华安宝利配置证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D117版）

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	600830	大红鹰	6,666,600	150,331,830.00	4.65%
2	000581	威孚高科	7,777,700	145,520,767.00	4.50%
3	601919	中国远洋	2,855,551	121,817,805.66	3.77%
4	600036	招商银行	2,787,776	110,479,562.88	3.42%
5	600825	新华传媒	1,759,583	89,932,287.13	2.78%
6	600383	金地集团	2,127,353	75,696,002.40	2.34%
7	600309	烟台万华	1,933,792	73,580,785.60	2.27%
8	002022	科华生物	1,800,000	63,900,000.00	1.98%
9	600478	力元新材	2,200,000	61,402,000.00	1.90%
10	600415	小商品城	686,868	59,475,900.12	1.84%

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%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000581	威孚高科	171,483,548.98	10.09%
2	600036	招商银行	157,171,981.32	9.25%
3	600015	华夏银行	126,651,281.58	7.45%
4	601919	中国远洋	124,740,292.89	7.34%
5	600830	大红鹰	119,626,155.00	7.04%
6	002022	科华生物	114,578,654.95	6.74%
7	600000	浦发银行	103,870,666.51	6.11%
8	000069	华侨城A	90,916,009.47	5.35%
9	000401	冀东水泥	86,714,173.04	5.10%
10	601318	中国平安	84,776,557.00	4.99%
11	600383	金地集团	81,394,431.66	4.79%
12	600825	新华传媒	81,287,765.94	4.78%
13	601398	工商银行	75,841,275.44	4.46%
14	600415	小商品城	72,511,031.97	4.27%
15	002092	中泰化学	68,890,483.03	4.05%
16	601939	建设银行	68,580,279.32	4.04%
17	600309	烟台万华	64,596,841.51	3.80%
18	600001	邯郸钢铁	62,989,680.43	3.71%
19	600050	中国联通	61,986,554.50	3.65%
20	000039	中集集团	60,818,882.00	3.58%
21	600102	莱钢股份	60,728,765.25	3.57%
22	600009	上海机场	59,580,791.83	3.51%
23	601006	大秦铁路	57,039,458.84	3.36%
24	600478	力元新材	56,431,853.42	3.32%
25	600236	桂冠电力	53,189,519.87	3.13%
26	000088	盐 田 港	50,021,129.81	2.94%
27	600016	民生银行	49,928,201.14	2.94%
28	601088	中国神华	47,027,498.60	2.77%
29	600019	宝钢股份	42,030,873.43	2.47%
30	600479	千金药业	41,019,962.08	2.41%
31	000822	山东海化	39,666,627.00	2.33%
32	600639	浦东金桥	38,793,863.01	2.28%
33	600379	宝光股份	38,130,043.72	2.24%
34	600037	歌华有线	37,774,874.59	2.22%
35	600786	东方锅炉	37,539,390.89	2.21%
36	600029	南方航空	36,931,802.30	2.17%
37	600219	南山铝业	36,680,009.57	2.16%
38	600325	华发股份	36,236,868.01	2.13%
39	600266	北京城建	34,774,254.26	2.05%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产净值的比例
1	000401	冀东水泥	231,973,502.75	13.65%
2	600000	浦发银行	200,592,959.66	11.81%
3	600009	上海机场	163,651,333.95	9.63%
4	600015	华夏银行	162,076,681.23	9.54%
5	601006	大秦铁路	144,196,420.26	8.49%
6	000792	盐湖钾肥	116,397,009.92	6.85%
7	600456	宝钛股份	114,828,282.53	6.76%
8	600383	金地集团	114,302,476.04	6.73%
9	600596	新安股份	111,326,203.25	6.55%
10	600761	安徽合力	107,420,718.63	6.32%
11	002022	科华生物	105,592,931.57	6.21%
12	600028	中国石化	101,336,998.88	5.96%
13	000951	中国重汽	100,710,736.52	5.93%
14	000858	五 粮 液	93,237,215.93	5.49%
15	601398	工商银行	89,972,216.17	5.30%
16	600276	恒瑞医药	80,475,362.78	4.74%
17	600016	民生银行	77,423,434.84	4.56%
18	600036	招商银行	77,229,835.86	4.55%
19	600050	中国联通	71,903,543.17	4.23%
20	600694	大商股份	68,929,916.75	4.06%
21	600639	浦东金桥	64,864,824.71	3.82%
22	600561	江西长运	56,541,758.36	3.33%
23	600019	宝钢股份	54,739,319.64	3.22%
24	000039	中集集团	53,228,871.92	3.13%
25	600037	歌华有线	52,237,379.96	3.07%
26	002092	中泰化学	52,225,748.52	3.07%
27	000088	盐 田 港	50,418,768.43	2.97%
28	600026	中海发展	49,767,017.85	2.93%
29	600325	华发股份	47,035,645.95	2.77%
30	002025	航天电器	46,588,978.97	2.74%
31	600290	华仪电气	46,363,698.70	2.73%
32	600549	厦门钨业	44,009,233.60	2.59%
33	000528	柳 工	42,346,288.33	2.49%
34	601318	中国平安	41,716,283.60	2.46%
35	600268	国电南自	40,484,003.34	2.38%
36	600150	中国船舶	39,062,811.53	2.30%
37	000061	农 产 品	34,842,298.27	2.05%

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：	3,719,053,040.26
卖出股票的收入总额：	4,412,168,182.90

(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	14,634.00	0.00%
2	金融债券	48,590,000.00	1.50%
3	企业债券	102,042,202.90	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	867,076,949.30	26.80%

(六)、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	0701004	07央票04	2,500,000	243,200,000.00	7.52%
2	0701025	07央票25	1,500,000	145,560,000.00	4.50%
3	0701141	07央票141	1,000,000	99,170,000.00	3.07%
4	0501031	05央票31	800,000	79,976,000.00	2.47%
5	0701018	07央票18	800,000	77,720,000.00	2.40%

(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(份)	市值(元)	占资产净值比例
1	580016	上汽CWB1	54,540	495,534.08	0.02%

(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	深交所交易结算保证金	1,741,245.46
2	上海权证担保金	50,000.00
3	深圳权证担保金	51,282.05
4	应收证券清算款	6,659,692.17
5	应收利息	15,157,692.50
6	应收基金申购款	17,071,494.67
	合计	40,731,406.85

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
1	128031	巨轮转债	48,070	10,062,012.40	0.31%

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(份)	成本总额(元)	获得途径
1	580003	邯钢JTB1	4,500,000	13,546,131.25	二级市场买入
2	580005	万华HXB1	250,000	7,700,089.20	二级市场买入
3	580013	武钢CWB1	839,729	1,945,912.40	申购可分离债获赠
4	580014	深高CWB1	156,816	519,511.58	申购可分离债获赠
5	580015	日照CWB1	217,140	458,160.91	申购可分离债获赠
6	580016	上汽CWB1	54,540	473,335.90	申购可分离债获赠
7	030002	五粮YGC1	350,000	13,252,864.77	二级市场买入
8	031001	侨城HQC1	1,563,200	57,553,005.25	二级市场买入

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	115,596户	
平均每户持有基金份额	24,352.07	
机构投资者持有的基金份额	746,930,112.50	26.53%
个人投资者持有的基金份额	2,068,071,352.39	73.47%

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	103,269.62	0.004%

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	1,130,480,770.08
期初基金份额总额	1,473,522,718.96
加:本期申购基金份额总额	4,158,604,984.81
减:本期赎回基金份额总额	2,817,126,238.88
期末基金份额总额	2,815,001,464.89

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。

(4).2007年4月18日，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，汤礼辉先生不再担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理，袁蓓女士仍继续担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

基金托管人交通银行于2007年10月19日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》，交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在2007年10月19日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

2007年12月21日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》，谷娜莎同志担任交通银行资产托管部总经理，主持资产托管部工作。

具体内容请参阅在2007年12月21日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》。

(三)、本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：

	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
本报告期第1次分红	2007年6月7日	2007年6月8日	3.00元
本报告期第2次分红	2007年9月20日	2007年9月21日	8.00元
本报告期第3次分红	2008年1月7日	2008年1月8日	0.40元

(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，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)、本报告期间租用证券公司交易单元情况如下：

1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

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
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
渤海证券有限责任公司	1	2,131,633,600.87	27.43%	1,747,884.76	27.80%
海通证券股份有限公司	1	1,691,928,772.85	21.77%	1,323,944.55	21.06%
中信建投证券有限责任公司	1	559,587,964.86	7.20%	437,880.68	6.96%
申银万国股份有限公司	1	1,421,961,953.15	18.30%	1,165,990.43	18.54%
兴业证券股份有限公司	1	288,295,895.60	3.71%	236,400.86	3.76%
中信证券股份有限公司	1	1,677,644,265.80	21.59%	1,375,662.56	21.88%
合 计	6	7,771,052,453.13	100.00%	6,287,763.84	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
渤海证券有限责任公司	15,111,938.50	11.40%	100,000,000.00	76.92%	37,921,439.69	19.30%
海通证券股份有限公司	26,010,526.09	19.62%	0.00	0.00%	95,526,149.43	48.61%
中信建投证券有限责任公司	2,009,040.00	1.52%	0.00	0.00%	44,732,573.01	22.76%
申银万国股份有限公司	12,490,933.80	9.42%	30,000,000.00	23.08%	0.00	0.00%
兴业证券股份有限公司	9,066,362.10	6.84%	0.00	0.00%	13,545,081.50	6.89%
中信证券股份有限公司	67,908,071.90	51.21%	0.00	0.00%	4,786,455.30	2.44%
合 计	132,596,872.39	100.00%	130,000,000.00	100.00%	196,511,698.93	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)、其他事项：

1.变更基金份额发售机构：

	公告事项	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	[2007-01-19]
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	[2007-04-06]
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	[2007-04-12]
4)	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]
5)	关于新增中国工商银行股份有限公司为华安宝利配置证券投资基金代销机构的公告	[2007-06-29]
6)	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	[2007-08-01]
7)	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	[2007-08-03]
8)	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	[2007-08-10]
9)	关于开通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	[2007-08-10]
10)	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	[2007-08-24]
11)	关于在中国工商银行股份有限公司开通华安宝利配置证券投资基金定期定额投资计划的公告	[2007-08-27]
12)	关于参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	[2007-09-13]
13)	关于增加中国邮政储蓄银行代销华安宝利配置证券投资基金的公告	[2007-09-17]
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	[2007-09-19]
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	[2007-09-19]
16)	关于参加交通银行基金定期定额申购优惠活动的公告	[2007-09-28]
17)	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	[2007-10-19]
18)	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	[2007-10-19]
19)	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	[2007-10-25]
20)	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	[2007-11-06]
21)	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	[2007-11-08]
22)	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	[2007-11-10]
23)	关于在中国邮政储蓄银行开通定期定额投资计划的公告	[2007-12-03]
24)	关于参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	[2007-12-26]
25)	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	[2008-01-15]
26)	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	[2008-01-25]
27)	关于新增中国光大银行为华安宝利配置证券投资基金代销机构的公告	[2008-01-28]
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	[2008-01-28]
29)	关于新增华安宝利配置证券投资基金参加中国光大银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	[2008-01-29]
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	[2008-01-31]
31)	关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告	[2008-02-25]
32)	华安基金管理有限公司关于新增中原证券股份有限公司为华安宝利配置证券投资基金代销机构的公告	[2008-03-03]
33)	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	[2008-03-21]
34)	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	[2008-03-24]
35)	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	[2008-03-24]
36)	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	[2008-03-24]
37)	华安基金管理有限公司关于调整华安宝利配置证券投资基金电子直销申购费率的公告	[2008-03-24]

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。	[2007-11-20]
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]

3. 基金合同修改：

	公告事项	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”	[2007-05-11]
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。	[2007-05-11]
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。	[2007-05-29]
4)	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]
5)	关于修改华安宏利股票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，经与华安宏利股票型证券投资基金的托管人中国建设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，对华安宏利基金的基金合同中的基金资产估值的条款和基金收益构成的条款进行修改。	[2007-09-29]

4.其他重要事项：

	公告事项	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。	[2007-05-25]
2)	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]

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》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、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》

2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》

3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准华安宝利配置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
2008年3月27日

安顺证券投资基金2007年年度报告摘要

（上接D119版）

(三)、股票明细前十名

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	13,880,000	528,134,000.00	5.60%
2	600036	招商银行	10,199,998	404,225,920.74	4.28%
3	601088	中国神华	5,990,761	393,053,829.21	4.17%
4	600426	华鲁恒升	12,880,000	341,320,000.00	3.62%
5	601939	建设银行	31,199,980	307,319,803.00	3.26%
6	000402	金 融 街	10,000,000	269,800,000.00	2.86%
7	600383	金地集团	8,000,000	267,200,000.00	2.83%
8	600588	用友软件	5,080,000	259,435,600.00	2.75%
9	600026	中海发展	6,990,000	258,769,800.00	2.74%
10	601919	中国远洋	6,000,000	255,960,000.00	2.71%

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、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	600028	中国石化	692,235,942.44	10.52%
2	600030	中信证券	617,819,121.05	9.39%
3	600309	烟台万华	512,681,042.78	7.79%
4	600219	南山铝业	376,613,045.16	5.72%
5	000060	中金岭南	369,117,850.41	5.61%
6	601088	中国神华	361,146,841.79	5.49%
7	600900	长江电力	351,286,333.09	5.34%
8	600036	招商银行	327,376,931.88	4.97%
9	601939	建设银行	314,488,951.54	4.78%
10	601919	中国远洋	299,393,080.88	4.55%
11	601398	工商银行	297,181,817.44	4.52%
12	600048	保利地产	263,206,503.40	4.00%
13	000829	天音控股	256,793,913.14	3.90%
14	600026	中海发展	253,657,996.61	3.85%
15	601628	中国人寿	236,402,614.79	3.59%
16	601318	中国平安	213,494,761.27	3.24%
17	600269	赣粤高速	212,738,408.44	3.23%
18	600383	金地集团	208,000,000.00	3.16%
19	600456	宝钛股份	202,222,473.32	3.07%
20	000538	云南白药	199,955,974.16	3.04%
21	600649	原水股份	196,103,564.15	2.98%
22	600770	综艺股份	183,502,768.01	2.79%
23	000088	盐 田 港	170,001,485.37	2.58%
24	600737	中粮屯河	164,955,438.11	2.51%
25	600875	东方电气	153,654,024.90	2.33%
26	600050	中国联通	153,534,977.35	2.33%
27	600325	华发股份	150,816,289.18	2.29%
28	000667	名流置业	145,583,034.96	2.21%

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	600009	上海机场	997,872,692.26	15.16%
2	600028	中国石化	922,397,612.95	14.02%
3	000039	中集集团	914,172,487.93	13.89%
4	600428	中远航运	753,144,932.86	11.44%
5	600456	宝钛股份	616,721,919.99	9.37%
6	600900	长江电力	601,695,286.22	9.14%
7	000060	中金岭南	597,699,005.97	9.08%
8	600219	南山铝业	519,572,700.17	7.89%
9	600271	航天信息	410,190,991.98	6.23%
10	601398	工商银行	386,268,553.19	5.87%
11	600309	烟台万华	380,085,829.13	5.78%
12	600030	中信证券	374,642,395.82	5.69%
13	601628	中国人寿	336,811,219.96	5.12%
14	600048	保利地产	317,981,958.29	4.83%
15	600269	赣粤高速	301,714,364.37	4.58%
16	000548	湖南投资	251,420,460.94	3.82%
17	600026	中海发展	247,039,569.37	3.75%
18	601318	中国平安	239,648,945.13	3.64%
19	600875	东方电气	213,074,563.36	3.24%
20	000538	云南白药	208,930,101.55	3.17%
21	600475	华光股份	199,009,320.86	3.02%
22	000022	深赤湾A	197,950,441.67	3.01%
23	000829	天音控股	197,637,707.01	3.00%
24	000088	盐 田 港	192,765,282.10	2.93%
25	600132	重庆啤酒	188,680,886.84	2.87%
26	600786	东方锅炉	187,722,923.66	2.85%
27	600050	中国联通	172,476,887.66	2.62%
28	000619	海螺型材	171,977,805.83	2.61%
29	000402	金 融 街	159,207,981.87	2.42%
30	600125	铁龙物流	150,236,654.04	2.28%
31	000157	中联重科	144,866,429.71	2.20%
32	600662	强生控股	138,159,705.27	2.10%
33	600737	中粮屯河	137,007,032.33	2.08%
34	601699	潞安环能	136,713,776.10	2.08%

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：	10,833,092,438.41
卖出股票的收入总额：	14,847,518,435.69

*注本基金于本年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价（2006年：5,222,348.80元，已全额冲减股票投资成本）。

(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	714,882,242.20	7.58%
2	金融债券	627,919,600.00	6.66%
3	央行票据	629,076,000.00	6.67%
	合计	1,971,877,842.20	20.90%

(六)、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	0701004	07央票04	2,000,000	194,560,000.00	2.06%
2	0701078	07央票78	2,000,000	193,140,000.00	2.05%
3	010103	21国债(3)	1,325,990	133,208,955.40	1.41%
4	010709	07国债09	1,100,000	109,527,000.00	1.16%
5	070402	07农发02	1,000,000	99,960,000.00	1.06%

(七)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

本基金本报告期末无权证投资。

(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	深交所交易保证金	1,220,504.82
2	上交所权证担保金	50,000.00
3	深交所权证担保金	51,282.05
4	应收利息	30,291,789.72
5	应收证券清算款	28,207,925.73
6	应收非公开申购款	21,510,000.00
	合计	81,331,502.32

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
1	-	-	-	-	-

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	030002	五粮YGC1	4,466,121	102,914,361.40	主动投资
2	038010	赤湾NSP1	2,290,909	0.00	股权分置改革获赠

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

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	59,913	-
平均每户持有基金份额	50,072.61	-
机构投资者持有的基金份额	1,997,072,346	66.57%
个人投资者持有的基金份额	1,002,927,654	33.43%

(二)、前十名持有人的名称

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	273,529,798	9.12%
2	中国人寿保险股份有限公司	217,012,446	7.23%
3	新华人寿保险股份有限公司	173,731,706	5.79%
4	中国太平洋保险公司	170,273,237	5.68%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司	129,951,402	4.33%
6	中国人民财产保险股份有限公司	91,185,668	3.04%
7	宝钢集团有限公司	88,989,466	2.97%
8	华泰证券-招行-华泰紫金2号集合资产管理计划	74,898,378	2.50%
9	中国平安保险(集团)股份有限公司	63,215,424	2.11%
10	太平人寿保险有限公司	48,316,080	1.61%

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。

(4).2007年3月14日，本基金管理人发布关于基金经理调整的公告，增聘陈俏宇女士为安顺证券投资基金的基金经理，尚志民先生仍继续担任安顺证券投资基金的基金经理。

(5).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安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，聘任汪光成先生为安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，尚志民先生仍任安顺证券投资基金和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：

(1).基金托管人交通银行于2007年10月19日公布了《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》，交通银行资产托管部原总经理阮红同志不再担任资产托管部总经理职务。目前暂由资产托管部谷娜莎副总经理主持资产托管部工作。具体内容请参阅在2007年10月19日《中国证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于基金托管行业高管人员变动的公告》。

(2).2007年12月21日，交通银行股份有限公司在《证券时报》上刊登了《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》，谷娜莎同志担任交通银行资产托管部总经理，主持资产托管部工作。具体内容请参阅在2007年12月21日《证券时报》上发布的《交通银行股份有限公司关于谷娜莎基金托管行业高管任职资格的公告》。

(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	6.80	2,040,000,000.00
2007年度第一次中期分红	2007-6-16	2007-6-20	2007-6-21	2.00	600,000,000.00
2007年度第二次中期分红	2007-9-25	2007-9-28	2007-10-8	2.00	600,000,000.00
2007年度第三次中期分红	2008-1-21	2008-1-24	2008-1-25	3.00	900,000,000.00

(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：无。

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	2	1,289,801,123.78	5.26%	1,031,683.00	5.20%
海通证券股份有限公司	1	4,717,797,473.13	19.25%	3,840,393.54	19.37%
高华证券有限责任公司	1	5,239,451,176.82	21.38%	4,290,795.79	21.64%
中信建投证券有限责任公司	2	782,446,649.20	3.19%	618,918.10	3.12%
招商证券股份有限公司	1	812,873,892.34	3.32%	636,079.18	3.21%
东方证券股份有限公司	2	3,116,829,233.94	12.72%	2,444,103.90	12.33%
中信证券股份有限公司	2	4,624,667,003.79	18.87%	3,755,797.31	18.94%
国泰君安证券股份有限公司	1	161,919,813.22	0.66%	130,273.75	0.66%
中国国际金融有限公司	1	1,634,730,467.83	6.67%	1,335,724.90	6.74%
中银国际证券有限责任公司	1	2,130,990,906.05	8.69%	1,741,017.65	8.78%
合 计	14	24,511,507,740.10	100.00%	19,824,787.12	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
海通证券股份有限公司	157,582,914.10	16.84%	7,165,800,000.00	53.49%	-	0.00%
高华证券有限责任公司	269,325,302.90	28.78%	934,600,000.00	6.98%	-	0.00%
中信建投证券有限责任公司	41,255,201.50	4.41%	500,000,000.00	3.73%	-	0.00%
申银万国证券股份有限公司	-	0.00%	497,000,000.00	3.71%	-	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	-	0.00%	500,000,000.00	3.73%	-	0.00%
招商证券股份有限公司	-	0.00%	-	0.00%	87,216,673.76	27.43%
东方证券股份有限公司	-	0.00%	-	0.00%	211,682,941.31	66.58%
中信证券股份有限公司	69,072,214.60	7.38%	2,373,100,000.00	17.71%	19,015,477.10	5.98%
中国国际金融有限公司	4,191,929.50	0.45%	942,000,000.00	7.03%	-	0.00%
中银国际证券有限责任公司	394,470,115.20	42.15%	484,600,000.00	3.62%	-	0.00%
合 计	935,897,677.80	100.00%	13,397,100,000.00	100.00%	317,915,092.17	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审批

公司分管副总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顺证券投资基金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6.80元。	2007年3月31日
2)	华安基金管理有限公司关于安顺证券投资基金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顺证券投资基金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顺证券投资基金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)	关于修改安顺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，经与安顺证券投资基金的托管人交通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，对基金安顺的基金合同中的基金资产的估值方法条款和估值对象以及特殊情形处理条款进行修改。	2007年9月29日

4、其他重要事项

	公告事项	披露日期
1)	关于旗下基金投资金融街(000402)非公开发行股票的公告	2007年1月26日
2)	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
3)	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
4)	关于旗下基金投资长园新材(600525)非公开发行股票的公告	2007年4月21日
5)	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
6)	关于旗下基金投资大族激光(002008)非公开发行股票的公告	2007年6月13日
7)	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
8)	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
9)	关于旗下基金投资华胜天成(600410)非公开发行股票的公告	2007年9月15日
10)	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
11)	关于旗下基金投资超声电子(000823)非公开发行股票的公告	2008年2月1日

前款所涉及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，或基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn上。

十一、备查文件目录

1、《安顺证券投资基金基金合同》

2、《安顺证券投资基金招募说明书》

3、《安顺证券投资基金托管协议》

4、中国证监会批准安顺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