安顺证券投资基金 2008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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年8月18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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2008年1月1日起至2008年6月30日。

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

1、基金概况

基金名称:	安顺证券投资基金
基金简称:	基金安顺
交易代码:	500009
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	1999年6月15日
期末基金份额总额:	30亿份
基金存续期:	15年
基金上市地点:	上海证券交易所
基金上市日期:	1999年6月22日

2、基金的投资

投资目标:	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。 本基金主要投资于成长型上市公司,并兼顾对收益型上市公司及债券的投资,从而使投资者在承受一定风险的情况下,有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。
投资策略:	本基金为平衡型基金,兼顾资本利得、红利及利息收入。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的80%,其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的20–50%,股票资产的比例控制在40–80%,现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中,60%左右投资于具有良好成长性的上市公司股票,40%左右投资于收益型上市公司股票,在此基础上各自上下浮动10%。 本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好,在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势,财务状况良好,能保持较高的业绩增长,预期收入或利润增长率不低于同期GDP的增长率。 本基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定,具有良好分红能力,预期每股收益高于市场平均水平,预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。
业绩比较基准:	无
风险收益特征:	无

3、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(邮政编码:200120)
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:	俞妙根
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:	021–68604666, 40088–50099

4、基金托管人

基金托管人:	交通银行股份有限公司
注册及办公地址:	上海市银城中路188号(邮政编码:200120)
法定代表人:	蒋超良
信息披露负责人:	张咏东
联系电话:	021–68888917
传真:	021–58408836
电子邮箱:	zhangyd@bankcomm.com

5、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

6、其他有关资料

登记注册机构:	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
办公地点:	上海市陆家嘴东路166号中保大厦36楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(除特殊注明外,单位:人民币元)

1、主要财务指标(未经审计)

序号	主要财务指标	2008年1月1日至2008年6月30日
1	本期利润	–1,737,646,463.94
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	691,020,850.83
3	加权平均份额本期利润	–0.5792
4	期末可供分配利润	1,006,334,544.28
5	期末可供分配份额利润	0.3354
6	期末基金资产净值	4,006,334,544.28
7	期末基金份额净值	1.3354
8	加权平均净值利润率	–26.38%
9	本期份额净值增长率	–24.45%
10	份额累计净值增长率	474.32%

提示:

1.2007年7月1日基金实施新会计准则后,原"基金本期净收益"名称调整为"本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额",原"加权平均基金份额本期净收益"=第2项/(第1项/第3项)。

2、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。

2、净值表现

A、历史各时间段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	–9.70%	2.74%	–	–	–	–
过去三个月	–13.97%	3.98%	–	–	–	–
过去六个月	–24.45%	3.44%	–	–	–	–
过去一年	–3.14%	3.19%	–	–	–	–
过去三年	261.50%	2.97%	–	–	–	–
自基金合同生效起至今	474.32%	2.47%	–	–	–	–

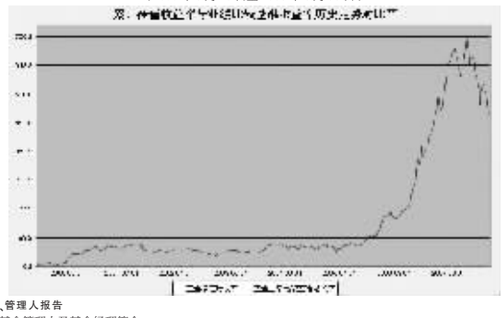
备注:本基金合同中没有规定业绩比较基准。

B、自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安顺证券投资基金

累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(1999年6月15日至2008年6月30日)



四、管理人报告

1、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、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至2008年6月30日,公司旗下共管理了基金安信、基金安顺2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、上证180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安收益、华安国际配置(QDII)等10只开放式基金,管理资产规模达到719.55亿人民币、0.972亿美元。

(2)基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚志民	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2003–09–18	–	11年	工商管理硕士,11年证券、基金从业经验,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员,1999年6月至2001年9月担任基金安顺的基金经理,2000年7月至2001年9月同时担任基金安瑞的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安创新的基金经理,2003年9月至今担任本基金的基金经理,2006年9月起同时担任华安宏利的基金经理。
陈俏宇	本基金的基金经理	2007–03–14	2008–02–13	12年	工商管理硕士,中国注册会计师协会非执业会员,12年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、基金安顺和华安宏利基金经理助理,2007年3月至2008年2月担任本基金和华安宏利基金经理。
汪光成	本基金的基金经理	2008–02–13	–	6年	管理学博士,持有基金从业资格证书,6年证券、基金行业从业经历,2002年1月加入华安基金管理有限公司后,曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月起担任本基金和华安宏利的基金经理。

2、基金运作合规性声明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《安顺证券投资基金基金合同》、《安顺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。

3、公平交易专项说明

(1)公平交易制度的执行情况

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务,均纳入《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易,目前公司《交易端基金间公平交易管理办法–交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡",并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块,不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配,实现公平交易。该模块已于2004年下半年正式上线使用,目前运作情况良好,未出现过例外情况。

对于场外交易,《交易端基金间公平交易管理办法–银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范,目前执行良好。

(2)本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照华安优选和基金安顺的基金合同,华安优选和基金安顺都是混合型基金。08年上半年,华安优选净值增长率为–36.92%,基金安顺的值增长率为–24.45%,基金安顺业绩明显好于华安优选。差异的主要原因在于基金的股票仓位差异较大,华安优选的股票仓位一直保持在70%上下,基金安顺的股票仓位从年初的70%一直降低至50%以下。

(3)异常交易行为的专项说明

本报告期内没有出现异常交易。

4、基金经理工作报告

2008年上半年,市场遭受了许多不利因素,美国次贷危机的恶化、雪灾、地震、通货膨胀高企等,使得投资者预期发生了较大的变化,受此影响,市场出现了大幅度下跌,沪深300指数半年跌幅达到47.7%。在此期间,除了一月初不到两周的上涨和印花税的下调一度刺激市场出现较大幅度的反弹外,基本呈现单边下跌态势,几乎所有行业和个股均出现系统性下跌,市场估值中枢不断下移。

上半年,安顺进行了两次大规模分红。我们基于对市场的谨慎判断,股票组合比例一直保持在相对较低的水平,在一定程度上降低了系统性风险。在股票组合配置方面,我们基于宏观经济变化对产业链上下游企业影响程度和预期的变化以及各行业估值水平的相对变化特征,不断进行股票结构的调整,减持了机械、房地产、钢铁等的配置比例,增持了煤炭、公用事业、具有核心竞争力的创新性技术行业等,对化工行业的配置结构进行优化,对保险行业在一季度进行减持,在二季度随着股价的回落增加了银行股的配置。此外,由于市场的低迷,也使得我们有机会寻找一些质地优良的新股进行配置,效果相对较好。

展望下半年,通货膨胀、信贷紧缩、以及要素价格的调整预期等,都可能对许多上市公司的盈利产生压力,导致盈利预期的不稳定,使得市场在估值方面仍然存在许多不确定因素,同时,外围市场的波动也可能对A股市场形成干扰,因此,在整体上我们仍然保持谨慎态度,重点关注技术创新、通货膨胀受益类公司。

五、托管人报告

2008年上半年度,托管人在安顺证券投资基金的托管过程中,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。

2008年上半年度,华安基金管理有限公司在安顺证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、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。

2008年上半年度,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关安顺证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

六、财务会计报告

(除特殊注明外,单位:人民币元)

(一)、资产负债表(未经审计)

项　目	附注	2008年6月30日	2007年12月31日
资产:			
银行存款		138,788,199.34	231,845,516.91
结算备付金		26,886,260.28	147,520,862.19
存出保证金		1,332,213.22	1,321,786.87
交易性金融资产		3,294,208,379.70	9,082,578,704.58
其中:股票投资		1,961,127,368.50	7,110,700,862.38
债券投资		1,333,081,011.20	1,971,877,842.20
衍生金融资产		–	–
应收证券清算款		562,585,474.97	49,717,925.73
应收利息		20,728,782.77	30,291,789.72
其他资产		3,552,841.07	–
资产总计		4,048,082,151.35	9,543,276,586.00
负债:			
应付证券清算款		28,998,456.19	87,429,768.25
应付管理人报酬		5,097,051.94	11,435,666.23
应付托管费		849,508.66	1,905,944.36
应付交易费用		5,644,950.86	7,295,298.94
应交税费		58,900.00	58,900.00
其他负债		1,098,739.42	1,170,000.00
负债合计		41,747,607.07	109,295,577.78
所有者权益:			
实收基金		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润		1,006,334,544.28	6,433,981,008.22
所有者权益合计		4,006,334,544.28	9,433,981,008.22
负债和所有者权益总计		4,048,082,151.35	9,543,276,586.00
基金份额总额(份)		3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
基金份额净值		1.3354	3.1447

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、利润表(未经审计)

项　目	附注	2008年1月1日至2008年6月30日	2007年1月1日至2007年6月30日
收入:			
利息收入		40,683,726.03	27,074,608.24
其中:存款利息收入		5,915,423.17	3,634,430.05
债券利息收入		34,676,386.38	23,420,881.60
买入返售金融资产收入		91,916.48	19,296.59
投资收益		752,104,438.85	2,896,483,275.56
其中:股票投资收益		740,405,932.01	2,820,739,253.90
债券投资收益		–4,875,819.12	–8,486,848.15
衍生工具收益		279,417.88	48,518,003.26
股利收益		16,294,908.08	35,712,866.55
公允价值变动收益		–2,428,667,314.77	1,072,986,742.26
其他收入		–	4,441.25
收入合计		–1,635,879,149.89	3,996,549,067.31
费用:			
管理人报酬		49,287,475.84	58,483,517.11
托管费		8,228,074.67	9,764,457.40
交易费用		33,838,824.96	31,741,647.77
利息支出		8,002,419.69	7,022,092.14
其中:卖出回购金融资产支出		8,002,419.69	7,022,092.14
其他费用		2,410,518.89	2,184,307.85
费用合计		101,767,314.05	109,196,022.27
利润总额		–1,737,646,463.94	3,887,353,045.04

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、所有者权益(基金净值)变动表(未经审计)

	2008年1月1日至2008年6月30日止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	6,433,981,008.22	9,433,981,008.22
本期经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	–	–1,737,646,463.94	–1,737,646,463.94
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	–	–3,690,000,000.00	–3,690,000,000.00
期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	1,006,334,544.28	4,006,334,544.28
	2007年1月1日至2007年6月30日止期间		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
期初所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	3,581,470,293.58	6,581,470,293.58
本期经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	–	3,887,353,045.04	3,887,353,045.04
本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	–	–2,640,000,000.00	–2,640,000,000.00
期末所有者权益(基金净值)	3,000,000,000.00	4,828,823,338.62	7,828,823,338.62

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、会计报表附注

1、基金基本情况

安顺证券投资基金(以下简称"本基金")由华安基金管理有限公司、上海国际信托投资公司(后更名为上海国际信托有限公司)、山东证券有限责任公司(后更名为天同证券有限责任公司)和浙江证券有限责任公司(后更名为方正证券有限责任公司)四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安顺证券投资基金基金契约》(后更名为《安顺证券投资基金基金合同》)发起,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(1999)15号文批准,于1999年6月15日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期15年,发行规模为30亿份基金份额。

本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证上字(1999)第36号文审核同意,于1999年6月22日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字(1999)15号文的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中,投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2008年8月26日批准报出。

2、财务报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部于2006年2月15日颁布的企业会计准则(以下简称"企业会计准则")、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及《安顺证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

3、遵循企业会计准则的声明

本基金2008年半年度财务报告符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2008年6月30日的财务状况以及2008年1月1日至2008年6月30日的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

4、主要会计政策、会计估计及其变更

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相一致。自2007年7月1日起,本基金执行新会计准则及中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、修改后的基金合同及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。本基金已按照《企业会计准则第38号–首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及其他相关规定,对2007年1月1日起至2007年6月30日止期间(以下简称"2007年上半年")的财务报表予以追溯调整。

5、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2007]84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》,2008年4月23日财政部、国家税务总局发布的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。

(d)基金买卖股票于2008年4月24日前按0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起,按0.1%的税率缴纳。

6、重大会计差错的内容和更正金额

无。

7、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("华安基金公司")	基金管理人	提取管理费 持有本基金	基金合同
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人	提取托管费 银行间交易	基金合同 成交通知单
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东	持有本基金	
上海电气(集团)总公司	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		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东		
上海锦江国际投资管理有限公司	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).与关联方进行的交易

①本报告期通过关联人席位的股票成交量:无。

2007年上半年通过关联人席位的股票成交量:无。

②本报告期通过关联人席位的债券、回购和权证成交量:无。

2007年上半年通过关联人席位的债券、回购和权证成交量:无。

③本报告期与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

本基金与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

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
交通银行股份有限公司	0.00	109,148,312.31	0.00	0.00	0.00	0.00

2007年上半年基金与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易:

本基金与基金托管人交通银行通过银行间同业市场进行的债券交易如下:

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
交通银行股份有限公司	190,867,069.04	61,189,201.64	0.00	0.00	0.00	0.00

(3).关联方报酬

① 基金管理人的报酬

支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值(扣除本基金持有超出基金资产净值20%部分的现金资产)1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,具体计算方法如下:

日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.5%/当年天数。

本基金在本半年度需支付管理人报酬49,287,475.84元(2007年上半年:58,483,517.11元)。

② 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0.25%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X 0.25%/当年天数。

本基金在本半年度需支付基金托管费8,228,074.67元(2007年上半年:9,764,457.40元)。

(4).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2008年6月30日保管的银行存款余额为138,788,199.34元(2007年上半年末:150,285,482.89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3,592,355.02元(2007年上半年:1,661,046.08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2008年6月30日的相关余额26,886,260.28元计入"结算备付金"科目(2007年上半年末:23,161,530.92元)。

(5).基金各关联方投资本基金的情况

①基金管理公司投资本基金的情况:

2008年上半年基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	年初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有限公司	11,633,800	0.39%	–	–	11,633,800	0.39%	–

2007年上半年基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	期初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有限公司	11,633,800	0.39%	–	–	11,633,800	0.39%	–

②基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况:

关联人	2008年6月30日		2007年6月30日	
	持有份额	持有比例(%)	持有份额	持有比例(%)
上海国际信托有限公司	3,750,000	0.125	3,750,000	0.125

8、流通受限制不能自由转让的基金资产

1)流通受限制不能自由转让的股票

(a)基金可使用以基金名义开设的股票账户,比照个人投资者和一般法人、战略投资者参与新股认购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股或增发新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

本基金截至2008年6月30日止投资的流通受限制的股票情况如下:

股票代码	股票名称	成功申购日期	可流通日期	流通受限类型	申购价格	年末估值单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
600383	金地集团	2007–7–9	2008–7–4	非公开发行	26.00	9.07	8,000,000	208,000,000	72,560,000.00
600383	金地集团	2008–4–2	2008–7–4	非公开发行送股转增部分	–	9.07	8,000,000	–	72,560,000.00
600410	华胜天成	2007–9–13	2008–9–15	非公开发行	20.71	9.71	5,000,000	103,550,000	48,550,000.00
600410	华胜天成	2008–5–8	2008–9–15	非公开发行送股转增部分	–	9.71	1,000,000	–	9,710,000.00
000829	天音控股	2007–8–13	2008–8–18	非公开发行	29.90	4.84	5,800,000	173,420,000	28,072,000.00
000829	天音控股	2008–4–14	2008–8–18	非公开发行送股转增部分	–	4.84	4,640,000	–	22,457,600.00
600797	中储股份	2007–11–2	2008–10–31	非公开发行	8.60	5.54	6,000,000	51,600,000.00	33,240,000.00
000823	超声电子	2008–1–14	2009–1–16	非公开发行	7.17	4.98	3,000,000	21,510,000.00	14,940,000.00
601958	金钼股份	2008–4–11	2008–7–17	新股网下申购	16.57	17.02	674,220	11,171,825.40	11,475,224.40
002242	九阳股份	2008–5–20	2008–8–28	新股网下申购	22.54	40.44	47,488	1,070,379.52	1,920,414.72
002251	步步高	2008–6–11	2008–9–19	新股网下申购	26.08	48.55	22,142	577,463.36	1,074,994.10
002233	塔牌集团	2008–5–8	2008–8–18	新股网下申购	10.03	9.70	81,297	815,408.91	788,580.90
002241	歌尔声学	2008–5–16	2008–8–22	新股网下申购	18.78	26.84	24,635	462,645.30	661,203.40
002257	立立电子	2008–6–30	未知	新股网上申购	21.81	21.81	27,000	588,870.00	588,870.00
002230	科大讯飞	2008–4–29	2008–8–12	新股网下申购	12.66	30.09	17,585	222,626.10	529,132.65
002238	天威视讯	2008–5–14	2008–8–26	新股网下申购	6.98	12.25	39,463	275,461.74	483,421.75
002236	大华股份	2008–5–12	2008–8–20	新股网下申购	24.24	36.00	12,573	304,769.52	452,628.00
002250	联化科技	2008–6–10	2008–9–19	新股网下申购	10.52	12.80	26,001	273,530.52	332,812.80
002234	民和股份	2008–5–8	2008–8–18	新股网下申购	10.61	20.24	16,147	171,319.67	326,815.28
002225	濮耐股份	2008–4–17	2008–7–25	新股网下申购	4.79	6.50	46,153	221,072.87	299,994.50
002232	启明信息	2008–4–29	2008–8–11	新股网下申购	9.44	12.65	23,382	220,726.08	295,782.30
002235	安妮股份	2008–5–8	2008–8–18	新股网下申购	10.91	10.52	22,243	242,671.13	240,669.26
002239	金飞达	2008–5–14	2008–8–22	新股网下申购	9.33	8.98	26,180	244,259.40	235,096.40
002248	华东数控	2008–6–5	2008–9–12	新股网下申购	9.80	10.97	18,001	176,409.80	197,470.97
002247	帝龙新材	2008–5–30	2008–9–12	新股网下申购	16.06	14.65	13,026	209,067.30	190,830.90
002231	奥维通信	2008–4–29	2008–8–12	新股网下申购	8.46	8.50	21,837	184,741.02	185,614.50
合计								575,513,237.64	322,369,156.83

(b)截至2008年6月30日,本基金股票投资部分持有以下因将公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,这些股票将在重要信息披露完成后或所公布事项的重大影响消除后并经交易所批准后复牌。

股票代码	股票名称	停牌日期	年末估值单价	停牌原因	复牌日期	复牌开盘单价	数量	年末成本总额	年末估值总额
600900	长江电力	2008–5–8	14.65	公布重大事项	未知	未知	180,000	3,144,544.79	2,637,000.00
合 计								3,144,544.79	2,637,000.00

2)截至2008年6月30日,流通受限制不能自由转让的债券:无。

3)截至2008年6月30日,流通受限制不能自由转让的权证:无。

4)截至2008年6月30日,债券正回购交易中作为质押的债券:无。

5)截至2008年6月30日,买断式逆回购交易中取得的债券:无。

七、投资组合报告

(一)、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	1,961,127,368.50	48.45
	其中:股票	1,961,127,368.50	48.45
2	固定收益类投资	1,333,081,011.20	32.93
	其中:债券	1,333,081,011.20	32.93
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	–	–
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	–	–
5	银行存款和结算备付金合计	165,674,459.62	4.09
6	其他资产	588,199,312.03	14.53
	合计	4,048,082,151.35	100.00

(二)、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	326,815.28	0.01
B	采掘业	199,773,898.39	4.99
C	制造业	828,674,280.55	20.68
C0	食品、饮料	193,634,015.60	4.83
C1	纺织、服装、皮毛	48,099,396.40	1.20
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	240,669.26	0.01
C4	石油、化学、塑胶、塑料	355,942,729.90	8.88
C5	电子	107,282,701.40	2.68
C6	金属、非金属	51,348,934.72	1.28
C7	机械、设备、仪表	38,124,262.37	0.95
C8	医药、生物制品	14,940,740.00	0.37
C99	其他制造业	19,060,830.90	0.48
D	电力、煤气及水的生产和供应业	45,181,987.00	1.13
E	建筑业	56,160,000.00	1.40
F	交通运输、仓储业	127,227,360.50	3.18
G	信息技术业	310,039,479.05	7.74
H	批发和零售贸易	138,329,117.98	3.45
I	金融、保险业	72,509,248.00	1.81
J	房地产业	180,714,400.00	4.51
K	社会服务业	1,707,360.00	0.04
L	传播与文化产业	483,421.75	0.01
M	综合类	–	–
	合计	1,961,127,368.50	48.95

(三)、报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	600588	用友软件	6,980,000	195,230,600.00	4.87
2	601088	中国神华	4,482,307	168,400,273.99	4.20
3	600426	华鲁恒升	6,699,900	148,536,783.00	3.71
4	600383	金地集团	16,000,000	145,120,000.00	3.62
5	600309	烟台万华	7,599,990	142,347,812.70	3.55
6	600519	贵州茅台	900,000	124,722,000.00	3.11
7	002008	大族激光	8,000,000	90,640,000.00	2.26
8	002251	步步高	1,762,154	85,552,576.70	2.14
9	601398	工商银行	14,618,800	72,509,248.00	1.81
10	600026	中海发展	3,500,000	69,615,000.00	1.74

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于http://www.huaan.com.cn网站的半年度报告正文。

(四)、本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	600005	武钢股份	450,340,131.87	4.77
2	601088