安信证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D130版）

八、投资组合报告

（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	5,038,289,098.27	74.76%
2	债券	1,396,343,318.10	20.72%
3	权证	0.00	0.00%
4	银行存款和清算备付金合计	280,716,530.69	4.17%
5	其他资产	23,486,149.57	0.35%
	合计	6,738,835,096.63	100.00%

（二）、按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	105,440,000.00	1.57%
B 采掘业	263,663,229.22	3.92%
C 制造业	1,748,553,427.90	26.00%
C0 食品、饮料	11,500,000.00	0.17%
C1 纺织、服装、皮毛	228,950.00	0.00%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	927,329,182.88	13.79%
C5 电子	22,925,814.50	0.34%
C6 金属、非金属	86,975,589.12	1.29%
C7 机械、设备、仪表	421,609,356.20	6.27%
C8 医药、生物制品	226,338,535.20	3.37%
C99 其他制造业	51,646,000.00	0.77%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	15,372,861.44	0.23%
E 建筑业	259,280.00	0.00%
F 交通运输、仓储业	292,111,512.61	4.34%
G 信息技术业	1,613,186.56	0.02%
H 批发和零售贸易	89,051,782.20	1.32%
I 金融、保险业	930,536,571.86	13.83%
J 房地产业	1,049,480,000.00	15.60%
K 社会服务业	248,245,800.00	3.69%
l 传播与文化产业	4,287,746.48	0.06%
M 综合类	289,673,700.00	4.31%
合计	5,038,289,098.27	74.91%

（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	600309	烟台万华	9,200,000	350,060,000.00	5.20%
2	000002	万 科A	10,500,000	302,820,000.00	4.50%
3	600383	金地集团	8,000,000	279,780,000.00	4.16%
4	600036	招商银行	7,000,000	277,410,000.00	4.12%
5	600426	华鲁恒升	8,962,750	237,512,875.00	3.53%
6	002007	华兰生物	4,245,380	226,236,300.20	3.36%
7	601318	中国平安	1,900,000	201,590,000.00	3.00%
8	601699	潞安环能	2,750,046	197,370,801.42	2.93%
9	600052	＊ST广厦	12,000,000	174,480,000.00	2.59%
10	000069	华侨城A	3,400,000	170,850,000.00	2.54%

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http://www.huaan.com.cn网站的年度报告正文。

（四）、报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或累计买入、累计卖出价值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	000002	万 科A	429,915,212.83	9.79%
2	600052	＊ST广厦	307,380,399.94	7.00%
3	600383	金地集团	214,113,974.66	4.88%
4	000069	华侨城A	203,933,709.23	4.64%
5	601318	中国平安	184,122,131.11	4.19%
6	600030	中信证券	183,567,979.51	4.18%
7	000401	冀东水泥	160,200,326.45	3.65%
8	600082	海泰发展	160,000,000.00	3.64%
9	600240	华业地产	150,111,323.64	3.42%
10	600252	中恒集团	136,426,510.30	3.11%
11	000402	金 融 街	121,051,927.57	2.76%
12	000829	天音控股	119,600,000.00	2.72%
13	000537	广宇发展	115,062,440.64	2.62%
14	601398	工商银行	114,591,176.02	2.61%
15	600000	浦发银行	109,827,997.00	2.50%
16	000422	湖北宜化	97,197,585.32	2.21%
17	601919	中国远洋	83,299,581.30	1.90%
18	600015	华夏银行	81,190,477.46	1.85%
19	000922	＊ST 阿继	75,193,411.65	1.71%
20	600246	万通地产	72,437,819.54	1.65%

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	000002	万 科A	394,081,301.02	8.97%
2	000401	冀东水泥	388,690,543.56	8.85%
3	000792	盐湖钾肥	296,310,257.63	6.75%
4	600009	上海机场	272,019,472.52	6.19%
5	601006	大秦铁路	216,770,755.91	4.94%
6	600383	金地集团	198,345,530.43	4.52%
7	600052	＊ST广厦	192,257,726.16	4.38%
8	600456	宝钛股份	131,479,830.04	2.99%
9	600000	浦发银行	126,028,538.06	2.87%
10	601398	工商银行	115,009,215.48	2.62%
11	600028	中国石化	100,598,840.78	2.29%
12	600037	歌华有线	97,076,183.13	2.21%
13	600761	安徽合力	94,494,697.43	2.15%
14	601318	中国平安	91,667,993.26	2.09%
15	600066	宇通客车	80,780,103.65	1.84%
16	000060	中金岭南	79,730,587.83	1.82%
17	600246	万通地产	77,064,526.29	1.76%
18	600276	恒瑞医药	76,369,040.26	1.74%
19	000987	广州友谊	71,080,202.57	1.62%
20	000922	＊ST 阿继	69,040,446.04	1.57%

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：	4,619,457,815.97
卖出股票的收入总额：	7,006,251,040.41

＊注：买入股票的成本总额未扣减股权分置获得现金对价2,210.20元。

（五）、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	474,624,318.10	7.06%
2	金融债券	435,866,000.00	6.48%
3	企业债券	0.00	0.00%
4	央行票据	485,853,000.00	7.22%
5	可转换债券	0.00	0.00%
	合计	1,396,343,318.10	20.76%

（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	0701018	07央票18	2,000,000	194,300,000.00	2.89%
2	0701006	07央票06	1,400,000	136,192,000.00	2.02%
3	010702	07国债02	1,100,000	109,769,000.00	1.63%
4	070213	07国开13	1,000,000	100,350,000.00	1.49%
5	0701133	07央票133	1,000,000	96,150,000.00	1.43%

（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(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	–	–	–	–	–

（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。非公开发行有明确锁定期的股票，按证监会相关估值通知确定公允价值。

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。

本基金投资的前十名股票中，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	深交所交易结算保证金	1,607,232.91
2	上海权证担保金	50,000.00
3	深圳权证担保金	48,780.49
4	应收证券清算款	0.00
5	应收股利	0.00
6	应收利息	21,780,136.17
7	待摊费用	0.00
	合计	23,486,149.57

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	580013	武钢CWB1	1,199,599	2,779,842.75	可分离债获赠权证
2	031001	侨城HQC1	1,400,000	26,914,080.72	主动投资
3	031003	深发SFC1	220,000	0.00	股权分置改革被动持有
4	031004	深发SFC2	110,000	0.00	股权分置改革被动持有
5	038010	赤湾NSP1	816,364	0.00	权利派发

九、基金份额持有人户数和持有人结构

（一）、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	78,681户	
平均每户持有基金份额	25,419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	1,146,495,169	57.32%
个人投资者持有的基金份额	853,504,831	42.68%

（二）、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	184,648,175	9.23%
2	中国人寿保险股份有限公司	174,597,886	8.73%
3	新华人寿保险股份有限公司	163,328,826	8.17%
4	中国平安保险(集团)股份有限公司	76,562,035	3.83%
5	华泰证券－招行－华泰紫金2号集合资产管理计划	69,955,737	3.50%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司	56,979,354	2.85%
7	全国社保基金一零九组合	31,104,162	1.56%
8	宝钢集团有限公司	26,750,000	1.34%
9	太平人寿保险有限公司	25,689,462	1.28%
10	全国社保基金六零一组合	24,014,510	1.20%

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）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。

2）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。

3）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。

4）本基金管理人于2007年4月18日发布关于基金经理调整的公告：由于汤礼辉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，决定聘用刘新勇先生担任安信证券投资基金基金经理，汤礼辉先生不再担任安信证券投资基金基金经理职务。

5）本基金管理人于2008年2月13日发布关于基金经理调整的公告：聘任陈俏宇女士担任安信证券投资基金的基金经理，刘新勇先生不再担任安信证券投资基金的基金经理职务。

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、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
2006年度分红	2007-3-31	2007-4-5	2007-4-6	4.20元	840,000,000.00
2007年度第一次分红	2007-6-16	2007-6-20	2007-6-21	2.00元	400,000,000.00
2007年度第二次分红	2007-9-25	2007-9-28	2007-10-8	2.00元	400,000,000.00
2007年度第三次分红	2008-1-21	2008-1-24	2008-1-25	3.00元	600,000,000.00

（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日发布更换旗下部分基金会计师事务所的公告，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。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：100,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自2007年6月5日起至今。

（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单元的有关情况：

1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

新增交易单元：		
券商名称	上交所交易单元数	深交所交易单元数
–	–	–
退租交易单元：		
券商名称	上交所交易单元数	深交所交易单元数
–	–	–

2. 交易成交量及佣金情况：

（1）.股票交易情况：

券商名称	租用交易单元数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
上海证券有限责任公司	1	6,272,972.38	0.06%	5,143.59	0.06%
中国银河证券股份有限公司	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券股份有限公司	1	16,201,647.75	0.15%	13,186.60	0.15%
申银万国证券股份有限公司	1	225,774,224.58	2.12%	176,669.76	2.06%
光大证券股份有限公司	1	3,050,113,822.73	28.59%	2,489,428.62	29.09%
国信证券有限责任公司	2	5,775,896,570.70	54.13%	4,605,103.82	53.81%
海通证券股份有限公司	1	170,712,179.62	1.60%	139,818.31	1.63%
国泰君安证券股份有限公司	1	377,843,061.99	3.54%	308,123.51	3.60%
红塔证券股份有限公司	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
渤海证券有限责任公司	1	130,079,756.13	1.22%	102,453.88	1.20%
中银国际证券有限责任公司	1	917,244,061.40	8.60%	717,748.85	8.39%
中国建银投资证券有限责任公司	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	13	10,670,138,297.28	100.00%	8,557,676.94	100.00%

（2）.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
上海证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中国银河证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券股份有限公司	9,600,766.40	1.70%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	5,743,653.61	6.07%
光大证券股份有限公司	407,338,824.10	72.15%	2,211,000,000.00	31.07%	6,020,028.00	6.36%
国信证券有限责任公司	90,138,748.02	15.97%	3,686,900,000.00	51.82%	82,852,074.61	87.57%
海通证券股份有限公司	0.00	0.00%	60,000,000.00	0.84%	0.00	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	57,472,386.40	10.18%	225,300,000.00	3.17%	0.00	0.00%
红塔证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
渤海证券有限责任公司	0.00	0.00%	932,200,000.00	13.10%	0.00	0.00%
中银国际证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中国建银投资证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	564,550,724.92	100.00%	7,115,400,000.00	100.00%	94,615,756.22	100.00%

3. 券商专用交易单元选择标准：

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

（1）资历雄厚，信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为规范；

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

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（5）证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面研究报告及信息服务，并能根据基金投资研究的特定要求，提供专题研究报告。

4. 券商专用交易单元选择程序：

（1）对候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部等部门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》

研究发展部等部门汇总对各候选券商的综合评估结果，择优选出拟新增交易单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性进行阐述。

（3）候选交易单元名单提交分管副总审批

公司分管副总对研究发展部等部门提交的《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《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

（九）、其他重要事项。

1、收益分配

	其他重要事项	披露日期
1）	华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金2006年度收益分配决议的公告。向全体持有人按每10份基金份额派发现金红利4.20元。	2007年3月31日
2）	华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金2007年度第一次收益分配的公告。向全体持有人按每10份基金份额派发现金红利2.00元。	2007年6月16日
3）	华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金2007年度第二次收益分配的公告。向全体持有人按每10份基金份额派发现金红利2.00元。	2007年9月25日
4）	华安基金管理有限公司关于安信证券投资基金2007年度第三次收益分配的公告。向全体持有人按每10份基金份额派发现金红利3.00元。	2008年1月21日

2、股权变动

1）	经华安基金管理有限公司股东会会议审议通过，并经中国证监会审核批准(证监基金字[2007]282号)，本公司原股东上海广电(集团)有限公司将其持有的本公司20%股权全部转让给上海锦江国际投资管理有限公司。上述股权转让事宜的工商变更登记手续已办理完毕。	2007年11月20日
2）	接我司股东单位上海国际信托投资有限公司通知，经中国银行业监督管理委员会批准，“上海国际信托投资有限公司”已更名为“上海国际信托有限公司”。目前，我司股东更名事项已经完成工商变更登记。	2007年11月20日

3、修改基金合同

1）	华安基金管理有限公司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年7月2日
2）	关于修改安信证券投资基金的基金合同和托管协议的公告。根据中国证监会《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》(证监会计字[2006]23号)，证券投资基金自2007年7月1日起执行新会计准则。为了维护投资者利益，经与安信证券投资基金的托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并经向中国证监会备案，根据相关法律法规的规定及基金合同的约定，对基金安信的基金合同中的基金资产估值条款进行修改。	2007年9月29日

4、其他重要事项

	其他重要事项	披露日期
1）	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资山东药玻(600529)非公开发行股票的公告。	2007年3月5日
2）	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资晶源电子(002049)非公开发行股票的公告。	2007年3月15日
3）	华安基金管理有限公司关于总机变更的公告，华安基金管理有限公司的电话总机自2007年5月28日起由（021)58881111变更为(021)38969999。	2007年5月25日
4）	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资金地集团(600383)非公开发行股票的公告。	2007年7月11日
5）	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资天音控股(000829)非公开发行股票的公告。	2007年8月15日
6）	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资海泰发展(600082)非公开发行股票的公告。	2007年10月9日
7）	华安基金管理有限公司关于旗下基金投资中储股份(600787)非公开发行股票的公告。	2007年11月6日

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》上披露。

十一、备查文件目录

1、《安信证券投资基金基金合同》

2、《安信证券投资基金招募说明书》

3、《安信证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准安信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、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
2008年3月27日

华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D132版）

29	600015	华夏银行	45,675,615.16	4.66%
30	600308	华泰股份	42,524,304.15	4.34%
31	601328	交通银行	41,158,295.24	4.20%
32	000878	云南铜业	38,819,435.12	3.96%
33	600309	烟台万华	38,783,099.03	3.96%
34	600739	辽宁成大	37,500,626.93	3.83%
35	000157	中联重科	36,962,981.90	3.77%
36	600269	赣粤高速	36,719,209.77	3.75%
37	600048	保利地产	36,526,405.67	3.73%
38	600005	武钢股份	35,824,668.86	3.66%
39	000401	冀东水泥	34,875,820.23	3.56%
40	000069	华侨城A	34,338,478.32	3.50%
41	000651	格力电器	33,803,830.10	3.45%
42	601600	中国铝业	33,450,958.27	3.41%
43	600428	中远航运	33,100,312.94	3.38%
44	600519	贵州茅台	33,054,263.05	3.37%
45	000027	深圳能源	33,009,704.13	3.37%
46	600660	福耀玻璃	31,882,345.35	3.25%
47	600026	中海发展	29,993,398.31	3.06%
48	000960	锡业股份	29,602,239.45	3.02%
49	600320	振华港机	29,336,053.05	2.99%
50	601988	中国银行	28,975,692.09	2.96%
51	600123	兰花科创	28,510,575.29	2.91%
52	600104	上海汽车	27,677,826.49	2.82%
53	600489	中金黄金	26,919,590.77	2.75%
54	000731	四川美丰	26,915,864.85	2.75%
55	000060	中金岭南	26,178,072.33	2.67%
56	000983	西山煤电	26,145,120.37	2.67%
57	000933	神火股份	25,446,972.24	2.60%
58	002024	苏宁电器	25,182,357.84	2.57%
59	600973	宝胜股份	24,997,009.36	2.55%
60	600096	云天化	24,763,214.86	2.53%
61	000898	鞍钢股份	24,662,040.97	2.52%
62	600415	小商品城	24,601,985.41	2.51%
63	600011	华能国际	23,863,870.12	2.44%
64	600649	原水股份	22,307,380.89	2.28%
65	000858	五 粮 液	21,692,733.44	2.21%
66	600563	法拉电子	21,531,886.04	2.20%
67	600327	大厦股份	21,504,897.18	2.19%
68	600786	东方锅炉	21,130,623.55	2.16%
69	600219	南山铝业	20,989,333.13	2.14%
70	000839	中信国安	20,418,842.59	2.08%
71	000024	招商地产	20,212,777.10	2.06%
72	000402	金 融 街	20,193,472.37	2.06%
73	600066	宇通客车	20,096,193.74	2.05%
74	600348	国阳新能	20,042,567.75	2.05%
75	600596	新安股份	19,958,752.00	2.04%
76	000623	吉林敖东	19,651,477.90	2.01%

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	600028	中国石化	145,270,614.40	14.83%
2	600030	中信证券	115,101,213.00	11.75%
3	601166	兴业银行	97,312,684.52	9.93%
4	600036	招商银行	73,548,119.82	7.51%
5	000422	湖北宜化	68,551,469.50	7.00%
6	600000	浦发银行	68,247,966.78	6.96%
7	000002	万 科A	50,571,009.95	5.16%
8	600015	华夏银行	44,401,162.76	4.53%
9	601328	交通银行	43,540,665.07	4.44%
10	000800	一汽轿车	42,041,460.36	4.29%
11	600019	宝钢股份	38,214,794.08	3.90%
12	600016	民生银行	36,998,244.45	3.78%
13	000983	西山煤电	34,388,636.88	3.51%
14	000612	焦作万方	32,460,720.32	3.31%
15	600282	南钢股份	29,968,316.28	3.06%
16	600009	上海机场	29,048,447.50	2.96%
17	600881	亚泰集团	27,850,345.69	2.84%
18	601006	大秦铁路	27,439,754.55	2.80%
19	600383	金地集团	27,293,113.44	2.79%
20	000157	中联重科	26,005,801.50	2.65%
21	600428	中远航运	25,682,996.04	2.62%
22	600973	宝胜股份	25,189,152.70	2.57%
23	600327	大厦股份	24,075,071.23	2.46%
24	600563	法拉电子	23,673,595.52	2.42%
25	600123	兰花科创	22,471,545.31	2.29%
26	600026	中海发展	22,385,853.30	2.28%
27	601988	中国银行	22,021,589.90	2.25%
28	601628	中国人寿	21,771,796.40	2.22%
29	600050	中国联通	21,666,657.00	2.21%
30	000039	中集集团	21,507,065.79	2.19%
31	600849	上海医药	20,555,779.13	2.10%

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：	5,504,358,232.35＊
卖出股票的收入总额：	2,324,560,528.97

＊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）、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值	占资产净值比例
1	央行票据	223,685,000.00	3.50%
2	企业债券	1,182,546.00	0.02%
	合计	224,867,546.00	3.52%

（六）、基金投资前五名债券明细

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	2,000,000	194,540,000.00	3.05%
2	0701018	07央票18	300,000	29,145,000.00	0.46%
3	126008	07上汽债	16,470	1,182,546.00	0.02%

（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	580016	上汽CWB1	59,292	538,709.32	0.01%

（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	909,192.84
2	应收利息	5,755,933.05
3	应收申购款	43,166,105.67
4	应收证券清算款	412,066.15
	合计	50,243,297.71

4、处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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
6	031005	国安GAC1	17,858	97,419.21	投资可分离债获赠
7	580016	上汽CWB1	59,292	473,220.58	投资可分离债获赠

九、基金份额持有人户数和持有人结构

1. 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	210,885	–
平均每户持有基金份额	6,700.59	–
机构投资者持有的基金份额	238,358,396.63	16.87%
个人投资者持有的基金份额	1,174,694,695.41	83.13%

2. 期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项 目	期末持有本开放式基金份额的总量(份)	占本基金总份额的比例(%)
基金管理公司持有本基金的所有从业人员	20,637.66	0.001%

十、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	2,531,617,679.97
减：本期赎回基金份额总额	1,639,325,567.14
期末基金份额总额	1,413,053,092.04

十一、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，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。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况如下：100,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

（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	1,068,781,929.60	13.71%	876,398.49	13.89%
中信证券股份有限公司＊	0	111,555,001.87	1.43%	91,474.07	1.45%
招商证券股份有限公司	1	290,859,813.39	3.73%	227,599.91	3.61%
宏源证券股份有限公司	1	174,484,108.15	2.24%	143,075.70	2.27%
广发证券股份有限公司	1	1,890,673,563.12	24.25%	1,479,461.24	23.44%
国泰君安证券股份有限公司	1	537,418,927.33	6.89%	440,681.73	6.98%
中信建投证券有限责任公司	1	1,098,969,264.55	14.10%	901,153.33	14.28%
中国银河证券股份有限公司	1	398,483,037.96	5.11%	326,756.35	5.18%
国金证券有限责任公司	1	2,224,714,914.28	28.54%	1,824,258.44	28.91%
合 计	8	7,795,940,560.25	100.00%	6,310,859.26	100.00%

＊注：本基金于报告期内已退租中信证券股份有限公司之席位，截至报告期末无租用中信证券股份有限公司之席位。

（2）.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
广发证券股份有限公司	2,180,684.56	33.50%	0.00	0.00%	2,636,126.60	55.35%
中国银河证券股份有限公司	1,106,760.00	17.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国金证券有限责任公司	3,222,547.20	49.50%	0.00	0.00%	2,126,308.01	44.65%
合 计	6,509,991.76	100.00%	0.00	0.00%	4,762,434.61	100.00%

3、券商专用席位选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易席位供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）资历雄厚，信誉良好；

（2）财务状况良好，经营行为规范；

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

（4）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；

（5）证券研究或市场研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为本基金提供宏观经济、行业情况、个股分析、基金市场分析等各方面研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

4、券商专用席位选择程序：

（1）对席位候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部等部门组织相关人员依据上述席位选择标准和《券商服务评价办法》，对候选席位的券商服务质量和综合实力进行评估。

（2）填写《新增席位申请审核表》

研究发展部等部门汇总对各候选席位券商的综合评估结果，择优选出拟新增席位，填写《新增席位申请审核表》，对拟新增席位的必要性和合规性进行阐述。

（3）候选席位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等部门提交的《新增席位申请审核表》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《证券交易席位使用协议》，并通知基金托管人。

（九）、其他事项：

1. 股权变动：

	公告事项	披露日期
1）	经华安基金管理有限公司股东会会议审议通过，并经中国证监会审核批准(证监基金字[2007]282号)，本公司原股东上海广电(集团)有限公司将其持有的本公司20%股权全部转让给上海锦江国际投资管理有限公司。上述股权转让事宜的工商变更登记手续已办理完毕。	[2007-11-20]
2）	接我司股东单位上海国际信托投资有限公司通知，经中国银行业监督管理委员会批准，“上海国际信托投资有限公司”已更名为“上海国际信托有限公司”。目前，我司股东更名事项已经完成工商变更登记。	[2007-11-20]

2. 基金合同修改

	修改内容	披露日期
1）	关于修改旗下基金基金合同的公告，本基金的申购费用及申购份额的计算条款修改为：“本基金采用“外扣法”计算申购费用及申购份额，具体计算公式如下： 净申购金额=申购金额/(1+申购费率) 申购费用=申购金额-净申购金额 申购份额=净申购金额/T日基金份额净值”	2007年5月11日
2）	关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告，自2007年5月15日起，本基金的申购费用及申购份额统一调整为“外扣法”计算。	2007年5月11日
3）	关于调整华安基金管理有限公司旗下基金基金转换计算方法的公告，自2007年6月1日起，，我公司旗下华安创新证券投资基金(简称“华安创新”，基金代码 040001)，华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金(简称“华安中国A股”，基金代码040002)、华安宝利配置证券投资基金(简称“华安宝利”，基金代码040004)和华安宏利股票型证券投资基金(简称“华安宏利”，基金代码040005)之间及其与我公司旗下华安现金富利投资基金(简称“华安富利”，基金代码040003）之间的基金转换费用中涉及的申购补差费计算将根据各基金不同的申购费率或固定费用统一调整为“外扣法”计算。	2007年5月29日
4）	关于修改华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金合同和托管协议的公告，根据中国证监会《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》(证监会计字[2006]23号)，证券投资基金自2007年7月1日起执行新会计准则。为了维护投资者利益，经与华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并经向中国证监会备案，根据相关法律法规的规定及基金合同的约定，对华安中国A股基金的基金合同中的基金资产估值条款进行修改。	2007年9月29日
5）	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年7月2日

3. 代销渠道变更

	其他重要事项	披露日期
1）	关于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、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金在中信建投证券有限责任公司开展网上申购费率优惠活动的公告	2007年1月19日
2）	关于新增中信金通证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	2007年4月6日
3）	关于新增中信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	2007年4月12日
4）	关于在中国工商银行开展旗下基金转换业务的公告，自2007年6月8日起，在中国工商银行股份有限公司开通华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金（以下简称“华安中国A股”，基金代码“040002”)与华安现金富利投资基金(以下简称“华安富利”，基金代码“040003”)之间的转换。	2007年6月6日
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年6月8日
6）	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年6月19日
7）	关于新增德邦证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	2007年8月1日
8）	关于新增中国建设银行股份有限公司代销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、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金的公告	2007年8月3日
9）	关于新增东方证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	2007年8月10日
10）	中国建设银行股份有限公司代销旗下六只开放式基金定期定额申购业务的公告	2007年8月10日
11）	关于新增招商银行股份有限公司代销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、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金的公告	2007年8月24日
12）	关于增加中国光大银行为开放式基金代销机构的公告	2007年8月28日
13）	关于参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	2007年9月13日
14）	关于新增深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告	2007年9月19日
15）	关于华安基金管理有限公司在深圳发展银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告	2007年9月19日
16）	关于参加交通银行基金定期定额申购优惠活动的公告	2007年9月28日
17）	关于新增上海银行为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代销机构的公告	2007年10月16日
18）	关于新增长江证券有限责任公司为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、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金代销机构的公告	2007年10月19日
19）	关于新增上海证券有限责任公司为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、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金代销机构的公告	2007年10月19日
20）	关于新增北京银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	2007年10月25日
21）	关于新增中信银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	2007年11月6日
22）	关于新增国都证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	2007年11月8日
23）	关于新增宏源证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	2007年11月8日
24）	关于增加中国邮政储蓄银行代销华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的公告	2007年12月13日
25）	关于参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	2007年12月26日
26）	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	2008年1月15日
27）	关于参加中国光大银行基金定投优惠推广活动的公告	2008年1月18日
28）	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	2008年1月25日
29）	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	2008年1月28日
30）	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	2008年1月31日
31）	关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告	2008年2月25日
32）	关于新增中原证券股份有限公司为华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金代销机构的公告	2008年3月3日
33）	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金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	2008年3月12日
34）	华安基金管理有限公司关于新增深圳平安银行为开放式基金代销机构的公告	2008年3月21日
35）	华安基金管理有限公司关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告	2008年3月24日
36）	华安基金管理有限公司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	2008年3月24日
37）	华安基金管理有限公司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	2008年3月24日

3.其他重要事项

	其他重要事项	披露日期
1）	关于总机变更的公告，华安基金管理有限公司的电话总机自2007年5月28日起由(021)58881111变更为(021)38969999。	2007年5月25日

上述作为临时公告披露的重大事项均刊登于《上海证券报》、《证券时报》以及《中国证券报》上，或基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn上。

十二、备查文件目录

1、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金基金合同》

2、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》

3、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准基金设立的文件；

5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；

6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：

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

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

华安基金管理有限公司
2008年3月27日