华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金 2007年半年度报告摘要

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

一、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年8月22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,投资者在做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。

二、基金产品概况

(一)、基金概况

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
深交所行情代码	160402
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
期末基金份额总额:	816,661,792.03份
基金存续期:	不定期

(二)、基金的投资

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:	2006年1月1日至2006年1月15日,本基金的比较基准为:95%*上证180指数收益率+5%*金融同业存款利率;2006年1月16日开始,95%×MSCI中国A股指数收益率+5%×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。

(三)、基金管理人

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

(四)、基金托管人

基金托管人:	中国工商银行股份有限公司
注册地址:	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码:	100032
法定代表人:	姜建清
信息披露负责人:	蒋松云
联系电话:	010-66106720
传真:	010-66106904
电子邮箱:	songyun.jiang@icbc.com.cn

(五)、信息披露

信息披露报纸:	中国证券报、上海证券报、证券时报
管理人互联网地址:	http://www.huaan.com.cn
报告置备地点:	上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼

(六)、其他有关资料

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

三、主要财务指标和基金净值表现

(单位:人民币元)

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

(一)、主要财务指标

财务指标	本报告期
基金本期净收益	328,992,851.21元
基金份额本期净收益	0.5997元
期末可供分配基金收益	873,534,957.93元
期末可供分配基金份额收益	1.0696元
期末基金资产净值	2,656,025,241.00元
期末基金份额净值	3.252元
基金加权平均净值收益率	21.50%
本期基金份额净值增长率	82.84%
基金份额累计净值增长率	301.43%

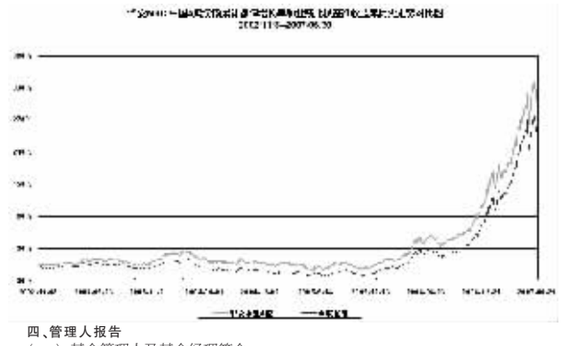
(二)、净值表现

A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.50%	2.81%	-4.28%	2.95%	4.78%	-0.14%
过去三个月	38.92%	2.32%	33.79%	2.43%	5.13%	-0.11%
过去六个月	82.84%	2.35%	80.46%	2.39%	2.38%	-0.04%
过去一年	164.69%	1.89%	161.78%	1.92%	2.91%	-0.03%
过去三年	288.24%	1.43%	271.72%	1.47%	16.52%	-0.04%
自基金合同生效起至今	301.43%	1.27%	233.90%	1.30%	67.53%	-0.03%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



四、管理人报告

(一)、基金管理人及基金经理简介

1. 基金管理人

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

截至2007年6月30日,公司旗下共管理了基金安信、基金安顺、基金安久3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、180ETF、华安成长、华安宏利、华安国际配置等8只开放式基金,管理人民币资产规模达到604.36亿元、美元资产1.88亿美元。

2. 基金经理

刘光华 先生:MBA,10年银行、基金从业经历。曾在农业银行上海分行国际部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001年加入华安基金管理公司,曾任研究部高级研究员、上证180ETF基金经理。现任华安MSCI中国A股指数基金经理、华安中小盘成长基金经理。

(二)、基金运作合规性声明

本报告期间,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《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。

(三)、基金经理工作报告

07年6月30日,华安MSCI基金单位净值3.252元,累计净值3.622元,跟踪偏离度为0.3273%。今年上半年,本基金实施了成立以来的第五次分红,每份额分配0.2元,累计分红达每份额0.37元。

报告期内,A股市场出现了较大幅度的上涨,其中沪深300指数上涨84.42%,MSCI中国A股指数上涨84.67%。本基金的比较基准在上半年增长80.46%,华安MSCI基金净值同期上升82.84%,基金净值表现超越比较基准2.38个百分点。

今年上半年,国民经济继续保持平稳快速发展,GDP同比增长11.5%,其中一季度增长11.1%,二季度增长11.9%。良好的宏观经济环境为上市公司的盈利增长提供了坚实的基础。

今年以来,除了5月底和6月份外,A股市场基本呈现单边上升的态势。我们认为,本轮牛市的持续,除了以股改为基础的制度变革、本币升值加速、流动性充裕等因素继续存在,07年导致市场不断创出新高的主要原因是上市公司的业绩超预期增长。当然,不可否认,股市上涨引发的赚钱效应推动了个人和其他类型投资者入市的热情。这一方面是体现在5月份曾出现的沪深两市成交金额急剧放大,另一方面股票型基金的规模也大幅增长。

华安MSCI基金在报告期内,取得了较好的投资业绩。我们在操作上,遵循指数化投资的特点,股票仓位始终保持在90%以上。同时,除了因投资者的申购和赎回外,我们日常的买卖交易均较少,基本采取买入并持有的策略。

展望下半年,我们需要关注CPI的增速、国家宏观调控的力度等信息,而更关键的是企业盈利的增长能否跟上投资者的预期。在基金操作上,我们将坚持以指数化投资为主、适度增强为辅的策略,争取在跟踪标的指数、控制偏离度的基础上,为持有人创造一定幅度的超额收益。

五、托管人报告

2007年上半年,本基金托管人在对华安中国A股基金的托管过程中,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。

2007年上半年,华安中国A股基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安中国A股基金的投资运作、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。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的华安中国A股基金半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2007年8月22日

六、财务会计报告(未经审计)

(一)、资产负债表

项　目	附注	2007年6月30日	2006年12月31日
资产:			
银行存款		139,680,107.06	31,465,578.91
清算备付金		7,154,417.33	1,540,769.69
交易保证金		663,620.10	500,000.00
应收证券清算款		8,863,635.72	9,598,145.96
应收股利		1,245,255.87	0.00
应收利息		883,389.83	825,957.13
应收申购款		57,956,681.64	4,496,097.80
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		2,476,673,138.17	908,489,488.84
其中:股票投资成本		1,676,481,140.35	540,784,096.72
债券投资市值		102,687,726.44	30,024,000.00
其中:债券投资成本		102,687,726.44	30,024,000.00
权证投资市值		3,686,101.99	0.00
其中:权证投资成本		361,444.74	0.00
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		2,799,494,074.15	986,940,038.33
负债:			
应付证券清算款		8,476,643.03	0.00
应付赎回款		79,638,854.25	4,208,475.04
应付赎回费		0.00	0.00
应付管理人报酬		2,122,214.72	796,649.86
应付托管费		424,442.95	159,329.96
应付佣金		2,097,371.57	1,303,184.49
应付利息		12,438.36	0.00
其他应付款		500,000.00	500,000.00
卖出回购证券款		50,000,000.00	0.00
预提费用		196,868.27	100,000.00
负债合计		143,468,833.15	7,067,639.35
所有者权益:			
实收基金		816,661,792.03	520,760,979.21
未实现利得		965,828,491.04	196,800,353.54
未分配收益		873,534,957.93	262,311,066.23
持有人权益合计		2,656,025,241.00	979,872,398.98
负债和所有者权益合计		2,799,494,074.15	986,940,038.33

(二)、经营业绩表

项　目	附注	2007年1-6月	2006年1-6月
收入:			
股票差价收入		325,656,393.48	181,252,723.88
债券差价收入		384,778.68	-10,711.96
权证差价收入		128,419.68	25,016,364.20
债券利息收入		540,461.75	46,206.53
存款利息收入		573,787.94	410,330.54
股利收入		11,247,644.75	15,023,152.90
买入返售证券收入			0.00
其他收入			1,359.00
收入合计		338,531,486.28	221,739,425.09
费用:			
基金管理人报酬		7,486,925.96	6,039,187.39
基金托管费		1,497,385.22	1,207,837.53
卖出回购证券支出		346,754.62	37,953.91
其他费用		207,569.27	229,730.27
其中:信息披露费		148,767.52	168,603.31
审计费用		48,100.75	51,076.39
费用合计		9,538,635.07	7,514,709.10
基金净收益		328,992,851.21	214,224,715.99
加:未实现估值增值变动数		435,811,262.95	288,152,264.97
基金经营业绩		764,804,114.16	502,376,980.96

(三)、收益分配表

项　目	附注	2007年1-6月	2006年1-6月
本期基金净收益		328,992,851.21	214,224,715.99
加:期初未分配收益		262,311,066.23	17,453,329.39
加:本期损益平准金		432,984,136.52	-63,726,512.69
可供分配基金净收益		1,024,288,053.96	167,951,532.69
减:本期已分配基金净收益		150,753,096.03	36,619,627.55
期末基金未分配净收益		873,534,957.93	131,331,905.14

(四)、净值变动表

项　目	附注	2007年1-6月	2006年1-6月
一、期初基金净值		979,872,398.98	1,531,760,051.11
二、本期经营活动:			
基金净收益		328,992,851.21	214,224,715.99
未实现估值增值变动数		435,811,262.95	288,152,264.97
经营活动产生的基金净值变动数		764,804,114.16	502,376,980.96
三、本期基金单位交易:			
基金申购款		3,339,785,335.49	702,805,832.69
基金赎回款		-2,277,683,511.60	-1,752,233,884.40
基金单位交易产生的基金净值变动数		1,062,101,823.89	-1,049,428,051.71
四、本期向持有人分配收益		-150,753,096.03	-36,619,627.55
五、期末基金净值		2,656,025,241.00	948,089,352.81

(五)、会计报表附注

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制,会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会于2005年7月1日起颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

1. 会计政策

除主要税项外,本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

主要税项的变更内容如下:

基金买卖股票按照3‰的税率征收印花税。从2007年5月30日起,调整证券(股票)交易印花税税率,对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据,由立据双方当事人分别按3‰的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

2. 重大会计差错的内容和更正金额

无。

3. 关联方关系和关联方交易

(1)关联人、关系、交易性质及法律依据列示

关联人	关　系	交易性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、基金注册登记人、基金销售机构	提取管理费	基金合同
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构	提取托管费 银行间债券买卖 银行间成交合同	基金合同
上海国际信托投资有限公司	基金管理人的股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人的股东		
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。

(2)通过关联方席位进行的交易

本报告期本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券、权证和回购交易。

上年度的上半年本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券、权证和回购交易。

(3).本报告期本基金没有与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易。

上年度的上半年与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

关联人	买入债券结算金额	卖出债券结算金额	买入返售证券	利息收入	卖出回购证券	利息支出
中国工商银行股份有限公司	29,710,500.00	29,700,000.00	-	-	-	-

(4).关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费,按前一日基金资产净值的1.0%的年费率计提,计算方法如下:

H = E × 1.0% ÷ 当年天数

H为每日应支付的管理费

E为前一日的基金资产净值

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

本基金在本报告期间需支付基金管理费7,486,925.96元。(上年度的上半年:6,039,187.39元)

② 基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的0.20%的年费率计提,计算方法如下:

H = E ×0.20% ÷ 当年天数

H为每日应支付的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

本基金在本报告期间需支付基金托管费1,497,385.22元。(上年度的上半年:1,207,837.53元)

(5).本基金各关联方投资本基金的情况:

本基金的管理公司本期未未持有本基金份额,本报告期内持有本基金份额没有发生变化。

本基金的基金管理公司主要股东及其控制的机构2007上半年度和2006上半年度均无投资本基金的情况。

(6).由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,自2005年3月17日起按银行活期利率计算,此前按银行同业利率计算。基金托管人于2007年6月30日保管的银行存款余额为139,680,107.06元(2006年6月30日:59,571,144.31元)。本半年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为387,898.18元(上年度的上半年:399,182.59元)。

4. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票:

本基金持有以下因公布重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在所公布的事项的重大影响消除后,并经交易所批准后复牌。

股票名称	数量	总成本	总市值	期末估值单价	转让受限原因	停牌日	复牌日
中国铝业	90,000	308,587.05	2,077,200.00	23.08	重大信息披露停牌	2007-6-12	2007-7-3
农产品	74,000	397,618.66	1,620,600.00	21.90	重大信息披露停牌	2007-5-8	-
合　计		706,205.71	3,697,800.00				

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

七、投资组合报告

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额	占基金总资产比例
1	股票	2,476,673,138.17	88.47%
2	债券	102,687,726.44	3.67%
3	权证	3,686,101.99	0.13%
4	银行存款和清算备付金合计	146,834,524.39	5.25%
5	其他资产	69,612,583.16	2.48%
	合计	2,799,494,074.15	100.00%

(二)、股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	8,996,368.00	0.34%
B 采掘业	155,227,226.00	5.84%
C 制造业	1,029,364,378.46	38.74%
C0 食品、饮料	92,882,296.30	3.50%
C1 纺织、服装、皮毛	25,980,982.66	0.97%
C3 造纸、印刷	23,398,499.28	0.88%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	121,761,791.41	4.58%
C5 电子	20,893,079.95	0.79%
C6 金属、非金属	366,923,529.47	13.81%
C7 机械、设备、仪表	283,332,188.91	10.67%
C8 医药、生物制品	90,117,247.38	3.39%
C99 其他制造业	4,074,763.10	0.15%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	116,390,696.03	4.38%
E 建筑业	16,335,640.36	0.62%
F 交通运输、仓储业	157,553,180.25	5.93%
G 信息技术业	113,611,060.61	4.28%
H 批发和零售贸易	71,125,095.74	2.68%
I 金融、保险业	426,720,276.10	16.07%
J 房地产业	155,569,107.98	5.86%
K 社会服务业	31,248,753.98	1.18%
L 传播与文化产业	11,845,607.40	0.45%
M 综合类	55,866,957.43	2.10%
合计	2,349,854,348.34	88.47%

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值	占资产净值比例
B 采掘业	2,077,200.00	0.07%
C 制造业	55,450,813.38	2.09%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	7,710,500.00	0.29%
C5 电子	11,643,479.98	0.44%
C6 金属、非金属	8,335,000.00	0.31%
C7 机械、设备、仪表	13,824,000.00	0.52%
C8 医药、生物制品	2,576,000.00	0.10%
C99 其他制造业	11,361,833.40	0.43%
E 建筑业	8,160,000.00	0.31%
G 信息技术业	10,839,120.52	0.41%
H 批发和零售贸易	12,175,027.00	0.46%
I 金融、保险业	12,281,500.00	0.46%
J 房地产业	9,598,628.93	0.36%
K 社会服务业	16,236,500.00	0.61%
合计	126,818,789.83	4.77%

(三)、 股票明细

1.指数投资前五名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	市值	占资产净值比例
1	600036	招商银行	3,900,789	95,881,393.62	3.61%
2	600016	民生银行	6,103,136	69,758,844.48	2.63%
3	600019	宝钢股份	6,084,532	66,929,852.00	2.52%
4	000002	万 科 A	3,274,000	62,598,880.00	2.36%
5	600000	浦发银行	1,700,000	62,203,000.00	2.34%

2.积极投资前五名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量	市值	占资产净值比例
1	600150	沪东重机	100,000	13,824,000.00	0.52%
2	601166	兴业银行	350,000	12,281,500.00	0.46%
3	002094	青岛金王	562,467	11,361,833.40	0.43%
4	600973	宝胜股份	396,892	10,839,120.52	0.41%
5	000667	名流置业	863,963	9,598,628.93	0.36%

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	600016	民生银行	53,062,414.09	5.42%
2	600019	宝钢股份	52,158,897.80	5.32%
3	600036	招商银行	45,082,626.11	4.60%
4	601166	兴业银行	44,446,651.61	4.54%
5	000422	湖北宜化	42,227,330.35	4.31%
6	600028	中国石化	42,141,342.74	4.30%
7	601628	中国人寿	41,177,167.81	4.20%
8	600849	上海医药	37,567,631.33	3.83%
9	600030	中信证券	37,001,301.16	3.78%
10	600881	亚泰集团	34,474,115.73	3.52%
11	600000	浦发银行	33,907,601.37	3.46%
12	600015	华夏银行	31,106,434.06	3.17%
13	601318	中国平安	29,297,570.98	2.99%
14	600123	兰花科创	28,510,575.29	2.91%
15	600900	长江电力	27,516,084.51	2.81%
16	000002	万 科 A	26,265,337.58	2.68%
17	000612	焦作万方	25,065,550.02	2.56%
18	000800	一汽轿车	24,545,268.97	2.50%
19	601988	中国银行	23,656,736.89	2.41%
20	601006	大秦铁路	21,909,016.96	2.24%
21	600282	南钢股份	21,888,204.92	2.23%
22	600026	中海发展	21,796,726.47	2.22%
23	600219	南山铝业	20,989,333.13	2.14%
24	000157	中联重科	20,619,876.04	2.10%

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	600036	招商银行	39,555,544.82	4.04%
2	601166	兴业银行	34,571,862.61	3.53%
3	000800	一汽轿车	30,539,473.30	3.12%
4	000612	焦作万方	27,979,743.93	2.86%
5	600016	民生银行	23,344,854.60	2.38%
6	000422	湖北宜化	21,547,499.67	2.20%
7	600881	亚泰集团	21,060,884.44	2.15%
8	601006	大秦铁路	16,626,372.42	1.70%
9	600123	兰花科创	16,502,497.58	1.68%
10	601628	中国人寿	16,281,815.12	1.66%
11	600642	申能股份	15,616,104.42	1.59%
12	000060	中金岭南	14,627,847.03	1.49%
13	600900	长江电力	14,289,879.44	1.46%
14	600050	中国联通	14,277,994.41	1.46%
15	600787	中储股份	13,927,627.43	1.42%
16	000002	万 科 A	13,294,026.35	1.36%
17	600312	平高电气	12,902,735.79	1.32%
18	600428	中远航运	12,805,254.42	1.31%
19	600030	中信证券	11,578,267.62	1.18%
20	600028	中国石化	11,211,974.92	1.14%

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:	1,766,398,422.23
卖出股票的收入总额:	957,159,070.15

*注:买入股票的成本总额未扣减股权分置获得现金对价773.57元。

(五)、债券投资组合

序号	债券品种	市值	占资产净值比例
1	金融债	24,992,500.00	0.94%
2	央行票据	77,695,226.44	2.93%
	合计	102,687,726.44	3.87%

(六)、前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	数量	市值	占资产净值比例
1	0701009	07央票09	500,000	48,559,918.49	1.83%
2	0701018	07央票18	300,000	29,135,307.95	1.10%
3	060302	06进出02	250,000	24,992,500.00	0.94%

(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	占资产净值比例
1	031003	深发SFC1	77,000	1,173,480.00	0.04%
2	580013	武钢CWB1	155,976	945,682.49	0.04%
3	580989	南航JTP1	532,000	928,340.00	0.04%
4	031004	深发SFC2	38,500	638,599.50	0.02%

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未持有资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

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

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,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
1	交易保证金	663,620.10
2	应收股利	1,245,255.87
3	应收利息	883,389.83
4	应收申购款	57,956,681.64
5	应收证券清算款	8,863,635.72
	合计	69,612,583.16

4、处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期未没有持有可转换债券投资。

5、本报告期在股权分置改革中获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	权证数量	成本总额	获得途径
1	580012	云化CWB1	16,200	95,932.94	投资可分离债获赠
2	580013	武钢CWB1	155,976	361,444.74	投资可分离债获赠
3	580989	南航JTP1	532,000	0.00	股权分置改革获赠
4	031003	深发SFC1	77,000	0.00	股权分置改革获赠
5	031004	深发SFC2	38,500	0.00	股权分置改革获赠

八、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	87,632	-
平均每户持有基金份额	9,319.22	-
机构投资者持有的基金份额	145,689,157.17	17.84%
个人投资者持有的基金份额	670,972,634.86	82.16%
公司员工持有的基金份额合计	25,006.48	0.0031%

九、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	3,094,001,262.00
期初基金份额总额	520,760,979.21
加:本期申购基金份额总额	1,106,018,702.28
减:本期赎回基金份额总额	810,117,889.46
期末基金份额总额	816,661,792.03

十、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议:无。

(二)、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

1、本基金管理人重大人事变动如下:

(1).2007年3月22日,本基金管理人发布关于董事变更的公告,经华安基金管理有限公司股东会议决议,同意张军先生因个人原因辞去本公司董事职务。

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

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

2、本基金托管人重大人事变动如下:

2007年上半年,本基金托管人中国工商银行股份有限公司的专门基金托管部门发生的高管人事变动:无。

(三)、本半年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)、基金投资策略的改变:无。

(五)、基金收益分配事项:

1、本报告期基金收益分配事项:

	权益登记日、除息日	红利划出日、红利再投资日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配金额
本报告期第1次分红	2007年6月14日	2007年6月15日	2.00元	150,753,096.03

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

(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形:无。

(八)、本报告期间租用证券公司席位情况如下:

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:

退租席位:		
券商名称	上交所席位数	深交所席位数
中信证券股份有限公司	1	0

2. 交易成交量及佣金情况:

(1).股票交易情况:

券商名称	租用席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
申银万国证券股份有限公司	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券股份有限公司*	0	111,555,001.87	4.10%	91,474.07	4.16%
招商证券股份有限公司	1	290,859,813.39	10.70%	227,599.91	10.36%
宏源证券股份有限公司	1	174,484,108.15	6.42%	143,075.70	6.51%
广发证券股份有限公司	1	562,468,990.96	20.69%	440,135.63