

# 华安现金富利投资基金 2007年第四季度报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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预示其未来表现,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。

**二、基金基本情况**

1. 基金名称: 华安现金富利  
交易代码: 040002  
深交所行情代码: 104042  
基金运作方式: 契约型开放式  
基金合同生效日: 2004年12月30日  
期末基金份额总额: 6,138,760,285.00份  
基金存续期: 不定期

2. 基金的投资

本基金的投资目标是:在基金合同约定的范围内,追求稳健的当期收益,并为投资者提供较好的流动性支持。

基金管理人将充分发挥自身的研究力量,利用公司研究开发的各种数量模型工具,采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,发现和捕捉短期资本市场机会,实现基金的投资目标。

3. 基金管理人: 华安基金管理有限公司  
4. 基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

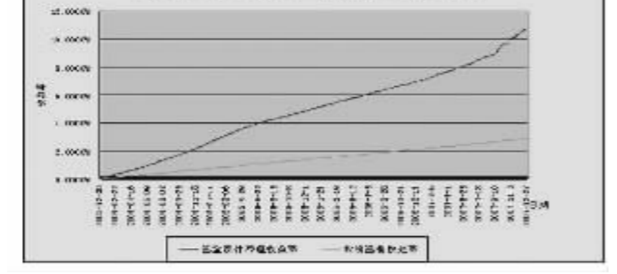
**三、主要财务指标和基金净值表现**

1. 主要财务指标(未经审计)

财务指标	2007年4季度
基金本期利润	57,182,306.19
期末基金资产净值	6,138,760,285.00
期末基金份额净值	1.000元

A. 本报告期基金净值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	业绩比较基准收益率②	①-②	①-④
2007年4季度	1.193%	0.006%	0.2015%	0.001%
2007年1-4季度	1.193%	0.006%	0.2015%	0.001%



**四、管理人报告**

1. 基金经理: 魏蔚先生, 硕士, 持有基金从业资格, 10年银行、基金从业经历, 曾在上海银行资金部从事债券交易、交易工作, 2004年8月加入华安基金管理有限公司, 曾任固定收益部债券投资经理。

2. 报告期内, 本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安现金富利证券投资基金基金合同》、《华安现金富利证券投资基金招募说明书》等有关基金法律法规, 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况。

表1 2007年四季度资产配置及规模变化

投资比例	1.193%	比较基准	0.2015%
股票	60.79%	0.00%	61.39%
债券	39.21%	99.99%	38.61%

表2 2007年四季度资产配置及规模变化

资产组合	金额(元)	占总资产比例
1 债券投资	4,132,889,734.77	66.79%
2 买入返售证券	1,678,307,475.75	27.12%
3 银行存款和清算备付金合计	361,484,462.34	5.84%
4 其他资产	14,065,017.66	0.24%
合计	6,187,566,680.52	100.00%

序号 项目 金额(元) 占资产净值比例

1	报告期内债券投资净额	21,402,939,871.29	7.45%
	其中: 买断式回购	6,002,473,065.29	2.08%
2	报告期内债券投资净额	0.00	0.00%
	其中: 买断式回购	0.00	0.00%

报告期内货币市场基金债券正回购的资金余额占基金资产净值20%的说明:

序号	发生日期	原因	调整期
1	2007-12-5	20.14%	
2	2007-12-6	20.21%	
3	2007-12-7	20.42%	
4	2007-12-10	20.55%	

表3 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值比例	各期限负债占基金资产净值比例
1	30天以内	71.64%	0.00%
2	30天至90天	2.28%	0.00%
3	90天至180天	0.32%	0.00%
4	180天至365天	0.00%	0.00%
5	365天以上	0.00%	0.00%
合计		100.54%	0.00%

表4 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	债券品种	金额(元)	占资产净值比例
1	国债	0.00	0.00%
2	金融债	274,302,887.93	4.47%
3	央行票据	274,302,887.93	4.47%
4	企业债	3,071,873,234.04	50.04%
5	其他	588,511,286.84	9.59%
合计		4,132,889,734.77	67.22%

表5 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	股票名称	金额(元)	占资产净值比例
1	石油、化学、塑胶、塑料	149,109,543.65	4.61%
2	电子	90,944,261.40	2.81%
3	金属、非金属	166,389,257.07	5.16%
4	机械、设备、仪表	270,110,227.26	8.26%
5	医药、生物制品	136,725,023.13	4.29%
6	电力、煤气及水的生产和供应业	1,584,744.00	0.05%
7	建筑业	69,622,365.22	2.15%
8	交通运输、仓储业	177,851,917.17	5.49%
9	信息技术业	26,303,975.54	0.81%
10	批发和零售贸易	241,113,565.64	7.45%
11	金融、保险业	297,404,942.27	9.19%
12	房地产业	91,523,022.40	2.83%
13	社会服务业	111,028,982.52	3.47%
14	传播与文化产业	43,546,900.76	1.36%
15	综合类	59,475,900.12	1.84%
合计		2,020,380,318.72	62.46%

# 华安宝利配置证券投资基金 2007年第四季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

**一、重要提示**

基金管理人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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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预示其未来表现,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。

**二、基金基本情况**

1. 基金名称: 华安宝利  
交易代码: 040004  
深交所行情代码: 104044  
基金运作方式: 契约型开放式  
基金合同生效日: 2004年8月24日  
期末基金份额总额: 2,915,001,464.89份  
基金存续期: 不定期

2. 基金的投资

本基金通过跨市场投资于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资组合,灵活运用多种投资策略,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值增值的基础上获取更稳定的投资收益。

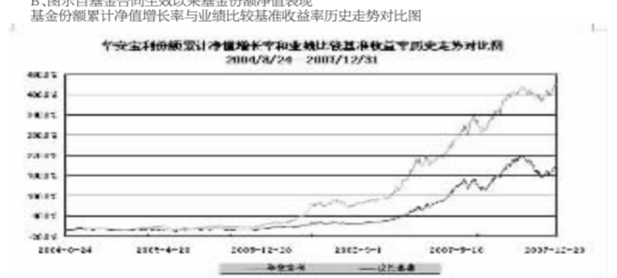
基金管理人将充分发挥自身的研究力量,采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,发现和捕捉短期资本市场机会,实现基金的投资目标。

3. 基金管理人: 华安基金管理有限公司  
4. 基金托管人: 交通银行股份有限公司

**三、主要财务指标和基金净值表现**

1. 主要财务指标(未经审计)

财务指标	2007年4季度
1. 本期利润	107,005,066.88
2. 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	89,686,326.32
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0367
4. 期末基金资产净值	3,234,899,997.13
5. 期末基金份额净值	1.149



**四、管理人报告**

1. 基金经理: 魏蔚先生, 硕士, 持有基金从业资格, 10年银行、基金从业经历, 曾在上海银行资金部从事债券交易、交易工作, 2004年8月加入华安基金管理有限公司, 曾任固定收益部债券投资经理。

2. 报告期内, 本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安宝利配置证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》等有关基金法律法规, 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况。

表1 2007年四季度资产配置及规模变化

资产组合	金额(元)	占总资产比例
1 债券	2,020,380,318.72	61.96%
2 股票	887,076,949.30	26.99%
3 权证	65,534.08	0.02%
4 银行存款和清算备付金	332,027,411.84	10.18%
5 其它资产	40,171,400.35	1.25%
合计	3,260,711,621.99	100.00%

表2 2007年四季度资产配置及规模变化

资产组合	金额(元)	占总资产比例
1 股票	80,644,321.17	2.49%
2 制造业	819,540,278.01	25.23%
3 食品饮料	3,028,000.00	0.09%
4 医药、生物	3,592,066.50	0.11%

表3 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	股票名称	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	600030 大艾康	6,666,600.00	150,331,830.00	4.65%
2	000081 威孚高科	7,777,700.00	145,620,767.00	4.50%
3	601919 中信海洋	2,856,550.00	12,817,806.66	3.77%
4	600036 招商银行	2,787,788.00	10,479,562.88	3.42%
5	600825 新华传媒	1,759,580.00	89,922,287.13	2.78%
6	600083 金地集团	2,127,383.00	76,696,400.24	2.34%
7	600099 烟台万华	1,933,792.00	73,580,786.60	2.27%
8	002022 科华药业	1,800,000.00	63,000,000.00	1.98%
9	600478 元力新材	2,200,000.00	61,402,000.00	1.90%
10	600415 小商品城	698,898.00	59,475,900.12	1.84%

表4 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	债券品种	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	国债	0.00	0.00	0.00%
2	金融债	48,580,000.00	150.00	1.50%
3	企业债	102,042,202.30	3.15%	
4	央行票据	675,377,000.00	20.88%	
5	可转换债券	11,704,112.40	0.36%	
6	企业短期融资券	29,349,000.00	0.91%	
合计		887,076,949.30	26.99%	

表5 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	债券品种	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	070104 07央票04	2,500,000	243,200,000.00	7.52%
2	070125 07央票25	1,500,000	145,500,000.00	4.50%
3	070141 07央票141	1,000,000	99,170,000.00	3.07%
4	050103 05央行31	800,000	79,976,000.00	2.47%
5	070118 07央票18	800,000	77,720,000.00	2.40%

表6 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	股票名称	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	农林、牧、渔业	25,515,872.00	0.46%	
2	电子	154,626,375.57	83.25%	
3	制造业	2,224,362,718.32	94.89%	
4	食品饮料	262,289,546.23	3.95%	
5	医药、生物	30,983,728.18	0.65%	
6	C33 医药、生物	47,921,122.70	0.75%	
7	C4 石油、化学、塑胶、塑料	276,910,119.71	4.34%	
8	C5 电子	387,946,046.06	6.01%	
9	C6 金属、非金属	749,763,155.29	12.29%	
10	C7 机械、设备、仪表	630,578,786.22	9.87%	
11	C8 医药、生物	156,164,518.89	2.45%	
12	C9 医药、生物	6,500,000.00	0.09%	
13	D 电力、煤气及水的生产和供应业	261,728,483.11	3.94%	
14	E 建筑业	29,126,783.11	0.46%	
15	F 交通运输、仓储业	337,529,356.31	5.29%	
16	G 信息技术业	85,883,682.66	1.31%	
17	H 批发和零售贸易	201,578,064.11	3.16%	
18	I 金融、保险业	1,178,391,963.63	18.45%	
19	J 房地产业	401,963,370.60	6.25%	
20	K 社会服务业	74,765,191.46	1.17%	
21	L 传播与文化产业	26,031,413.20	0.41%	
22	M 综合类	116,191,814.90	1.82%	
合计		5,678,157,022.66	89.91%	

# 华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金 2007年第四季度报告

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年1月16日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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预示其未来表现,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。

**二、基金基本情况**

1. 基金名称: 华安中国A股  
交易代码: 040002  
深交所行情代码: 104042  
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: 1,413,063,092.04份  
基金存续期: 不定期

2. 基金的投资

本基金采用量化投资策略,通过控制股票投资组合对MSCI中国A股指数的偏离,力求基金收益率超越基准基金,并在追求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益分配。

(1) 资产配置: 本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的95%。本基金在目前中国股市证券市场上,通过控制股票投资组合对MSCI中国A股指数的偏离,力求基金收益率超越基准基金,并在追求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益分配。

3. 基金管理人: 华安基金管理有限公司  
4. 基金托管人: 中国工商银行股份有限公司

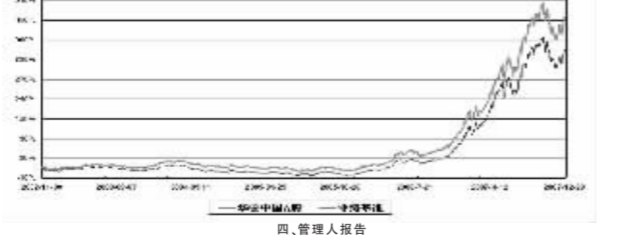
**三、主要财务指标和基金净值表现**

1. 主要财务指标(未经审计)

财务指标	2007年4季度
1. 本期利润	-179,625,894.79
2. 本期利润扣除本期公允价值变动损益后的净额	121,781,592.26
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.1406
4. 期末基金资产净值	6,398,098,949.97
5. 期末基金份额净值	4.519

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

2007年4季度	-3.23%	1.84%	-4.06%	1.86%	0.83%	-0.02%
----------	--------	-------	--------	-------	-------	--------



**四、管理人报告**

1. 基金经理: 魏蔚先生, 硕士, 持有基金从业资格, 10年银行、基金从业经历, 曾在上海银行资金部从事债券交易、交易工作, 2004年8月加入华安基金管理有限公司, 曾任固定收益部债券投资经理。

2. 报告期内, 本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金合同》、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律法规, 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况。

表1 2007年四季度资产配置及规模变化

资产组合	金额(元)	占基金总资产比例
1 股票	5,321,604,704.08	91.96%
2 债券	224,897,546.00	3.49%
3 权证	58,709.32	0.01%
4 银行存款和清算备付金合计	241,589,546.73	3.76%
5 其他资产	60,243,297.71	0.95%
合计	6,439,212,904.74	100.00%

表2 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	股票名称	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	601169 兴业银行	9,266,333.29	49,832,089.08	1.47%
2	000967 名流置业	4,908,972	31,576,482.81	1.12%
3	601919 中信海洋	1,100,300	46,938,788.00	0.74%
4	600082 海泰发展	887,900	14,348,588.82	0.22%
5	600081 浙江广厦	514,471	9,266,333.29	0.14%

表3 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	债券品种	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	央行票据	224,897,546.00	3.49%	
2	企业债	1,182,540.00	0.02%	
合计		226,079,886.00	3.52%	

表4 报告期内投资组合平均剩余期限分布情况

序号	股票名称	金额(元)	市价(元)	占资产净值比例
1	农林、牧、渔业	25,515,872.00	0.46%	
2	电子	154,626,375.57	83.25%	
3	制造业	2,224,362,718.32	94.89%	
4	食品饮料	262,289,546.23	3.95%	
5	医药、生物	30,983,728.18	0.65%	
6	C33 医药、生物	47,921,122.70	0.75%	
7	C4 石油、化学、塑胶、塑料	276,910,119.71	4.34%	
8	C5 电子	387,946,046.06	6.01%	
9	C6 金属、非金属	749,763,155.29	12.29%	
10				