信箱:zhangyd@bankcomm.com

（四）半年报全文登载网站及置备地点

登载年度报告正文的基金管理人互联网网址:http://www.jtfund.com

基金年度报告置备地点:基金管理人与基金托管人处

二、主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标（未经审计）

单位:人民币元

序号	本报告期主要财务指标	2007年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
1	基金本期净收益	1,915,577.29
2	期末基金资产净值	125,731,519.88
3	期末基金份额净值	1.0000
4	本期净值收益率	1.2683%
5	累计净值收益率	1.9858%

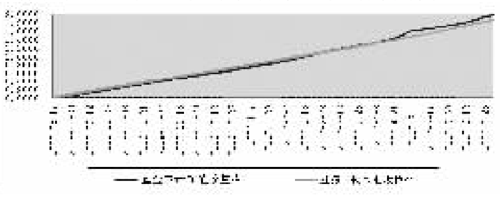
注:本基金收益分配是按月结转份额。

（二）基金净值表现

1、本报告期收益率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	基金净值收益率①	基金净值收益率标准差②	比较基准收益率③	比较基准收益率标准差④	①–③	②–④
过去三个月	0.7032%	0.0047%	0.5819%	0.0003%	0.1213%	0.0044%
过去六个月	1.2683%	0.0036%	1.0873%	0.0005%	0.181%	0.0031%
自基金合同生效起至今	1.9858%	0.0029%	1.8428%	0.0004%	0.143%	0.0025%

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比



注:

按基金合同规定,本基金自基金合同生效日起 3 个月内为建仓期。本报告期内,本基金的各项投资比例符合基金合同的规定:

（1）投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例，不得超过基金资产净值的 10%；（2）存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的 5%;（3）除发生巨额赎回的情形外,本基金的投资组合中,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%;（4）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的 10%;（5）本基金投资组合在每个交易日的平均剩余期限不得超过 180 天;（6）本基金持有的剩余期限不超过 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的 20%;本基金不得投资于以定期存款利率为基准利率的浮动利率债券;（7）买断式回购融入基本债券的剩余期限不得超过 397 天;（8）本基金投资于银行定期存款的比例,不得超过基金资产净值的 30%;（9）法律法规或监管部门规定的其他投资比例限制。

由于基金规模或市场的变化导致的投资组合超过上述约定的比例不在限制之内，但基金管理人应在 10 个交易日内进行调整,以达到标准。因发生巨额赎回致使本基金债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的,基金管理人应当在 5 个交易日内进行调整。

三、基金管理人报告

（一）基金管理人及基金经理简介

1、基金管理人简介

巨田基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]33 号文批准设立。公司股东为巨田证券有限责任公司、中信国安信息产业股份有限公司、汉唐证券有限责任公司、深圳市招融投资控股有限公司、浙江中大集团控股有限公司,公司注册资本为 1 亿元人民币。基金管理人旗下共管理三只开放式基金,即本基金和巨田资源优选混合型证券投资基金,巨田基础行业证券投资基金。本基金是基金管理人管理的第三只基金。

2、基金经理简介

孙健先生,经济学硕士,七年证券从业经验。曾先后任湘财证券资产管理总部债券投资经理、太平人寿保险有限公司投资部投资经理、太平资产管理有限公司投资部投资经理。2006 年 6 月起就职于本公司,曾任巨田货币市场基金基金经理助理。2007 年 1 月起任本公司本基金基金经理。

本基金历任基金经理:冀洪涛先生,任职时间自本基金合同生效起至 2007 年 1 月。

（二）基金运作合法合规性声明

报告期内,基金管理人严格按照《证券投资基金法》及相关法律法规、《巨田货币市场基金基金合同》的规定,以为基金份额持有人谋求长期、稳定的投资回报作为目标,勤勉尽责地管理和运用基金资产,没有损害基金份额持有人利益的行为。

（三）基金经理工作报告及展望

1、上半年宏观经济回顾

(1) 上半年食品类价格近期内持续高位

1–5 月份我国居民消费价格总水平同比上涨 2.9%,比 2006 年加快了 1.4 个百分点,引起 CPI 同比增速大幅上升的原因主要是占 CPI 三分之一比重的食品类价格的上涨。本轮粮食价格上涨主要受国际粮食供需形势变化导致国际粮价上涨的带动,流动性过剩对 CPI 影响开始显现,长期看 CPI 仍有上行的压力。

(2) 贸易顺差维持高位运行

截止到 5 月份，我国 2007 年对外贸易顺差总额为 858.21 亿美元，与去年同期相比增长了 84.3%，2007 年以来对外贸易顺差与往年相比显著提高。央行的外汇占款直接构成了基础货币的投放,流动性压力进一步加大。

(3) 固定资产投资出现反弹

1–5 月份,固定资产投资 32,045 亿元,同比增长 25.9%。新开工项目总投资同比增长 6.1%,2007 年以来首次出现同比增长,显示固定资产投资仍有持续向上的动力。由于源头性产业房地产和高能耗产业投资大幅反弹,加之信贷和工业利润高增推动,拉动上半年固定资产继续上行。

2、下半年宏观经济特点及政策预期

(1) 通货膨胀先冲高后回落

下半年影响 CPI 涨幅的主要因素还是食品价格,5 月份以来粮价上涨导致的非粮农产品价格急剧上涨的态势,第三季度将继续维持价格高位,由此带来 CPI 指标将继续创下新高,第四季度随着秋粮上市这一势头将得到稳定。根据人民银行下半年物价研究的预期数据,全年 CPI3.2%左右,上半年 3%,预期下半年 CPI3.4%左右，续 6 月份 CPI 创下 3.4%的高点后,7 月 –8 月很有可能延续价格惯性继续攀升至 3.8%–4%左右，第三季度 CPI 将创下全年高点，第四季度随着全年宏观调控政策的深入影响 CP 将 I 有所回落。值得长期关注的是,国际农产品价格一直保持高位,外部环境对国内粮食价格的影响将导致粮食价格波动的幅度和频率加大,国内城市化进程加速和居民收入增加将创造强劲的刚性需求。

(2) 信贷增速有望放缓,市场信贷需求依然旺盛

根据银行上半年集中放贷、早放贷早受益的特点,下半年贷款增速呈现季节性减少,估计将比上半年减少约一半,这主要受制于人民银行和银监会强有力的信贷控制政策,全年新增信贷规模将与去年 3 万 2 千亿持平。根据上半年规模企业良好的高利润率增长的趋势,二季度贷款需求景气指数创出新高 68.9%，超越 2004 年第一季度的历史高点,受中小企业和房地产企业高利润率的需求拉动,企业贷款需求景气将维持上升,同时大部分国有商业银行已经改制上市,利润追求的驱动力考验传统的信贷窗口指导。

(3) 贸易顺差持续扩大,人民币升值波动加速

人民币升值波动的幅度与贸易顺差扩大的幅度呈正相关，上半年贸易顺差超千亿的势头直接导致人民币连续小步快跑,虽然年中出台的出口退税减免政策对出口利润有所影响,但是人民币相对于美元升值却相对于欧元区贬值,美元区的刚性需求和对欧元区的强劲竞争力使得出口增长不可能迅速减缓,全年顺差依然在 2000 亿美元以上,人民币定价重估的外部压力依旧很大,下半年升值加速的趋势清晰可现,预计全年升值幅度达到 6%左右。

(4) 居民储蓄转移的趋势不变

上半年人民币储蓄存款增长放缓,同期证券市场的财富效应吸引了大量存款“搬家”。由于未来通货膨胀导致的真实利率维持在零左右，资本市场的高速发展和短期盈利的市场效应将继续吸引银行储蓄资金分流。人民币升值导致的资产重估,大盘蓝筹回归带来的品种优势,企业债公司债推动债券市场的迅猛发展,为传统的储蓄资金提供了广阔的多元化投资途径。

(5) 政策预期

下半年货币政策稳中从紧,财政、产业、外贸、金融监管等政策协调配合,主要目标是保持价格总水平基本稳定,抑制经济走向过热。根据经济波动每年第三季度见高点、第四季度季节性回落的特点,第三季度密集出台相关政策的可能性比较大,对完成全年控制目标有积极的意义。可预期的政策有:第三季度内升息一次,减少利息税;第四季度内提高存款准备金率一次,定向央票或回购,继续调整出口退税率。

3、投资操作及策略

上半年货币市场基金整体面临复杂的金融环境、不断紧缩的政策风险以及利率风险,货币基金产品处于产品周期的低迷期,内有组合调整的压力,外有流动性冲击的危险。由于货币市场基金经历了 2006 年上半年巨额连续赎回的冲击,内部控制制度和投资管理制度更为完善和严格,投资策略更适应具体的市场环境,投资目标从单一的收益率目标转移为安全的流动性管理目标,货币市场基金恢复了其真实的风险收益特征,“高安全性,高流动性,稳定收益”,从而使得该类基金产品在目前复杂艰难的市场状况下能抵御各种风险,为持有人获得稳定的收益。

上半年本基金严格贯彻年初对货币市场和利率市场谨慎的策略，加大持仓结构调整，增强组合流动性,卖出短期融资券和减少部分央行票据,保留充足的现金头寸应对赎回和把握回购利率波动的机会。投资组合剩余期限由年初 122 天下降至 88 天,持仓组合现券资产包括央票 47%、金融债 16%、现金加回购 37%,组合具备较好的流动性和抵御利率风险的能力。上半年受新股发行影响,短期回购利率大幅攀升,利用充足的现金滚动投资收益较高的回购,明显提高组合的收益水平。

下半年,半年度经济数据出台前后,加息或提高准备金率的重大紧缩政策将视经济的热度和持续度顺势推出,策略上应该回避敏感的风险时期,继续保持目前较低的剩余期限至第三季度末,加大交易所回购投资的力度,等待利率风险释放后再增加现券资产,以回购为主的流动性投资应注意掌握现金流的分散和巨额赎回带来的短期冲击。

四、基金托管人报告

2007 年上半年,托管人在巨田货币市场基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

2007 年上半年，巨田基金管理有限公司在巨田货币市场基金投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。根据《关于货币市场基金投资等相关问题的通知》的规定,托管人对基金存在“剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%”的情况,对基金管理人进行了提示,基金管理人根据规定进行了调整。

2007 年上半年,由巨田基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关巨田货币市场基金的半年度报告中财务指标、收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

五、基金半年度财务会计报告(未经审计)

（一）基金会计报表

1、巨田货币市场基金资产负债表

单位:人民币元

	附注	2007年 6 月 30 日	2006年 12 月 31 日
资产			
银行存款		717,227.76	–
结算备付金		22,736,694.63	64,973,177.09
应收利息		74,099.73	939,115.03
应收申购款		345,877.54	–
债券投资市值		78,999,416.30	148,698,023.47
其中:债券投资成本		78,999,416.30	148,698,023.47
买入返售证券		63,000,000.00	–
资产总计		165,873,315.96	214,610,315.59
负债及持有人权益			
负债			
应付证券清算款		20,000,225.02	–
应付赎回款		441,048.42	216,394.38
应付赎回费		3,316.13	105.03
应付管理人报酬		30,190.99	55,076.82
应付托管费		9,148.74	16,689.97
应付销售服务费		22,871.94	41,724.88
应付利息		3,189.04	–
应付收益		151,420.75	143,454.49
其他应付款		6,460.69	9,527.44
卖出回购证券款		19,400,000.00	–
预提费用		73,924.36	49,500.00
负债合计		40,141,796.08	532,473.01
持有人权益			
实收基金		125,731,519.88	214,077,842.58
负债及持有人权益总计		165,873,315.96	214,610,315.59

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

2、巨田货币市场基金经营业绩表

单位:人民币元

	附注	2007年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止
收入		
债券差价收入		63,370.96
债券利息收入		1,601,561.81
存款利息收入		170,971.27
买入返售证券收入		821,211.92
其他收入		–
收入合计		2,657,115.96
费用		
基金管理人报酬		255,259.30
基金托管费		77,351.23
基金销售服务费		193,378.29
卖出回购证券支出		102,276.60
其他费用		113,273.25
其中:信息披露费		49,588.57
审计费用		19,835.79
费用合计		741,538.67
基金净收益及基金经营业绩		1,915,577.29
基金净收益		1,915,577.29
加:期初基金净收益		
可供分配基金净收益		1,915,577.29
减:本期已分配基金净收益		1,915,577.29
未分配基金净收益		–

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

3、巨田货币市场基金净值变动表

单位:人民币元

	附注	2007年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止
期初基金净值		214,077,842.58
本期经营活动		
基金净收益		1,915,577.29
经营活动产生的基金净值变动数		1,915,577.29
本期基金份额交易		
基金申购款		252,577,971.13
其中:红利再投资		1,581,382.76
基金赎回款		340,924,293.83
基金份额交易产生的基金净值变动数		(88,346,322.70)
本期向基金份额持有人分配收益		
向基金份额持有人分配收益产生的基金净值变动数		(1,915,577.29)
期末基金净值		125,731,519.88

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

（二）基金会计报表附注（除特别表明外金额单位为人民币元）

1、基金基本情况

巨田货币市场基金(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 120 号《关于同意巨田货币市场基金募集的批复》核准,由巨田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《巨田货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金首次设立募集期为 2006 年 8 月 1 日至 2006 年 8 月 11 日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,331,917,312.48 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师(上海)报验字(06)第 SZ003 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《巨田货币市场基金基金合同》于 2006 年 8 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,332,065,230.28 份基金份额,其中认购资金利息折合 147,917.80 份基金份额。本基金的基金管理人为巨田基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《巨田货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;一年以内的银行定期存款、大额存单;剩余期限在 397 天以内的债券;期限在一年以内的债券回购;期限在一年以内的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

2、重要会计政策和会计估计的说明

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

3、本报告期会计差错（无）

4、重大关联方关系及关联交易

(a) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
巨田基金管理有限公司(“巨田基金”)	基金管理人、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人、基金代销机构
巨田证券有限责任公司(“巨田证券”)	基金管理人的股东
中信国安信息产业股份有限公司	基金管理人的股东
汉唐证券有限责任公司(“汉唐证券”)	基金管理人的股东
深圳招融投资控股有限公司	基金管理人的股东
浙江中大集团控股有限公司	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。

(b) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

	2007年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间			
	回购成交量		交易佣金	
	成交量 人民币元	占报告期成交量的比例	佣金 人民币元	占报告期佣金总量的比例
巨田证券	806,700,000.00	100.00%	–	–

(c) 基金管理人报酬

支付基金管理人巨田基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%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:日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X0.33%/ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理人报酬 255,259.30 元。

(d) 基金托管费

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%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:日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X0.1%/ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 77,351.23 元。

(e) 基金销售服务费

支付基金销售机构的基金销售服务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,按月支付给巨田基金,再由巨田基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 X0.25%/ 当年天数。

本基金在本会计期间需向关联方支付的基金销售服务费如下:

关联方名称		2007年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
巨田基金		55,739.23
交通银行		27,011.23
合计		82,750.46

(f) 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 717,227.76 元。本会计期间由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 15,582.23 元。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于 2007 年 6 月 30 日的相关余额 22,736,694.63 元计入“结算备付金”科目。

(g) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券及回购交易

本基金在本会计期间与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券及回购交易如下:

		2007年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
卖出回购证券协议金额		80,000,000.00
卖出回购证券利息支出		27,698.63

(h)关联方持有的基金份额

基金管理人 – 巨田基金管理有限公司在 2007 年 6 月 27 日运用固有资金 10,000,000.00 元申购本基金 10,000,000.00 份基金份额,适用申购费率 0%。于 2007 年 6 月 30 日,本基金管理人持有本基金份额 10,000,000.00 份,占基金总份额的 7.95%。

5、流通受限制不能自由转让的基金资产

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止从事银行间同业市场的债券回购交易形成的卖出回购证券款余额 19,400,000.00 元,系以如下债券作为抵押:

债券名称	回购到期日	期末摊余成本单价（元）	数量（张）	期末摊余成本总额（元）
05农发 06	2007–7–6	99.84	200,000	19,968,404.10
合计				19,968,404.10

六、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

资产组合	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
债券投资	78,999,416.30	47.63%
买入返售证券	63,000,000.00	37.98%
其中:买断式回购的买入返售证券	–	–
银行存款和清算备付金合计	23,453,922.39	14.14%
其他资产	419,977.27	0.25%
合计	165,873,315.96	100.00%

（二）报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比(%)
1	报告期内债券回购融资余额	1,662,620,000.00	6.14%
	其中:买断式回购融资	–	–
2	报告期末债券回购融资余额	19,400,000.00	15.43%
	其中:买断式回购融资	–	–

报告期内不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的情况。

（三）基金投资组合平均剩余期限情况

1、投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	170
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内不存在投资组合平均剩余期限违规超过 180 天的情况。

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	68.76%	31.34%–
2	30天(含)—60 天	–	–
3	60天(含)—90 天	39.61%	–
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	15.88%	–
4	90天(含)—180 天	–	–
5	180天(含)—397 天（含）	23.22%	–
	合计	131.59%	31.34%–

（四）报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	国家债券	–	–
2	金融债券	19,968,404.10	15.88%
	其中:政策性金融债	19,968,404.10	15.88%
3	央行票据	59,031,012.20	46.95%
4	企业债券	–	–
5	其他	–	–
	合计	78,999,416.30	62.83%
	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	19,968,404.10	15.88%

2、基金投资前十名债券明细

序号	债券名称	债券数量(张) 自有投资	债券数量(张) 买断式回购	成本(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	06央票 66	300,000		29,832,271.87	23.73%
2	05农发 06	200,000		19,968,404.10	15.88%
3	07央票 53	200,000		19,405,779.96	15.43%
4	07央票 22	100,000		9,792,960.37	7.79%

（五）“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25%（含）–0.5%间的次数	–
报告期内偏离度的最高值	0.13%
报告期内偏离度的最低值	–0.07%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.06%

（六）投资组合报告附注

1、基金计价方法说明:本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。在有关法律法规允许交易所短期债券可以采用摊余成本法估值前,本基金暂不投资于交易所短期债券。

2、本报告期内存在剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况

序号	发生日期	持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本占当日基金资产净值的比例	原因	调整期
1	2007–3–29	22.1256%	巨额赎回造成被动超标	1个交易日

3、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内,本基金严格按照基金合同和招募说明书的规定进行投资决策,所投资品种无超出基金合同规定范围的情形,没有需要特别说明和补充的内容。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,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

4、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	应收利息	74,099.73
2	应收申购款	345,877.54
合计		419,977.27

5、本基金本报告期内未投资资产支持证券。

七、基金份额持有人户数、持有人结构(截止 2007 年 6 月 30 日)

（一）基金份额持有人户数

基金份额持有人户数（户）	672
平均每户持有基金份额（份）	187,100.48

（二） 基金持有人结构

投资者类型	持有份额（份）	占总份额的比例
机构投资者	103,968,353.59	82.69%
个人投资者	21,763,166.29	17.31%
合计	125,731,519.88	100%

截至 2007 年 6 月 30 日,基金管理人无员工投资本基金情况。

八、开放式基金份额变动

本报告期期初基金份额总额	214,077,842.58 份
本报告期基金总申购份额	252,577,971.13 份
本报告期基金总赎回份额	340,924,293.83 份
本报告期期末基金份额总额	125,731,519.88 份

九、重大事件揭示

（一）基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

（二）基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经基金管理人董事会批准,自 2007 年 1 月起聘任孙健先生为本基金基金经理,冀洪涛先生不再担任本基金基金经理职务。

（三）涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内没有涉及到基金管理人、基金托管人和基金财产的诉讼。

（四）基金投资策略的改变

报告期内本基金未改变投资策略。

（五）本基金以单位面值 1.00 元固定单位净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配,每月以红利再投资方式集中支付累计收益,即按单位面值 1.00 元转为基金份额(本基金收益分配是按月结转份额)。本基金本报告期累计分配收益 1,915,577.29 元。

（六）报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

（七）基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受监管部门稽查或处罚。

（八）基金租用证券公司专用交易席位的有关情况

1、债券及回购交易情况（2007 年 1 月 1 日 –6 月 30 日）

券商名称	席位数量	债券回购成交量	占总成交量比例
巨田证券	1	806,700,000.00	100%
合计	1	806,700,000.00	100%

2、席位的变更情况

本基金在报告期内租用券商席位未有变更。

（九）报告期内发生的其他重要事项

序号	其他重要事项	信息披露报刊	披露时间
1	关于巨田货币市场基金 2007 年“春节”长假前暂停申购交易提示的公告	《上海证券报》	2007年 2 月 12 日
2	关于巨田货币市场基金 2007 年“五一”长假前暂停申购及转入交易提示的公告	《上海证券报》	2007年 4 月 25 日
3	关于网上交易系统开通中国建设银行网上支付的公告	《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》	2007年 5 月 22 日
4	关于运用公司固有资金投资旗下货币基金公告	《上海证券报》	2007年 6 月 23 日

十、备查文件目录

（一）备查文件清单

1、中国证监会核准巨田货币市场基金募集的文件;

2、《巨田货币市场基金基金合同》;

3、《巨田货币市场基金托管协议》;

4、《巨田货币市场基金招募说明书》;

5、基金管理人业务资格批件、营业执照;

6、基金托管人业务资格批件、营业执照;

7、报告期内在指定报刊上披露的各项公告。

（二）存放地点及查阅方式

存放地点:基金管理人、基金托管人处。

查阅方式:投资者可在营业时间免费查阅,也可按工本费购买复印件,还可以通过基金管理人网站查阅或下载。

巨田基金管理有限公司
二〇〇七年八月二十八日

（上接 D68 版）

3、 其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	1,437,511.64
2	上海权证担保金	50,000.00
3	深圳权证担保金	48,780.49
4	应收股利	887,038.50
5	应收利息	1,696,091.56
	合计	4,119,422.19

4、 处于转股期的可转换债券明细

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

5、 整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	成本总额(元)	获得途径
1	580009	伊利 CWB1	3,260,000	75,272,491.95	主动投资
2	030002	五粮 YGC1	5,073,550	133,467,329.21	主动投资
3	038010	赤湾 NSP1	2,239,870	0	深赤湾免费派发

6、 基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下:

	基金份额
2007年 4 月 9 日	6,318,119.00 份
基金拆分增加份额	8,307,751.68 份
本期买入	–
本期卖出	–
2007年 6 月 30 日	14,625,870.68 份

九、基金安瑞投资组合报告

报告期自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止

(一)、基金资产组合

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

(二)、股票投资组合

行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	50,547,603.34	4.77%
B 采掘业	53,928,110.50	5.09%
C 制造业	534,445,674.25	50.40%
C0 食品、饮料	12,404,206.12	1.17%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	118,917,153.10	11.21%
C5 电子	81,539,495.00	7.69%
C6 金属、非金属	112,967,894.62	10.65%
C7 机械、设备、仪表	172,980,473.01	16.31%
C8 医药、生物制品	7,626,022.40	0.72%
C99 其他制造业	28,010,430.00	2.64%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	21,806,500.00	2.06%
E 建筑业	5,526,927.34	0.52%
F 交通运输、仓储业	73,749,539.16	6.95%
H 批发和零售贸易	5,246,500.00	0.49%
I 金融、保险业	43,525,500.00	4.10%
J 房地产业	15,885,738.70	1.50%
K 社会服务业	14,748,251.00	1.39%
合计	819,410,344.29	77.27%

(三)、基金投资前十名股票明细

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

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

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例
1	600309	烟台万华	51,131,962.46	5.81%
2	600059	古越龙山	42,033,687.80	4.77%
3	600016	民生银行	33,332,008.34	3.78%
4	000800	一汽轿车	32,136,263.71	3.65%
5	600786	东方锅炉	32,111,342.11	3.65%
6	000401	冀东水泥	26,722,647.05	3.03%
7	000768	西飞国际	25,715,888.18	2.92%
8	002092	中泰化学	23,851,376.61	2.71%
9	002094	青岛金王	23,723,242.50	2.69%
10	000690	宝新能源	21,833,425.78	2.48%
11	600005	武钢股份	21,644,978.36	2.46%
12	000731	四川美丰	19,672,169.22	2.23%
13	600000	浦发银行	19,199,370.49	2.18%
14	000060	中金岭南	18,975,749.50	2.15%
15	600428	中远航运	17,559,330.01	1.99%
16	600600	青岛啤酒	17,239,214.25	1.96%
17	601166	兴业银行	15,066,629.08	1.71%
18	002106	莱宝高科	14,852,432.81	1.69%
19	600596	新安股份	14,483,238.08	1.64%
20	000548	湖南投资	13,934,579.87	1.58%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例
1	000933	神火股份	67,080,304.27	7.62%
2	000157	中联重科	54,164,135.61	6.15%
3	600059	古越龙山	46,281,060.43	5.25%
4	600875	东方电机	45,810,431.61	5.20%
5	600428	中远航运	39,981,229.11	4.54%
6	000690	宝新能源	39,192,309.73	4.45%
7	002028	思源电气	37,816,087.90	4.29%
8	000800	一汽轿车	36,439,276.92	4.14%
9	002021	中捷股份	34,145,862.21	3.88%
10	600019	宝钢股份	32,742,241.66	3.72%
11	000625	长安汽车	29,282,270.88	3.32%
12	002025	航天电器	29,209,232.31	3.32%
13	600009	上海机场	29,079,586.03	3.30%
14	000768	西飞国际	28,862,019.72	3.28%
15	600153	建发股份	24,889,019.65	2.83%
16	000858	五 粮 液	24,662,560.92	2.80%
17	600219	南山铝业	22,474,690.19	2.55%
18	000410	沈阳机床	20,720,793.11	2.35%
19	601166	兴业银行	18,548,818.94	2.11%
20	600519	贵州茅台	14,256,589.12	1.62%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本总额:	801,570,575.52
卖出股票的收入总额:	1,014,069,438.96

(五)、债券投资组合

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

(六)、基金投资前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	010214	02国债⒁	596,460	59,771,256.60	5.64%
2	010103	21国债(3)	437,490	44,120,866.50	4.16%
3	010115	21国债⒂	377,600	37,922,368.00	3.58%
4	010010	20国债⑽	257,090	25,829,832.30	2.44%
5	050404	05农发 04	250,000	24,990,000.00	2.36%

(七)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

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

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

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

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序

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

本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	1,437,511.64
2	上海权证担保金	50,000.00
3	深圳权证担保金	48,780.49
4	应收利息	3,743,391.16
	合计	5,279,683.29

4、处于转股期的可转换债券明细

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

5、整个报告期内获得的权证明细

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

6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下:

	基金份额
2006年 12 月 31 日	6,318,119.00 份
本期买入	–
本期卖出	–
2007年 4 月 9 日	6,318,119.00 份

十、基金份额持有人户数和持有人结构

(一)、2007 年 6 月 30 日华安成长基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	1,007,809 户	
平均每户持有基金份额	17,660.16 份	
项目	份额(份)	占总份额的比例
机构投资者持有的基金份额	553,496,691.23	3.11%
个人投资者持有的基金份额	17,244,570,573.53	96.89%
其中:		
本公司员工持有的基金份额	41,310.53	0.00%

(二)、2007 年 4 月 9 日基金安瑞基金份额持有人户数和持有人结构

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

(一)、2007 年 4 月 9 日基金安瑞前十名持有人

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

十一、开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	基金合同生效日的基金份额总额	500,000,000.00
2	期初基金份额总额	500,000,000.00
3	加:本期申购基金份额总额	18,730,534,741.51
4	其中:基金拆分折算份额总额	657,454,582.58
5	申购份额总额	18,073,080,158.93
6	减:本期赎回基金份额总额	1,432,467,476.75
7	期末基金份额总额	17,798,067,264.76

十二、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议:

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

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

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

(二)、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

1、本基金管理人重大人事变动如下:

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

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

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

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

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:无。

(三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼:无。

(四)、基金投资策略的改变:无。

(五)、基金收益分配事项:

1、安瑞基金本报告期基金收益分配事项:

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

2、华安成长本报告期基金收益分配事项:无。

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

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

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

(八)、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:

新增席位:		
券商名称	上交所席位数	深交所席位数
西部证券股份有限公司	1	–
中银国际证券有限责任公司	–	1
联合证券有限责任公司	–	1
退租席位:无		

2. 交易成交量及佣金情况:

(1).华安成长股票交易情况:

券商名称	席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
长城证券有限责任公司	1	898,086,664.36	5.59%	734,607.54	5.66%
国泰君安证券股份有限公司	1	3,532,686,372.09	21.99%	2,764,346.09	21.30%
上海证券有限责任公司	1	2,712,121,899.04	16.89%	2,223,927.87	17.14%
西部证券股份有限公司	1	3,751,578,789.53	23.36%	3,076,282.01	23.71%
兴业证券股份有限公司	1	594,478,315.39	3.70%	487,470.81	3.76%
中国银河证券有限责任公司	1	2,969,014,190.42	18.49%	2,434,583.37	18.76%
招商证券股份有限公司	1	620,047,482.10	3.86%	485,189.79	3.74%
中银国际证券有限责任公司	1	983,441,700.42	6.12%	769,547.15	5.93%
合计	8	16,061,455,413.35	100.00%	12,975,954.63	100.00%

(2).华安成长债券、回购及权证交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例	权证成交量	占总成交总量比例
长城证券有限责任公司	173,568,747.30	97.50%	14,800,000.00	100.00%	7,443,175.95	3.38%
国泰君安证券股份有限公司	2,751,165.00	1.55%	0.00	0.00%	94,308,977.21	42.87%
上海证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	26,256,617.05	11.93%
西部证券股份有限公司	1,691,111.00	0.95%	0.00	0.00%	42,779,778.45	19.45%
兴业证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中国银河证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	10,064,327.15	4.57%
招商证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	23,000,132.00	10.45%
中银国际证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	16,144,874.20	7.34%
合计	178,011,023.30	100.00%	14,800,000.00	100.00%	219,997,882.01	100.00%

(3).基金安瑞股票交易情况:

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

(4).基金安瑞债券、回购及权证交易情况:

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

(九)、其他重要事项:

1. 修改基金合同:

	公告重要事项	披露日期
1)	发布安瑞证券投资基金终止上市公告，本基金于 2007 年 4 月 10 日终止上市,自基金安瑞终止上市之日起,基金名称变更为华安中小盘成长股票型证券投资基金,由《安瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效,基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》为准。	2007–04–04
2)	发布华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书、华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告。	2007–04–11
3)	发布关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告,经本基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，基金份额折算基准日（2007 年 4 月 18 日）折算前基金份额净值为 2.3149 元,精确到小数点后第 9 位为 2.314909165 元（第 9 位以后舍去），本基金管理人按照 1:2.314909165 的折算比例将原基金安瑞的基金份额进行了折算。折算后,基金份额净值转换为 1.0000 元,相应地,原基金安瑞每 1 份基金份额折算为 2.314909165 份，基金份额计算结果四舍五入保留小数点后两位。原基金安瑞的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份。	2007–04–20
4)	发布华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购确认比例和集中申购结果的公告,经上海立信长江会计师事务所验资,本次华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购的有效申购申请金额为 29,635,516,017.90 元人民币，按照本基金在集中申购期内的最终有效申购确认金额折合基金份额拟不超过 100 亿份规模上限的规定，本基金集中申购的确认比例为 33.7432963%，本基金的最终有效申购确认金额为 10,000,000,066.56 元人民币,扣除集中申购费后,本基金的最终净有效集中申购确认金额为 9,883,484,414.21 元人民币,折合基金份额 9,883,484,414.21 份。截至 2007 年 4 月 18 日止,原安瑞证券投资基金的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份，原安瑞证券投资基金基金份额持有人因暂未指定交易等原因产生的未领取现金红利 1,376,246.47 元人民币确认为基金份额 1,376,246.47 份。华安中小盘成长股票型证券投资基金基金总份额由 500,000,000 份变更为 11,042,315,243.26 份。	2007–04–20

2. 其他重要事项:

1)	关于国信证券有限责任公司和渤海证券有限公司开通华安中小盘成长股票型证券投资基金代销和确权业务的公告	2007–04–26
2)	华安中小盘成长股票型证券投资基金开放日常申购赎回业务公告，于 2007 年 5 月 16 日开始办理日常申购、赎回业务。	2007–05–14
3)	关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购业务的公告,自 2007 年 5 月 17 日起暂停华安成长基金的日常申购业务。	2007–05–17
4)	关于华安中小盘成长股票型证券投资基金重新开放申购的公告,从 2007 年 6 月 8 日起（含）重新开放华安中小盘成长股票型证券投资基金的申购业务。	2007–06–06
5)	关于增加中国农业银行金穗卡持有人办理基金网上交易业务的公告	2007–06–08
6)	关于华安中小盘成长股票型证券投资基金开通基金转换业务的公告	2007–06–08
7)	关于旗下华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率活动的公告	2007–06–19
8)	关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购和转入业务的公告,自公告发布之日起暂停华安中小盘成长股票型证券投资基金（简称“本基金”）的申购和转入业务。	2007–06–21
9)	关于证券投资基金实施新的会计准则的公告，根据中国证监会的相关规定,我公司管理的所有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后,基金将全面采用公允价值进行会计计量,请投资者关注相关法规的规定。实施新会计准则后,基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。	2007–07–02
10)	关于旗下基金投资金地集团（600383）非公开发行股票的公告	2007–07–11

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

十三、备查文件目录

1、《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》

4、《安瑞证券投资基金基金合同》

5、《安瑞证券投资基金扩募说明书》

6、《安瑞证券投资基金托管协议》

7、中国证监会批准安瑞证券投资基金设立的文件;

8、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件;

9、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程;

10、基金托管人业务资格批件和营业执照;

11、上述文件的存放地点和查阅方式如下:

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

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

华安基金管理有限公司
2007 年 8 月 28 日