

**华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金**  
**2010 年半年度报告**  
**2010 年 6 月 30 日**

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

报告送出日期：二〇一〇年八月二十五日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2010 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	6
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
3	主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1	主要会计数据和财务指标.....	7
3.2	基金净值表现.....	7
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	32
7.1	期末基金资产组合情况.....	32
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	34
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	47
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	47
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	47

7.9	投资组合报告附注.....	48
8	基金份额持有人信息.....	49
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	49
9	开放式基金份额变动.....	49
10	重大事件揭示.....	49
10.1	基金份额持有人大会决议.....	49
10.2	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.....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4	基金投资策略的改变.....	50
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	50
10.6	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况.....	50
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8	其他重大事件.....	52
11	备查文件目录.....	55

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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股增强指数	
基金主代码	040002	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
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	
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	
报告期末基金份额总额	6,803,851,402.27份	
基金合同存续期	不定期	

### 2.2 基金产品说明

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	<p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p>

业绩比较基准	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。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	蒋松云
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市浦东南路 360 号 新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李勍	姜建清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

### 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2010年1月1日至2010年6月30日）
本期已实现收益	20,134,152.57
本期利润	-1,446,169,105.60
加权平均基金份额本期利润	-0.2358
本期加权平均净值利润率	-28.10%
本期基金份额净值增长率	-25.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年6月30日)
期末可供分配利润	1,546,487,771.50
期末可供分配基金份额利润	0.2273
期末基金资产净值	4,762,376,630.76
期末基金份额净值	0.700
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010年6月30日)
基金份额累计净值增长率	189.84%

注：1、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、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	-7.53%	1.57%	-7.77%	1.60%	0.24%	-0.03%
过去三个月	-21.44%	1.68%	-21.92%	1.71%	0.48%	-0.03%
过去六个月	-25.24%	1.48%	-25.71%	1.50%	0.47%	-0.02%
过去一年	-15.73%	1.74%	-16.19%	1.78%	0.46%	-0.04%
过去三年	-27.80%	2.21%	-28.72%	2.25%	0.92%	-0.04%
自基金合同生效起至今	189.84%	1.70%	133.98%	1.75%	55.86%	-0.05%

注：业绩比较基准收益率=MSCI 中国 A 股指数收益率\*95%+金融同业存款利率\*5%，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95% 投资于股票，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。

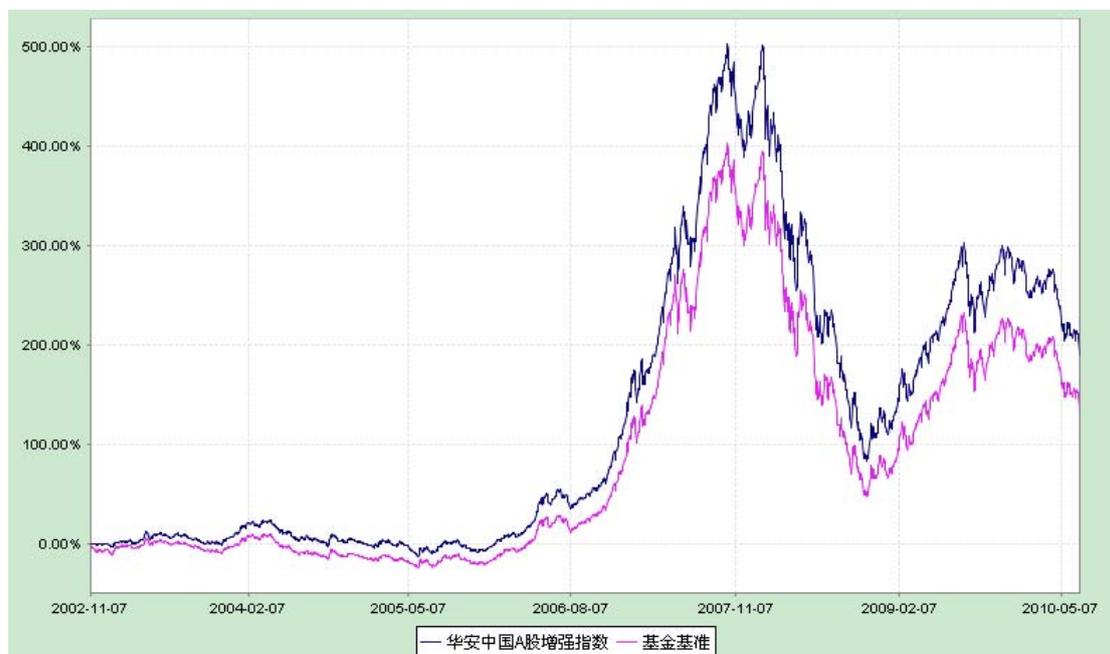
截至 2010 年 6 月 30 日，本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 94.2%，其中权证投资比例为 0。投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金净资产为 5.55%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计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

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

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

(2002 年 11 月 8 日至 2010 年 6 月 30 日)



## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2010 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证 180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安动态灵活配置混合、华安上证 180ETF 联接、华安行业轮动股票、华安国际配置(QDII)等 15 只开放式基金，管理资产规模达到 672.14 亿人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
许之彦	本基金的基金经理、风险管理和金融工程部总经理	2008-04-25	-	7 年	理学博士，7 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月起担任本基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及华安上证 180ETF 联接基金的基金经理。
刘璎	本基金的基金经理	2008-04-25	2010-06-26	9 年	管理学硕士，9 年证券从业经历。曾在交通银行工作，2001 年加入华安基金管理有限公司，历任市场部高级投资顾问、专户理财部客户主管、上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2007 年 3 月至 2010 年 6 月担任上证 180 交易型开放式指数

					证券投资基金的基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 6 月同时担任本基金的基金经理。
牛勇	本基金的基金经理助理	2009-07-03	-	6 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），6 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月起担任本基金的基金经理助理，2010 年 6 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 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《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-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”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

#### 4.3.2 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

本基金为增强型指数基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

上半年没有出现异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济在依靠投资拉动之后进入内生增长为主的阶段，宽松财政政策放缓，并出台空前严厉的地产调控政策，流动性增速亦出现拐点，市场从一季度开始对政策收紧有所反应，在 4 月地产调控政策出台后，地产等相关周期类行业先后深度调整，6 月里估值相对较高的医药、信息技术类等也随后调整，市场风险得到释放。基金在二季度适度降低仓位并且适度低配了地产、钢铁等周期行业，并对调整幅度较大的部分医药股有所增持。5 月底跟踪标的指数调整，新调入超过 100 个成份股使指数的市场代表性得到进一步增强。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内华安中国 A 股增强指数基金份额净值增长率为-25.24%，同期业绩比较基准增长率为-25.71%，基金净值表现领先比较基准 0.47%，截至 2010 年 6 月 30 日，本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.11%（按照基金合同和招募说明书规定）。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

政府推动经济结构转型的决心越发明确，尽管在结构调整中经济增长速度合理放缓，但政府调控仍存在空间，经济二次探底的可能性不大，代之以传统产业为支撑，新兴产业为突破的调整发展阶段，发展新兴产业、推进节能减排，提高城镇化与居民收入将是政策重点，也是我们行业配置与品种选择的重点。在市场与部分行业经历阶段性估值修复后，个股的成长性值得重点关注。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们继续坚持被动投资的原则，在充分拟合指数的前提下，通过适度增强策略，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化：

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响：

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、风险管理和金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

###### 相关人员专业胜任能力及工作经历：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任华安安信封闭的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

尚志民，基金投资部总经理，工商管理硕士，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，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部总经理，经济学硕士，13 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、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，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦，风险管理和金融工程部总经理，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接的基金经理，风

险管理和金融工程部总经理。

朱永红，基金运营部总经理，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。

#### (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

#### (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

#### 4、基金经理参与或决定估值的程度：

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

#### 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突：

无。

#### 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息：

无。

### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

#### 1、2009 年度在本报告期内实施的利润分配：

本基金的基金管理人于 2010 年 1 月 6 日宣告第 6 次分红，向截至 2010 年 1 月 14 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.20 元，权益登记日、除息日：2010 年 1 月 14 日；红利划出日、红利再投资日：2010 年 1 月 15 日。

#### 2、本报告期由于基金投资当期亏损，不进行收益分配。

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010 年上半年，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的托管过程中，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。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年上半年，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、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。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 118,966,417.38 元。

## 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安强化收益债券型证券投资基金 2010 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	93,739,259.46	215,981,984.63
结算备付金		6,425,053.67	6,464,790.97
存出保证金		522,583.24	1,274,503.49
交易性金融资产	6.4.7.2	4,665,614,599.97	5,521,556,952.13
其中：股票投资		4,486,073,866.77	5,423,216,952.13
基金投资		-	-
债券投资		179,540,733.20	98,340,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,229,030.00	12,125,887.19
应收利息	6.4.7.5	2,840,124.49	774,213.86

应收股利		1,274,920.46	-
应收申购款		13,545,014.60	13,195,975.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,785,190,585.89	5,771,374,307.49
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年6月30日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,612,329.86	-
应付赎回款		6,375,799.33	27,872,037.31
应付管理人报酬		4,156,342.77	4,788,139.85
应付托管费		831,268.56	957,627.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,134,342.51	3,159,033.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	703,872.10	755,700.90
负债合计		22,813,955.13	37,532,539.29
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,073,156,999.34	1,825,771,366.07
未分配利润	6.4.7.10	2,689,219,631.42	3,908,070,402.13
所有者权益合计		4,762,376,630.76	5,733,841,768.20
负债和所有者权益总计		4,785,190,585.89	5,771,374,307.49

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.700 元，基金份额总额 6,803,851,402.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至 2010年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年6月30日

<b>一、收入</b>		<b>-1,411,805,913.84</b>	<b>2,195,524,553.32</b>
1. 利息收入		1,623,932.82	3,017,968.14
其中：存款利息收入	6.4.7.11	695,996.29	963,590.71
债券利息收入		927,936.53	2,043,373.43
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	11,004.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		52,856,547.85	-106,549,660.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	26,833,289.89	-135,999,102.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	31,912.15	-497,600.00
资产支持证券投资		-	-
收益			
衍生工具收益	6.4.7.14	-	1,731,312.55
股利收益	6.4.7.15	25,991,345.81	28,215,728.93
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-1,466,303,258.17	2,299,056,246.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	16,863.66	-
<b>减：二、费用</b>		<b>34,363,191.76</b>	<b>40,206,438.80</b>
1. 管理人报酬		25,562,118.33	21,999,846.72
2. 托管费		5,112,423.69	4,399,969.36
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	3,474,429.81	13,563,530.31
5. 利息支出		-	19,896.73
其中：卖出回购金融资产支出		-	19,896.73
6. 其他费用	6.4.7.19	214,219.93	223,195.68
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,446,169,105.60</b>	<b>2,155,318,114.52</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,446,169,105.60</b>	<b>2,155,318,114.52</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日 至 2010 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,825,771,366.07	3,908,070,402.13	5,733,841,768.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,446,169,105.60	-1,446,169,105.60
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	247,385,633.27	346,284,752.27	593,670,385.54
其中：1. 基金申购款	684,166,162.04	1,153,251,123.50	1,837,417,285.54
2. 基金赎回款	-436,780,528.77	-806,966,371.23	-1,243,746,900.00
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-118,966,417.38	-118,966,417.38
五、期末所有者权益（基金净值）	2,073,156,999.34	2,689,219,631.42	4,762,376,630.76
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日 至 2009 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,139,499,094.43	1,487,817,179.07	3,627,316,273.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,155,318,114.52	2,155,318,114.52
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-326,465,247.79	-404,939,735.09	-731,404,982.88
其中：1. 基金申购款	1,698,963,524.23	2,221,361,001.93	3,920,324,526.16
2. 基金赎回款	-2,025,428,772.02	-2,626,300,737.02	-4,651,729,509.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,813,033,846.64	3,238,195,558.50	5,051,229,405.14

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勃，主管会计工作负责人：李炳旺，会计机构负责人：朱永红

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增强型证券投资基金，以下简称“本基金”)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[2002]第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》)发起，并于 2002 年 11 月 8 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,094,001,258.61 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 126 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金，跟踪标的的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 3.281806547，并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；此外，本基金可参与股票一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股，在成份股之外的股票投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

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 2010 年 8 月 24 日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则

—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及 2010 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 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]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
活期存款	93,739,259.46
定期存款	-
其他存款	-
合计	93,739,259.46

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,287,519,589.13	4,486,073,866.77	-801,445,722.36
债券	交易所市场	212,000.00	238,733.20
	银行间市场	179,290,700.00	179,302,000.00
	合计	179,502,700.00	179,540,733.20
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	5,467,022,289.13	4,665,614,599.97	-801,407,689.16

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2010年6月30日）衍生金融资产/负债余额为零。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2010年6月30日）买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2010年6月30日）买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应收活期存款利息	35,483.04
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,023.92
应收债券利息	2,796,266.26
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	6,351.27
其他	-
合计	2,840,124.49

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2010年6月30日）其他资产余额为零。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,131,136.32
银行间市场应付交易费用	3,206.19
合计	1,134,342.51

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2010年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
应付后端申购费	60.67
预提费用	203,811.43
合计	703,872.10

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,991,712,872.20	1,825,771,366.07
本期申购	2,245,544,924.69	684,166,162.04
本期赎回（以“-”号填列）	-1,433,406,394.62	-436,780,528.77
本期末	6,803,851,402.27	2,073,156,999.34

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,459,656,701.54	2,448,413,700.59	3,908,070,402.13
本期利润	20,134,152.57	-1,466,303,258.17	-1,446,169,105.60
本期基金份额交易产生的变动数	185,663,334.77	160,621,417.50	346,284,752.27
其中：基金申购款	517,079,618.05	636,171,505.45	1,153,251,123.50
基金赎回款	-331,416,283.28	-475,550,087.95	-806,966,371.23
本期已分配利润	-118,966,417.38	-	-118,966,417.38
本期末	1,546,487,771.50	1,142,731,859.92	2,689,219,631.42

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
活期存款利息收入	605,333.31
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	17,793.88
其他	72,869.10
合计	695,996.29

**6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出股票成交总额	988,248,158.41
减：卖出股票成本总额	961,414,868.52
买卖股票差价收入	26,833,289.89

**6.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	268,779,372.10
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	264,861,800.00
减：应收利息总额	3,885,659.95
债券投资收益	31,912.15

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本报告期（2010年1月1日至2010年6月30日）无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
股票投资产生的股利收益	25,991,345.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,991,345.81

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,466,303,258.17

——股票投资	-1,466,257,691.37
——债券投资	-45,566.80
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,466,303,258.17

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
基金赎回费收入	-
印花税手续费返还收入	16,863.66
合计	16,863.66

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
交易所市场交易费用	3,472,579.81
银行间市场交易费用	1,850.00
合计	3,474,429.81

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日 至 2010年6月30日
审计费用	55,043.91
信息披露费	148,767.52
债券托管账户维护费	9,000.00
银行划款手续费	1,408.50
合计	214,219.93

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

##### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的

**情况**

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**
**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**
**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)和上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)和上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金**

本基金本报告期(2010年1月1日至2010年6月30日)和上年度可比期间(2009年1月1日至2009年6月30日)均无应支付关联方的佣金。

**6.4.10.2 关联方报酬**
**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010 年6月30日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	25,562,118.33	21,999,846.72
其中：支付销售机构的客户维护费	1,075,695.50	701,062.36

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%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：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年6月30日		2009年1月1日至2009年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	5,112,423.69		4,399,969.36	

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期（2010年1月1日至2010年6月30日）和上年度可比期间（2009年1月1日至2009年6月30日）均无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期内（2010年1月1日至2010年6月30日）和上年度可比期间（2009年1月1日至2009年6月30日）均无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2010年6月30日）和上年度可比期末（2009年6月30日）均无投资本基金的情况。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年6月30日		2009年1月1日至2009年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	93,739,259.46	605,333.31	75,146,095.48	828,046.32

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2010年1月1日至2010年6月30日）和上年度可比期间（2009年1月1日至2009年6月30日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2010-01-14	2010-01-14	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	为2009年度在本报告期内实施的利润分配。
合计	-	-	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	-

#### 6.4.12 期末（2010年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300093	金刚玻璃	2010-06-30	2010-07-08	新股网上认购	16.20	16.20	500	8,100.00	8,100.00	
300094	国联水产	2010-06-30	2010-07-08	新股网上认购	14.38	14.38	500	7,190.00	7,190.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或者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，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值	复牌日期	复牌开盘	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	------	------	------	-------	--------	--------	----

				单价		单价				
600662	强生控股	2010-06-17	公告重大事项	6.99	2010-08-02	7.69	109,600	849,792.00	766,104.00	-
600675	中华企业	2010-05-17	公告重大事项	7.18	-	-	720,013	9,203,501.80	5,169,693.34	-
600816	安信信托	2010-06-02	公告重大事项	13.60	-	-	200,000	3,460,000.00	2,720,000.00	-
601318	中国平安	2010-06-29	重大资产重组停牌	44.55	-	-	2,880,229	132,415,167.96	128,314,201.95	-
601989	中国重工	2010-05-06	重大资产重组停牌	7.50	2010-07-16	6.71	1,039,897	8,003,282.76	7,799,227.50	-
000001	深发展	2010-06-30	重大资产重组停牌	17.51	-	-	2,599,934	53,852,530.66	45,524,844.34	-
000539	粤电力A	2010-06-30	重大资产重组停牌	6.45	2010-07-29	6.88	844,587	7,389,084.15	5,447,586.15	-

注：本基金截至2010年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末2010年6月30日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2010年6月30日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金

融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券（2009 年 12 月 31 日：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	93,739,259.46	-	-	-	93,739,259.46
结算备付金	6,425,053.67	-	-	-	6,425,053.67
存出保证金	-	-	-	522,583.24	522,583.24
交易性金融资产	179,540,733.20	-	-	4,486,073,866.77	4,665,614,599.97
应收证券清算款	-	-	-	1,229,030.00	1,229,030.00
应收利息	-	-	-	2,840,124.49	2,840,124.49

应收股利	-	-	-	1,274,920.46	1,274,920.46
应收申购款	6,682,832.88	-	-	6,862,181.72	13,545,014.60
资产总计	286,387,879.21	-	-	4,498,802,706.68	4,785,190,585.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	9,612,329.86	9,612,329.86
应付赎回款	-	-	-	6,375,799.33	6,375,799.33
应付管理人报酬	-	-	-	4,156,342.77	4,156,342.77
应付托管费	-	-	-	831,268.56	831,268.56
应付交易费用	-	-	-	1,134,342.51	1,134,342.51
其他负债	-	-	-	703,872.10	703,872.10
负债总计	-	-	-	22,813,955.13	22,813,955.13
利率敏感度缺口	286,387,879.21	-	-	4,475,988,751.55	4,762,376,630.76
上年度末 2009年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	215,981,984.63	-	-	-	215,981,984.63
结算备付金	6,464,790.97	-	-	-	6,464,790.97
存出保证金	-	-	-	1,274,503.49	1,274,503.49
交易性金融资产	98,340,000.00	-	-	5,423,216,952.13	5,521,556,952.13
应收证券清算款	-	-	-	12,125,887.19	12,125,887.19
应收利息	-	-	-	774,213.86	774,213.86
应收申购款	2,718,661.91	-	-	10,477,313.31	13,195,975.22
资产	-	-	-	-	-
资产总计	323,505,437.51	-	-	5,447,868,869.98	5,771,374,307.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,872,037.31	27,872,037.31
应付管理人报酬	-	-	-	4,788,139.85	4,788,139.85
应付托管费	-	-	-	957,627.97	957,627.97
应付交易费用	-	-	-	3,159,033.26	3,159,033.26
其他负债	-	-	-	755,700.90	755,700.90
负债总计	-	-	-	37,532,539.29	37,532,539.29
利率敏感度缺口	323,505,437.51	-	-	5,410,336,330.69	5,733,841,768.20

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新

定价日或到期日孰早予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 6 月 30 日, 本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.77%(2009 年 12 月 31 日: 1.72%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价, 因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份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。同时, 本基金根据股票市场的具体情况, 对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整以达到相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股, 投资组合中股票投资的目标比例为基金资产净值的 95%, 投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%; 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2010 年 6 月 30 日		2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,486,073,866.77	94.20	5,423,216,952.13	94.58
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,486,073,866.77	94.20	5,423,216,952.13	94.58

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币亿元)	
		本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约2.33	增加约2.79
	2. 业绩比较基准下降5%	下降约2.33	下降约2.33

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位: 人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,486,073,866.77	93.75
	其中: 股票	4,486,073,866.77	93.75
2	固定收益投资	179,540,733.20	3.75
	其中: 债券	179,540,733.20	3.75
	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	100,164,313.13	2.09

6	其他各项资产	19,411,672.79	0.41
7	合计	4,785,190,585.89	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	34,251,213.87	0.72
B	采掘业	384,061,858.83	8.06
C	制造业	1,647,546,370.24	34.60
C0	食品、饮料	204,894,974.81	4.30
C1	纺织、服装、皮毛	34,453,275.52	0.72
C2	木材、家具	1,620,984.00	0.03
C3	造纸、印刷	19,756,079.74	0.41
C4	石油、化学、塑胶、塑料	117,171,840.52	2.46
C5	电子	53,037,836.10	1.11
C6	金属、非金属	340,137,271.10	7.14
C7	机械、设备、仪表	614,892,143.99	12.91
C8	医药、生物制品	247,946,227.65	5.21
C99	其他制造业	13,635,736.81	0.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	157,061,690.37	3.30
E	建筑业	119,088,168.75	2.50
F	交通运输、仓储业	198,911,735.23	4.18
G	信息技术业	235,597,068.01	4.95
H	批发和零售贸易	248,025,692.55	5.21
I	金融、保险业	1,069,914,842.79	22.47
J	房地产业	223,423,531.15	4.69
K	社会服务业	47,494,501.47	1.00
L	传播与文化产业	25,788,565.56	0.54
M	综合类	94,893,337.95	1.99
	合计	4,486,058,576.77	94.20

### 7.2.2 积极资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,190.00	0.00

B	采掘业	-	-
C	制造业	8,100.00	0.00
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	8,100.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	15,290.00	0.00

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	11,419,039	148,561,697.39	3.12
2	601318	中国平安	2,880,229	128,314,201.95	2.69
3	600000	浦发银行	8,212,976	111,696,473.60	2.35
4	002024	苏宁电器	8,529,735	97,238,979.00	2.04
5	600016	民生银行	13,550,435	81,980,131.75	1.72
6	601166	兴业银行	3,468,615	79,882,203.45	1.68

7	601601	中国太保	3,264,420	74,330,843.40	1.56
8	601328	交通银行	11,885,465	71,431,644.65	1.50
9	600030	中信证券	6,032,241	70,577,219.70	1.48
10	600519	贵州茅台	494,426	62,970,095.36	1.32
11	601939	建设银行	13,350,593	62,747,787.10	1.32
12	000002	万科A	8,751,995	59,338,526.10	1.25
13	600050	中国联通	10,098,891	53,827,089.03	1.13
14	601169	北京银行	4,413,608	53,537,065.04	1.12
15	000001	深发展A	2,599,934	45,524,844.34	0.96
16	000063	中兴通讯	2,352,372	45,259,637.28	0.95
17	601088	中国神华	2,000,490	43,950,765.30	0.92
18	600900	长江电力	3,458,450	43,196,040.50	0.91
19	600028	中国石化	5,385,039	42,111,004.98	0.88
20	000651	格力电器	2,064,545	38,813,446.00	0.82
21	000983	西山煤电	2,076,364	37,706,770.24	0.79
22	601628	中国人寿	1,410,601	34,841,844.70	0.73
23	600031	三一重工	1,906,827	34,837,729.29	0.73
24	601857	中国石油	3,292,633	33,749,488.25	0.71
25	600015	华夏银行	2,972,183	33,050,674.96	0.69
26	600019	宝钢股份	4,757,858	28,023,783.62	0.59
27	601006	大秦铁路	3,338,909	27,278,886.53	0.57
28	600089	特变电工	1,836,111	26,917,387.26	0.57
29	000527	美的电器	2,214,814	25,248,879.60	0.53
30	601390	中国中铁	5,798,224	24,062,629.60	0.51
31	600196	复星医药	1,340,440	23,457,700.00	0.49
32	000568	泸州老窖	811,538	22,901,602.36	0.48
33	600111	包钢稀土	632,700	22,467,177.00	0.47
34	600100	同方股份	1,055,927	22,216,704.08	0.47
35	600489	中金黄金	425,351	21,973,632.66	0.46
36	601766	中国南车	4,546,021	21,911,821.22	0.46
37	601186	中国铁建	2,790,127	20,088,914.40	0.42
38	600875	东方电气	459,685	20,019,281.75	0.42
39	000157	中联重科	1,230,509	19,995,771.25	0.42
40	600547	山东黄金	537,017	19,547,418.80	0.41
41	600048	保利地产	1,893,547	19,370,985.81	0.41
42	600718	东软集团	1,062,132	19,182,103.92	0.40
43	000338	潍柴动力	310,726	19,109,649.00	0.40
44	000629	*ST 钒钛	2,368,550	18,948,400.00	0.40
45	601998	中信银行	3,491,867	18,856,081.80	0.40
46	600104	上海汽车	1,536,731	18,855,689.37	0.40
47	000069	华侨城 A	1,690,049	18,590,539.00	0.39

48	601607	上海医药	1,103,468	18,074,805.84	0.38
49	601111	中国国航	1,754,600	18,037,288.00	0.38
50	600276	恒瑞医药	450,924	17,617,600.68	0.37
51	601668	中国建筑	5,010,926	17,588,350.26	0.37
52	600739	辽宁成大	698,382	17,571,291.12	0.37
53	600550	天威保变	920,339	17,357,593.54	0.36
54	600348	国阳新能	1,312,250	17,085,495.00	0.36
55	600309	烟台万华	1,166,332	17,016,783.88	0.36
56	000402	金融街	2,027,170	16,866,054.40	0.35
57	000060	中金岭南	1,301,062	16,835,742.28	0.35
58	000538	云南白药	259,908	16,764,066.00	0.35
59	601898	中煤能源	1,974,431	16,565,476.09	0.35
60	600690	青岛海尔	861,099	16,446,990.90	0.35
61	600795	国电电力	5,013,850	16,395,289.50	0.34
62	002202	金风科技	1,050,000	16,327,500.00	0.34
63	600383	金地集团	2,652,019	16,071,235.14	0.34
64	000878	云南铜业	897,718	16,069,152.20	0.34
65	002007	华兰生物	349,120	15,738,329.60	0.33
66	600256	广汇股份	559,930	15,599,649.80	0.33
67	000858	五粮液	640,730	15,524,887.90	0.33
68	600642	申能股份	1,994,122	15,354,739.40	0.32
69	601299	中国北车	3,162,459	15,306,301.56	0.32
70	600029	南方航空	2,392,211	15,023,085.08	0.32
71	000800	一汽轿车	985,671	14,982,199.20	0.31
72	601988	中国银行	4,269,711	14,474,320.29	0.30
73	002123	荣信股份	448,708	14,358,656.00	0.30
74	600499	科达机电	712,000	14,240,000.00	0.30
75	601179	中国西电	2,191,500	14,222,835.00	0.30
76	600588	用友软件	647,377	14,138,713.68	0.30
77	000623	吉林敖东	526,249	13,977,173.44	0.29
78	600518	康美药业	1,128,640	13,859,699.20	0.29
79	600832	东方明珠	1,716,129	13,849,161.03	0.29
80	600177	雅戈尔	1,299,277	13,382,553.10	0.28
81	000792	盐湖钾肥	342,454	13,355,706.00	0.28
82	600660	福耀玻璃	1,497,526	13,327,981.40	0.28
83	600009	上海机场	1,106,355	13,154,560.95	0.28
84	000895	双汇发展	300,241	13,081,500.37	0.27
85	000839	中信国安	1,182,405	13,030,103.10	0.27
86	000933	神火股份	773,838	12,930,832.98	0.27
87	600585	海螺水泥	790,250	12,730,927.50	0.27
88	600859	王府井	373,572	12,701,448.00	0.27

89	600655	豫园商城	551,111	12,190,575.32	0.26
90	000898	鞍钢股份	1,676,017	12,033,802.06	0.25
91	601958	金钼股份	985,978	11,999,352.26	0.25
92	000541	佛山照明	1,005,074	11,940,279.12	0.25
93	601009	南京银行	1,185,976	11,907,199.04	0.25
94	601919	中国远洋	1,361,829	11,888,767.17	0.25
95	000768	西飞国际	1,209,216	11,850,316.80	0.25
96	000024	招商地产	788,977	11,739,977.76	0.25
97	600881	亚泰集团	1,908,617	11,680,736.04	0.25
98	000012	南玻A	1,275,130	11,667,439.50	0.24
99	600583	海油工程	2,316,559	11,490,132.64	0.24
100	600598	北大荒	1,002,733	11,421,128.87	0.24
101	601333	广深铁路	3,231,500	11,407,195.00	0.24
102	000061	农产品	715,980	11,369,762.40	0.24
103	601866	中海集运	3,365,990	11,343,386.30	0.24
104	600132	重庆啤酒	314,907	11,336,652.00	0.24
105	600298	安琪酵母	324,202	11,334,101.92	0.24
106	002152	广电运通	351,373	11,307,183.14	0.24
107	600320	振华重工	1,849,020	11,297,512.20	0.24
108	000729	燕京啤酒	569,766	11,281,366.80	0.24
109	600037	歌华有线	811,731	11,234,357.04	0.24
110	000422	湖北宜化	867,415	11,050,867.10	0.23
111	600011	华能国际	1,706,205	10,800,277.65	0.23
112	601699	潞安环能	345,026	10,792,413.28	0.23
113	600406	国电南瑞	276,312	10,607,617.68	0.22
114	600879	航天电子	1,040,900	10,409,000.00	0.22
115	601666	平煤股份	794,937	10,389,826.59	0.22
116	600631	百联股份	784,937	10,321,921.55	0.22
117	000612	焦作万方	608,227	10,285,118.57	0.22
118	600535	天士力	382,549	10,279,091.63	0.22
119	600741	华域汽车	1,266,508	10,208,054.48	0.21
120	000937	冀中能源	456,270	10,152,007.50	0.21
121	000401	冀东水泥	679,014	10,124,098.74	0.21
122	600062	双鹤药业	389,544	10,112,562.24	0.21
123	000039	中集集团	846,092	10,068,494.80	0.21
124	600839	四川长虹	2,706,370	9,986,505.30	0.21
125	000425	徐工机械	325,389	9,966,665.07	0.21
126	600809	山西汾酒	242,229	9,938,655.87	0.21
127	000009	中国宝安	1,144,179	9,839,939.40	0.21
128	600166	福田汽车	572,127	9,834,863.13	0.21
129	600970	中材国际	544,407	9,799,326.00	0.21

130	600315	上海家化	320,242	9,764,178.58	0.21
131	601600	中国铝业	1,061,673	9,735,541.41	0.20
132	600497	驰宏锌锗	612,617	9,679,348.60	0.20
133	000630	铜陵有色	656,899	9,531,604.49	0.20
134	600635	大众公用	1,410,101	9,334,868.62	0.20
135	000778	新兴铸管	1,475,792	9,208,942.08	0.19
136	600325	华发股份	885,578	9,059,462.94	0.19
137	000969	安泰科技	617,122	9,059,350.96	0.19
138	000783	长江证券	832,750	8,993,700.00	0.19
139	600694	大商股份	209,619	8,868,979.89	0.19
140	601618	中国中冶	2,192,600	8,792,326.00	0.18
141	600018	上港集团	2,302,170	8,771,267.70	0.18
142	600068	葛洲坝	840,706	8,768,563.58	0.18
143	000917	电广传媒	563,067	8,761,322.52	0.18
144	000528	柳工	475,308	8,759,926.44	0.18
145	600267	海正药业	348,218	8,757,682.70	0.18
146	000825	太钢不锈	1,697,954	8,625,606.32	0.18
147	600415	小商品城	440,708	8,620,248.48	0.18
148	600150	中国船舶	154,899	8,582,953.59	0.18
149	000759	武汉中百	774,160	8,345,444.80	0.18
150	000027	深圳能源	874,471	8,324,963.92	0.17
151	600085	同仁堂	367,513	8,324,169.45	0.17
152	600717	天津港	998,370	8,286,471.00	0.17
153	600581	八一钢铁	876,404	8,220,669.52	0.17
154	000652	泰达股份	1,147,400	8,146,540.00	0.17
155	600884	杉杉股份	519,000	8,143,110.00	0.17
156	600649	城投控股	948,877	8,131,875.89	0.17
157	600456	宝钛股份	422,031	8,098,774.89	0.17
158	600123	兰花科创	314,891	8,051,762.87	0.17
159	601899	紫金矿业	1,315,900	7,987,513.00	0.17
160	600811	东方集团	1,396,542	7,974,254.82	0.17
161	600895	张江高科	919,172	7,950,837.80	0.17
162	600006	东风汽车	1,780,240	7,922,068.00	0.17
163	600664	哈药股份	427,550	7,905,399.50	0.17
164	600388	龙净环保	298,750	7,875,050.00	0.17
165	600058	五矿发展	557,718	7,847,092.26	0.16
166	002038	双鹭药业	209,238	7,842,240.24	0.16
167	600479	千金药业	560,000	7,840,000.00	0.16
168	000999	华润三九	340,801	7,821,382.95	0.16
169	601989	中国重工	1,039,897	7,799,227.50	0.16
170	600500	中化国际	874,209	7,797,944.28	0.16

171	600208	新湖中宝	1,604,200	7,652,034.00	0.16
172	000581	威孚高科	554,288	7,538,316.80	0.16
173	600153	建发股份	661,021	7,489,367.93	0.16
174	600600	青岛啤酒	225,904	7,459,350.08	0.16
175	601168	西部矿业	751,881	7,360,914.99	0.15
176	600432	吉恩镍业	397,327	7,310,816.80	0.15
177	601808	中海油服	657,736	7,274,560.16	0.15
178	600316	洪都航空	219,429	7,258,711.32	0.15
179	000400	许继电气	275,900	7,250,652.00	0.15
180	600308	华泰股份	782,307	7,212,870.54	0.15
181	600220	江苏阳光	1,419,575	7,168,853.75	0.15
182	600269	赣粤高速	1,239,494	7,052,720.86	0.15
183	002106	莱宝高科	300,000	7,050,000.00	0.15
184	600418	江淮汽车	1,067,939	7,048,397.40	0.15
185	600216	浙江医药	274,200	7,041,456.00	0.15
186	000709	河北钢铁	1,856,172	6,886,398.12	0.14
187	600584	长电科技	615,000	6,838,800.00	0.14
188	600008	首创股份	1,221,757	6,683,010.79	0.14
189	600195	中牧股份	281,801	6,673,047.68	0.14
190	600812	华北制药	700,381	6,604,592.83	0.14
191	002001	新 和 成	256,400	6,576,660.00	0.14
192	600409	三友化工	1,113,000	6,566,700.00	0.14
193	000562	宏源证券	441,190	6,463,433.50	0.14
194	000559	万向钱潮	623,230	6,456,662.80	0.14
195	600026	中海发展	784,250	6,430,850.00	0.14
196	000680	山推股份	583,139	6,397,034.83	0.13
197	600820	隧道股份	762,903	6,393,127.14	0.13
198	600161	天坛生物	273,550	6,390,128.00	0.13
199	600271	航天信息	429,363	6,388,921.44	0.13
200	600312	平高电气	623,036	6,336,276.12	0.13
201	600872	中炬高新	876,800	6,304,192.00	0.13
202	600528	中铁二局	778,100	6,302,610.00	0.13
203	600570	恒生电子	416,918	6,262,108.36	0.13
204	600066	宇通客车	418,797	6,244,263.27	0.13
205	600628	新世界	557,300	6,225,041.00	0.13
206	600997	开滦股份	475,479	6,200,246.16	0.13
207	600010	包钢股份	2,067,633	6,182,222.67	0.13
208	000031	中粮地产	893,670	6,148,449.60	0.13
209	600703	三安光电	150,000	6,136,500.00	0.13
210	600079	人福医药	381,500	6,104,000.00	0.13
211	600067	冠城大通	774,527	6,087,782.22	0.13

212	000423	东阿阿胶	172,240	5,987,062.40	0.13
213	000488	晨鸣纸业	920,900	5,949,014.00	0.12
214	000869	张裕A	73,948	5,914,361.04	0.12
215	600125	铁龙物流	436,749	5,900,478.99	0.12
216	600033	福建高速	1,513,767	5,888,553.63	0.12
217	000762	西藏矿业	230,224	5,870,712.00	0.12
218	600546	山煤国际	328,200	5,825,550.00	0.12
219	600880	博瑞传播	344,200	5,792,886.00	0.12
220	000951	中国重汽	337,287	5,767,607.70	0.12
221	600886	国投电力	813,229	5,741,396.74	0.12
222	000758	中色股份	481,737	5,713,400.82	0.12
223	600435	中兵光电	492,900	5,688,066.00	0.12
224	601001	大同煤业	201,800	5,646,364.00	0.12
225	600143	金发科技	748,886	5,624,133.86	0.12
226	002028	思源电气	219,100	5,565,140.00	0.12
227	001696	宗申动力	549,610	5,540,068.80	0.12
228	000625	长安汽车	632,872	5,499,657.68	0.12
229	000539	粤电力A	844,587	5,447,586.15	0.11
230	600118	中国卫星	346,480	5,422,412.00	0.11
231	000501	鄂武商A	373,858	5,413,463.84	0.11
232	600549	厦门钨业	297,300	5,410,860.00	0.11
233	600428	中远航运	749,341	5,380,268.38	0.11
234	600770	综艺股份	333,495	5,369,269.50	0.11
235	601991	大唐发电	767,300	5,286,697.00	0.11
236	600498	烽火通信	211,463	5,269,657.96	0.11
237	000876	新希望	613,583	5,227,727.16	0.11
238	000021	长城开发	492,750	5,218,222.50	0.11
239	600580	卧龙电气	300,000	5,184,000.00	0.11
240	600675	中华企业	720,013	5,169,693.34	0.11
241	600858	银座股份	200,000	5,082,000.00	0.11
242	600596	新安股份	508,324	5,022,241.12	0.11
243	600602	广电电子	786,760	5,003,793.60	0.11
244	000807	云铝股份	635,593	4,976,693.19	0.10
245	000735	罗牛山	700,000	4,935,000.00	0.10
246	600331	宏达股份	477,524	4,932,822.92	0.10
247	600643	爱建股份	654,392	4,914,483.92	0.10
248	600804	鹏博士	547,600	4,884,592.00	0.10
249	600688	S上石化	637,800	4,872,792.00	0.10
250	000897	津滨发展	1,203,800	4,839,276.00	0.10
251	600517	置信电气	279,361	4,835,738.91	0.10
252	600005	武钢股份	1,125,418	4,828,043.22	0.10

253	000930	丰原生化	700,000	4,816,000.00	0.10
254	000900	现代投资	287,300	4,815,148.00	0.10
255	000088	盐田港	770,300	4,806,672.00	0.10
256	600674	川投能源	400,000	4,800,000.00	0.10
257	600108	亚盛集团	1,094,675	4,772,783.00	0.10
258	600808	马钢股份	1,503,383	4,765,724.11	0.10
259	000718	苏宁环球	548,000	4,734,720.00	0.10
260	600219	南山铝业	609,731	4,731,512.56	0.10
261	002008	大族激光	420,000	4,657,800.00	0.10
262	600533	栖霞建设	986,500	4,646,415.00	0.10
263	600395	盘江股份	255,500	4,599,000.00	0.10
264	000667	名流置业	1,457,680	4,591,692.00	0.10
265	600210	紫江企业	878,385	4,576,385.85	0.10
266	600138	中青旅	300,000	4,530,000.00	0.10
267	600170	上海建工	449,200	4,496,492.00	0.09
268	600004	白云机场	508,980	4,494,293.40	0.09
269	600611	大众交通	615,006	4,477,243.68	0.09
270	600362	江西铜业	185,384	4,460,339.04	0.09
271	600595	中孚实业	394,800	4,398,072.00	0.09
272	000786	北新建材	328,700	4,355,275.00	0.09
273	600797	浙大网新	700,000	4,270,000.00	0.09
274	000690	宝新能源	847,037	4,269,066.48	0.09
275	000932	华菱钢铁	1,118,200	4,215,614.00	0.09
276	601872	招商轮船	1,029,605	4,180,196.30	0.09
277	600352	浙江龙盛	454,524	4,136,168.40	0.09
278	000960	锡业股份	275,099	4,129,235.99	0.09
279	000726	鲁泰 A	502,160	4,117,712.00	0.09
280	600487	亨通光电	150,000	3,990,000.00	0.08
281	601588	北辰实业	1,077,200	3,953,324.00	0.08
282	601918	国投新集	387,701	3,942,919.17	0.08
283	600893	航空动力	162,389	3,936,309.36	0.08
284	600720	祁连山	328,800	3,935,736.00	0.08
285	600266	北京城建	349,491	3,931,773.75	0.08
286	600755	厦门国贸	313,300	3,903,718.00	0.08
287	600616	金枫酒业	367,164	3,902,953.32	0.08
288	600351	亚宝药业	500,000	3,900,000.00	0.08
289	600557	康缘药业	219,005	3,878,578.55	0.08
290	600582	天地科技	213,894	3,862,925.64	0.08
291	600052	浙江广厦	822,750	3,850,470.00	0.08
292	600236	桂冠电力	889,100	3,832,021.00	0.08
293	000089	深圳机场	727,559	3,826,960.34	0.08

294	600188	兖州煤业	229,555	3,769,293.10	0.08
295	600408	安泰集团	656,800	3,743,760.00	0.08
296	600183	生益科技	470,000	3,741,200.00	0.08
297	600597	光明乳业	505,741	3,722,253.76	0.08
298	600511	国药股份	169,492	3,689,840.84	0.08
299	000860	顺鑫农业	219,400	3,670,562.00	0.08
300	600425	青松建化	218,900	3,664,386.00	0.08
301	600481	双良节能	263,689	3,638,908.20	0.08
302	000886	海南高速	600,000	3,612,000.00	0.08
303	600835	上海机电	386,208	3,607,182.72	0.08
304	000417	合肥百货	250,000	3,600,000.00	0.08
305	000046	泛海建设	443,938	3,555,943.38	0.07
306	600825	新华传媒	383,700	3,549,225.00	0.07
307	600096	云天化	219,500	3,514,195.00	0.07
308	600022	济南钢铁	963,178	3,467,440.80	0.07
309	600064	南京高科	329,200	3,463,184.00	0.07
310	600169	太原重工	312,663	3,442,419.63	0.07
311	600663	陆家嘴	203,465	3,418,212.00	0.07
312	600748	上实发展	456,300	3,376,620.00	0.07
313	000685	中山公用	218,700	3,367,980.00	0.07
314	600508	上海能源	198,868	3,354,903.16	0.07
315	600416	湘电股份	150,000	3,342,000.00	0.07
316	002091	江苏国泰	150,000	3,339,000.00	0.07
317	000597	东北制药	219,200	3,325,264.00	0.07
318	600366	宁波韵升	250,000	3,287,500.00	0.07
319	600202	哈空调	263,100	3,254,547.00	0.07
320	600601	方正科技	675,174	3,220,579.98	0.07
321	000963	华东医药	133,750	3,180,575.00	0.07
322	600575	芜湖港	218,700	3,168,963.00	0.07
323	000550	江铃汽车	175,300	3,155,400.00	0.07
324	000961	中南建设	358,029	3,150,655.20	0.07
325	000959	首钢股份	1,007,500	3,143,400.00	0.07
326	601117	中国化学	800,000	3,136,000.00	0.07
327	000997	新大陆	269,200	3,117,336.00	0.07
328	600704	中大股份	219,985	3,114,987.60	0.07
329	600117	西宁特钢	519,371	3,111,032.29	0.07
330	600971	恒源煤电	136,499	3,109,447.22	0.07
331	600750	江中药业	100,000	3,085,000.00	0.06
332	000826	桑德环境	150,000	3,069,000.00	0.06
333	600098	广州控股	547,600	3,050,132.00	0.06
334	000677	山东海龙	635,700	2,981,433.00	0.06

335	000968	煤气化	219,100	2,979,760.00	0.06
336	600779	水井坊	159,223	2,932,887.66	0.06
337	600653	申华控股	827,058	2,902,973.58	0.06
338	000848	承德露露	80,400	2,894,400.00	0.06
339	600322	天房发展	712,800	2,893,968.00	0.06
340	000970	中科三环	250,000	2,885,000.00	0.06
341	600787	中储股份	433,619	2,874,893.97	0.06
342	600350	山东高速	630,400	2,874,624.00	0.06
343	002092	中泰化学	164,600	2,859,102.00	0.06
344	600638	新黄浦	323,319	2,858,139.96	0.06
345	600516	方大炭素	438,700	2,829,615.00	0.06
346	002022	科华生物	191,028	2,811,932.16	0.06
347	600867	通化东宝	280,080	2,806,401.60	0.06
348	600102	莱钢股份	337,248	2,799,158.40	0.06
349	000988	华工科技	200,000	2,794,000.00	0.06
350	002069	獐子岛	100,000	2,755,000.00	0.06
351	600162	香江控股	578,324	2,735,472.52	0.06
352	600087	长航油运	566,935	2,732,626.70	0.06
353	000926	福星股份	328,700	2,721,636.00	0.06
354	600816	安信信托	200,000	2,720,000.00	0.06
355	000016	深康佳 A	558,846	2,660,106.96	0.06
356	600460	士兰微	161,381	2,588,551.24	0.05
357	600307	酒钢宏兴	321,788	2,583,957.64	0.05
358	600737	中粮屯河	275,015	2,582,390.85	0.05
359	600317	营口港	438,100	2,567,266.00	0.05
360	601688	华泰证券	200,000	2,566,000.00	0.05
361	000816	江淮动力	548,200	2,543,648.00	0.05
362	000686	东北证券	109,659	2,542,992.21	0.05
363	000927	一汽夏利	328,600	2,540,078.00	0.05
364	600311	荣华实业	328,700	2,504,694.00	0.05
365	600251	XD 冠农股	164,000	2,486,240.00	0.05
366	600864	哈投股份	328,949	2,476,985.97	0.05
367	600639	浦东金桥	263,163	2,463,205.68	0.05
368	002122	天马股份	271,500	2,459,790.00	0.05
369	002194	武汉凡谷	186,200	2,457,840.00	0.05
370	002065	东华软件	100,000	2,410,000.00	0.05
371	000987	广州友谊	98,600	2,392,036.00	0.05
372	000912	泸天化	378,376	2,349,714.96	0.05
373	600410	华胜天成	200,000	2,342,000.00	0.05
374	600467	好当家	300,000	2,334,000.00	0.05
375	000725	京东方 A	800,000	2,288,000.00	0.05

376	000570	苏常柴 A	250,000	2,107,500.00	0.04
377	000100	TCL 集团	548,500	2,056,875.00	0.04
378	000823	超声电子	200,000	2,056,000.00	0.04
379	002237	恒邦股份	65,700	2,036,043.00	0.04
380	000683	远兴能源	328,700	2,011,644.00	0.04
381	600641	万业企业	292,458	1,930,222.80	0.04
382	002155	辰州矿业	109,600	1,886,216.00	0.04
383	600359	新农开发	150,000	1,876,500.00	0.04
384	002191	劲嘉股份	190,520	1,859,475.20	0.04
385	600072	中船股份	170,342	1,855,024.38	0.04
386	600993	马应龙	60,964	1,831,358.56	0.04
387	600020	中原高速	518,395	1,819,566.45	0.04
388	600523	贵航股份	120,000	1,800,000.00	0.04
389	600537	海通集团	100,000	1,799,000.00	0.04
390	002242	九阳股份	156,250	1,795,312.50	0.04
391	600863	内蒙华电	266,200	1,788,864.00	0.04
392	000078	海王生物	162,049	1,769,575.08	0.04
393	600586	金晶科技	194,112	1,739,243.52	0.04
394	000829	天音控股	120,000	1,735,200.00	0.04
395	000793	华闻传媒	321,400	1,651,996.00	0.03
396	002083	孚日股份	185,849	1,641,046.67	0.03
397	600747	大连控股	290,580	1,627,248.00	0.03
398	600221	海南航空	309,308	1,626,960.08	0.03
399	600978	宜华木业	328,800	1,620,984.00	0.03
400	600176	中国玻纤	98,370	1,581,789.60	0.03
401	600569	安阳钢铁	433,379	1,529,827.87	0.03
402	600685	广船国际	87,606	1,527,848.64	0.03
403	600983	合肥三洋	100,000	1,523,000.00	0.03
404	000608	阳光股份	219,400	1,452,428.00	0.03
405	600888	新疆众和	100,000	1,412,000.00	0.03
406	601107	四川成渝	218,900	1,411,905.00	0.03
407	600246	万通地产	263,200	1,368,640.00	0.03
408	002073	软控股份	88,639	1,324,266.66	0.03
409	000503	海虹控股	151,713	1,268,320.68	0.03
410	600122	宏图高科	109,600	1,250,536.00	0.03
411	000717	韶钢松山	328,800	1,173,816.00	0.02
412	600282	南钢股份	339,870	1,172,551.50	0.02
413	000636	风华高科	108,600	1,135,956.00	0.02
414	600270	外运发展	168,732	1,130,504.40	0.02
415	600823	世茂股份	99,438	1,127,626.92	0.02
416	000822	山东海化	212,269	1,093,185.35	0.02

417	000616	亿城股份	220,000	941,600.00	0.02
418	600426	华鲁恒升	76,813	902,552.75	0.02
419	600380	健康元	118,400	858,400.00	0.02
420	600198	大唐电信	54,700	830,893.00	0.02
421	600060	海信电器	64,000	771,200.00	0.02
422	600662	强生控股	109,600	766,104.00	0.02
423	000973	佛塑股份	54,700	655,306.00	0.01
424	600151	航天机电	54,800	489,912.00	0.01
425	000059	辽通化工	54,800	423,604.00	0.01
426	600785	新华百货	10,220	335,420.40	0.01
427	600239	云南城投	9,700	155,006.00	0.00
428	002146	荣盛发展	6,960	64,380.00	0.00
429	600139	西部资源	1,050	21,651.00	0.00

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票

#### 投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300093	金刚玻璃	500	8,100.00	0.00
2	300094	国联水产	500	7,190.00	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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比例（%）
1	600036	招商银行	73,095,190.45	1.27
2	601601	中国太保	65,124,492.43	1.14
3	002024	苏宁电器	55,648,562.56	0.97
4	000001	深发展 A	43,457,019.76	0.76
5	601166	兴业银行	43,230,946.52	0.75
6	601939	建设银行	41,829,620.11	0.73
7	600000	浦发银行	38,911,887.38	0.68
8	002202	金风科技	28,123,886.14	0.49
9	000651	格力电器	26,743,916.00	0.47
10	600028	中国石化	23,088,837.95	0.40
11	601318	中国平安	22,925,500.00	0.40

12	600030	中信证券	22,815,255.39	0.40
13	000063	中兴通讯	21,400,346.48	0.37
14	000983	西山煤电	19,769,678.82	0.34
15	601998	中信银行	19,675,350.80	0.34
16	601169	北京银行	17,821,383.66	0.31
17	601299	中国北车	17,573,745.56	0.31
18	600019	宝钢股份	17,135,866.39	0.30
19	000858	五粮液	16,597,470.41	0.29
20	601179	中国西电	16,104,334.00	0.28

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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比例 (%)
1	600036	招商银行	66,808,312.00	1.17
2	600519	贵州茅台	48,109,471.22	0.84
3	601318	中国平安	47,857,809.87	0.83
4	600550	天威保变	46,860,114.58	0.82
5	600030	中信证券	34,055,729.91	0.59
6	600000	浦发银行	33,097,188.76	0.58
7	000651	格力电器	28,417,495.90	0.50
8	601939	建设银行	25,800,000.00	0.45
9	600875	东方电气	24,140,021.10	0.42
10	601601	中国太保	23,605,714.00	0.41
11	601328	交通银行	22,435,327.54	0.39
12	600048	保利地产	22,045,367.38	0.38
13	600019	宝钢股份	21,309,975.41	0.37
14	601166	兴业银行	20,630,266.42	0.36
15	601919	中国远洋	15,862,459.97	0.28
16	600150	中国船舶	14,552,890.20	0.25
17	601088	中国神华	14,007,321.79	0.24
18	000402	金融街	13,166,727.91	0.23
19	600005	武钢股份	12,642,000.00	0.22
20	600588	用友软件	12,261,214.22	0.21

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,490,529,474.53
---------------	------------------

卖出股票的收入（成交）总额	988,248,158.41
---------------	----------------

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	179,302,000.00	3.76
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	238,733.20	0.01
7	其他	-	-
8	合计	179,540,733.20	3.77

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801017	08 央票 17	800,000	81,112,000.00	1.70
2	0901030	09 央票 30	500,000	49,120,000.00	1.03
3	0901046	09 央票 46	500,000	49,070,000.00	1.03
4	110009	双良转债	2,120	238,733.20	0.01

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	522,583.24
2	应收证券清算款	1,229,030.00
3	应收股利	1,274,920.46
4	应收利息	2,840,124.49
5	应收申购款	13,545,014.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,411,672.79

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601318	中国平安	128,314,201.95	2.69	重大资产重组停牌

#### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300093	金刚玻璃	8,100.00	0.00	新股网上认购
2	300094	国联水产	7,190.00	0.00	新股网上认购

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
264,217	25,751.00	1,289,642,825.99	18.95%	5,514,208,576.28	81.05%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,356,618.26	0.035%

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2002 年 11 月 8 日) 基金份额总额	3,094,001,262.00
本报告期期初基金份额总额	5,991,712,872.20
本报告期基金总申购份额	2,245,544,924.69
减：本报告期基金总赎回份额	1,433,406,394.62
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,803,851,402.27

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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). 2010 年 1 月 16 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司

股东会审议通过，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

(2). 2010 年 5 月 13 日，本基金管理人发布关于总经理任职的公告，经本公司董事会会议审议通过，聘任李勍先生任本公司总经理。董事长俞妙根先生不再兼任总经理职务。

(3). 2010 年 6 月 26 日，本基金管理人发布关于基金经理变更的公告，鉴于刘璎女士因个人原因提出辞职，经公司董事会审议通过，决定同意刘璎女士辞去华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金（简称：华安上证 180ETF）和华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金（简称：华安中国 A 股增强指数）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：无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 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况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

公司						
中国银河证券股份有限公司	1	840,557,324.76	34.63%	714,472.65	35.05%	-
中信建投证券有限责任公司	1	759,889,680.69	31.31%	645,906.10	31.69%	-
招商证券股份有限公司	1	412,918,691.36	17.01%	335,499.22	16.46%	-
广发证券股份有限公司	1	239,353,515.32	9.86%	194,476.11	9.54%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	174,267,073.61	7.18%	148,126.13	7.27%	-

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	16,115,531.00	100.00%	-	-	-	-

1、本报告期内，本基金交易单元无变更情况。

2、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，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

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

(2) 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门研究人员, 能够针对本基金业务需要, 提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(3) 具有战略规划和定位, 能够积极推动多边业务合作, 最大限度地调动整体资源, 为基金投资赢取机会;

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

### 3、 券商专用交易单元选择程序:

#### (1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部/市场部分别牵头并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》

研究发展部或基金投资部/市场部汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果, 择优选出拟新增单元, 填写《新增交易单元申请审核表》, 对拟新增交易单元的的必要性和合规性进行阐述。

#### (3) 候选交易单元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或基金投资部/市场部提交的《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《证券交易单元使用协议》, 并通知基金托管人。

## 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金参加中国邮储银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-04
2	关于旗下部分基金参加中国工商银行“2010倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-04
3	关于华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金第六次分红公告, 向基金持有人按每10份基金份额派发现金红利0.20元。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-06
4	关于新增广发华福证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-14
5	关于参加广发华福证券有限责任公司网上交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2010-01-14

		和公司网站	
6	关于旗下部分基金参加深圳发展银行定期定额申购费率优惠、网上银行及电话银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-01-18
7	关于电子直销平台开通“华安-交行网上直销”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-01-18
8	关于新增万联证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-03-15
9	关于新增第一创业证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-03-24
10	关于新增渤海银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-03-29
11	关于旗下基金在国海证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-03-29
12	关于参加华夏银行延长网上银行基金申购费率优惠及定投申购费率优惠活动期限的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-04-01
13	关于参加中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-04-01
14	关于新增乌鲁木齐市商业银行为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-04-09
15	关于新增中天证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-04-13
16	关于新增厦门证券有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》	2010-04-20

		和公司网站	
17	关于旗下基金持有的“中信证券”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-04-27
18	关于新增东莞银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-04-28
19	关于旗下基金持有的“中信证券”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-05-06
20	关于新增西南证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-05-12
21	关于旗下基金持有的“双汇发展”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-05-18
22	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、华安策略优选股票型证券投资基金参加中国农业银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-05-26
23	关于新增中国农业银行股份有限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、华安策略优选股票型证券投资基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-05-26
24	关于旗下基金参加中信银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-06-01
25	关于新增大通证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-06-02
26	关于旗下基金在申银万国证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-06-04
27	关于北京分公司办公地址变更的公告	《上海证券报》、	2010-06-18

		《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	
28	关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-06-29
29	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-06-30
30	关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-06-30
31	关于旗下基金持有的“中国平安”股票估值调整的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-07-02
32	关于新增英大证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-07-07
33	关于新增华泰联合证券有限责任公司为华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金代销机构及定期定额、网上申购费率优惠的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-07-15
34	关于旗下基金在信达证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-07-19
35	关于参加信达证券股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2010-07-19

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 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》及其更新

- 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  
二〇一〇年八月二十五日