

中小企业板交易型开放式指数基金

2007 年半年度报告

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇〇七年八月二十八日

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2007 年 8 月 8 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。

本报告期自 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止。本报告中的财务资料未经审计。

目 录

一、基金简介.....	1
二、主要财务指标和基金净值表现.....	2
（一）主要会计数据和财务指标.....	3
（二）基金净值表现.....	3
三、管理人报告.....	4
四、托管人报告.....	7
五、财务会计报告.....	7
（一）基金会计报表.....	7
（二）会计报表附注.....	10
六、投资组合报告.....	17
（一）报告期末基金资产组合情况.....	17
（二）报告期末按行业分类的股票投资组合.....	17
（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细.....	18
（四）报告期内股票投资组合的重大变动.....	21
（五）报告期末按券种分类的债券投资组合.....	23
（六）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细.....	23
（七）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细.....	23
（八）投资组合报告附注.....	23
七、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人.....	24
（一）持有人户数.....	24
（二）持有人结构.....	24
（三）报告期末本基金前十名场内基金份额持有人情况.....	24
（四）报告期末本基金管理人基金从业人员持有本基金情况.....	25
八、开放式基金份额变动.....	25
九、重大事件揭示.....	25
十、基金管理人简介.....	27
十一、备查文件目录.....	29

一、基金简介

（一）基金基本情况

基金名称：中小企业板交易型开放式指数基金

基金简称：中小板 ETF

交易代码：159902

基金运作方式：交易型开放式

基金合同生效日：2006 年 6 月 8 日

报告期末基金份额总额：1,770,461,442.39 份

基金合同存续期：不定期

上市交易所：深圳证券交易所

基金上市日：2006 年 9 月 5 日

（二）基金产品说明

基金投资目标：紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

基金投资策略：本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

业绩比较基准：本基金的业绩比较基准为“中小企业板价格指数”。

风险收益特征：本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪反映中小企业板市场的标的指数，是股票基金中风险较高的产品。

（三）基金管理人有关情况

基金管理人名称：华夏基金管理有限公司

CHINA ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.

注册地址：北京市顺义区天竺空港工业区 A 区

办公地址：北京市西城区金融大街 33 号通泰大厦 B 座 8 层

邮政编码：100032

法定代表人：凌新源

信息披露负责人：廖为

联系电话：（010）88066688

传真：（010）88066566

国际互联网址：<http://www.ChinaAMC.com>

电子邮箱：chinaamc@ChinaAMC.com

（四）基金托管人有关情况

基金托管人名称：中国建设银行股份有限公司（简称“中国建设银行”）

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码：100032

法定代表人：郭树清

信息披露负责人：尹东

联系电话：（010）67595104

传真：（010）66275853

国际互联网址：<http://www.ccb.com>

电子邮箱：yindong@ccb.cn

（五）信息披露事宜

信息披露报纸名称：《证券时报》。

登载半年度报告正文的管理人互联网网址：www.ChinaAMC.com

基金半年度报告置备地点：本报告在基金管理人和基金托管人的住所有置备，投资者可要求查阅、复制。

（六）其他有关资料

注册登记机构名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

办公地址：中国北京西城区金融大街 27 号投资广场 22 层

二、主要财务指标和基金净值表现

重要提示：下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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一) 主要会计数据和财务指标

项目	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
基金本期净收益	950,476,842.81 元
基金份额本期净收益	0.5085 元
期末可供分配基金收益	969,600,966.69 元
期末可供分配基金份额收益	0.5477 元
期末基金资产净值	3,729,923,491.33 元
期末基金份额净值	2.107 元
基金加权平均净值收益率	27.86%
本期基金份额净值增长率	76.47%
基金份额累计净值增长率	110.70%

(二) 基金净值表现

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

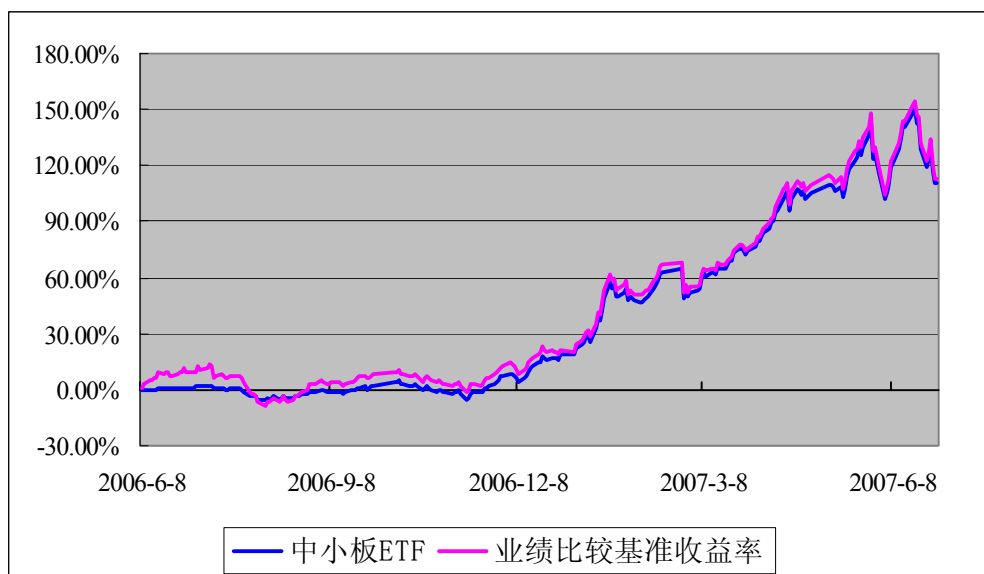
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过 去 一 个 月	-6.52%	3.28%	-7.21%	3.36%	0.69%	-0.08%
过 去 三 个 月	21.09%	2.66%	21.24%	2.74%	-0.15%	-0.08%
过 去 六 个 月	76.47%	2.53%	76.10%	2.59%	0.37%	-0.06%
过 去 一 年	108.82%	1.92%	94.77%	2.11%	14.05%	-0.19%
自基金合同生效起至今	110.70%	1.86%	113.21%	2.06%	-2.51%	-0.20%

2、基金合同生效以来基金份额净值的变动情况，并与同期业绩比较基准的变动的比较

中小企业板交易型开放式指数基金累计份额净值增长率

及同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006 年 6 月 8 日至 2007 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2006 年 6 月 8 日生效，2006 年 9 月 5 日在深圳证券交易所上市并于 2006 年 9 月 5 日开始办理申购、赎回业务。

2、本基金跟踪标的指数的投资组合资产不低于基金资产净值的 90%。本基金按规定在基金合同生效之日起 3 个月的时间内达到这一投资比例。

三、管理人报告

（一）基金管理人及基金经理情况

1、基金管理人及其管理基金的经验

本基金基金管理人为华夏基金管理有限公司。华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准的首批全国性基金管理公司之一，注册资本 13800 万元。公司总部设在北京，在北京、上海和深圳设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人及中国内地首只 ETF 基金管理人。华夏基金还成为国内基金公司首批获得 QDII 业务资格的基金管理公司，并且是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 2007 年 6 月，华夏基金管理有限公司管理资产规模超过 1400 亿元人民币，管理着兴华、兴和、兴安 3 只封闭式基金，华夏成长、华夏债券、华夏回报、华夏现金增利、华夏大盘精选、50ETF、华夏红利、中小板 ETF、华夏回报二号、华夏稳增、华夏优势增长、华夏蓝筹 12 只开放式基金，以及亚洲债券基金二期中国子基金、全国社保基金投资组合和多只企业年金。

2、基金经理简介

方军先生，硕士。1999 年加入华夏基金管理有限公司，历任研究员、华夏成长证券投资基金基金经理助理、兴华证券投资基金基金经理助理和华夏回报证券投资基金基金经理助理。现任上证 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2004 年 12 月起任职）、中小企业板交易型开放式指数基金基金经理（2006 年 6 月起任职）。

（二）报告期内基金运作的合规守信情况的说明

1、基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

2、内部监察工作报告

报告期内，本基金管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，发现问题及时敦促有关部门整改，并定期制作监察报告报公司管理层。报告期内，本基金管理人内部监察工作重点加强了以下几个方面：

- （1）对业务部门进行了相关法律培训。
- （2）进一步完善了有关合同审查的制度。
- （3）制定了员工投资证券投资基金的有关制度。
- （4）加强了对投资人员的检查监督。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，保障了基金份额持有人利益。我们将继续以风险控制为核心，提高内部监察工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

（三）报告期内基金投资策略和业绩表现的说明与解释

1、本基金业绩表现

截至 2007 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 2.107 元，本报告期份额净值增长率为 76.47%，同期中小企业板价格指数累计增长率为 76.10%。本基金本报告

期累计跟踪偏离度为 0.29%。

2、行情回顾及运作分析

2007年2季度GDP增长率达到11.9%，超出市场预期。消费、投资和出口都出现加速，贸易顺差继续扩大。6月份CPI 同比增长4.4%，为2004年以来的最高值。但是固定资产投资增速较去年同期还是明显放缓，PPI 涨幅甚至达到了今年最低点，整体来看宏观经济并没有出现全面过热的情况。

本报告期内市场走出单边上涨行情。个股涨幅以券商概念以及央企整体上市概念最为耀眼。行情上涨也表现出高度的投机性，低价股和 ST 股大幅上涨，传统基金重仓股和银行股则表现相对落后。5 月 30 日财政部调高印花税后，市场随即大幅下跌，之后展开振荡行情。此阶段低价股和 ST 股大幅下跌，传统的大盘蓝筹股如银行、保险等行业则表现出明显的抗跌性。本报告期内中小板 P 指数在“苏宁电器”的带领下上涨 76.10%，在本轮上涨行情中表现强于上证指数。

本报告期中小板 ETF 的操作主要集中在指数结构调整上。上半年完成了中小板 P 指数成份股的定期调整以及限售股上市带来的结构调整，中小板股票相对较差的流动性给我们的结构调整带来了一定的困难。同时中小板 ETF 日常的场外申购、赎回也增加了对组合仓位控制的难度。操作中，我们严格按照基金合同和公司投资决策委员会制定的有关投资策略，本着尽量降低成本、减少市场冲击的原则逐步调整组合。期间我们较好地把握住了市场节奏，在不造成净值大幅波动的情况下，降低了组合调整的成本费用；同时，在允许的范围内尽量参与获利机会较大的新股申购，提高资金的使用效率。本报告期内中小板 ETF 平均仓位保持在 96.5%以上。

（四）宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观经济良好运行、上市公司业绩持续增长、人民币加速升值以及储蓄搬家等大背景下，牛市的基础没有变化。同时受宏观调控力度加大、新股发行和再融资节奏加快、“大非”逐步开始流通等因素的影响，下半年证券市场的震荡会有所加剧。

中小板股票具有很明显的成长性优势和长期投资价值。我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利机会的投资目标。但市场的变化和不确定性也会对中小板公司产生影响，尤其作为高

成长性的中小盘板块，中小板股票的波动性也相对较大。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，中小板 ETF 将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

四、托管人报告

中国建设银行股份有限公司根据《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》和《中小企业板交易型开放式指数基金托管协议》，托管中小企业板交易型开放式指数基金（以下简称中小板 ETF）。

本报告期，中国建设银行股份有限公司在中小板 ETF 的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，依法安全保管了基金财产，按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告，不存在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。

本报告期，按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，本托管人对基金管理人—华夏基金管理有限公司在中小板 ETF 投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

由中小板 ETF 基金管理人—华夏基金管理有限公司编制，并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确和完整。

五、财务会计报告

（一）基金会计报表

中小企业板交易型开放式指数基金

2007 年 6 月 30 日资产负债表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

2007 年 6 月 30 日 2006 年 12 月 31 日

附注

资产

银行存款	7a	174,162,055.78	82,194,885.50
清算备付金	7b	577,081.56	882,424.51
交易保证金	7b	2,053,576.26	4,038,726.46
应收证券清算款		987,105.07	12,027,214.12
应收股利		-	-
应收利息	7c	57,408.17	25,575.86
其他应收款	7d	4,988,965.00	45,381,811.93
股票投资市值		3,565,440,744.78	2,222,208,198.43
其中：股票投资成本		2,472,920,645.95	1,841,159,132.50
债券投资市值		5,286,508.37	-
其中：债券投资成本		3,118,700.00	-
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
资产总计		3,753,553,444.99	2,366,758,836.81

负债及持有人权益

负债

应付证券清算款		-	5,345,530.64
应付赎回款		10,298,388.42	9,697,860.12
应付赎回费		38,813.10	36,549.61
应付管理人报酬		1,622,154.74	1,074,100.26
应付托管费		324,430.95	214,820.07
应付佣金	7e	3,951,624.20	2,105,134.96
其他应付款	7f	7,265,610.52	1,000,004.12
预提费用	7g	128,931.73	120,000.00
负债合计		23,629,953.66	19,593,999.78

持有人权益

实收基金	7h	1,770,461,442.39	1,965,122,498.64
未实现利得	7i	989,861,082.25	302,704,688.42
未分配收益		969,600,966.69	79,337,649.97
持有人权益合计		3,729,923,491.33	2,347,164,837.03
(2007 年 6 月 30 日每份基金份额净值：2.107 元)			
(2006 年末每份基金份额净值：1.194 元)			
负债及持有人权益总计		3,753,553,444.99	2,366,758,836.81

中小企业板交易型开放式指数基金
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
经营业绩表及收益分配表

(除特别注明外，金额单位为人民币元)

		2006 年 6 月 8 日(基金 合同生效日)至 2006 年 6 月 30 日止期间	
	附注	本期数	
收入			
股票差价收入	7j	943,165,990.15	-
债券差价收入		-	-
权证差价收入		-	-
债券利息收入		15,461.92	-
存款利息收入		756,273.99	1,673,450.90
股利收入		13,732,222.31	1,386,964.85
其他收入	7k	3,099,215.68	14,444.98
收入合计		960,769,164.05	3,074,860.73
费用			
基金管理人报酬		(8,467,002.56)	(1,147,437.17)
基金托管费		(1,693,400.54)	(240,352.14)
其他费用	7l	(131,918.14)	(23,583.14)
其中：上市年费		(29,752.78)	-
信息披露费		(39,671.58)	(11,111.07)
审计费		(59,507.37)	(11,111.07)
费用合计		(10,292,321.24)	(1,411,372.45)
基金净收益		950,476,842.81	1,663,488.28
加：未实现估值增值变动数		713,637,535.27	32,551,113.90
基金经营业绩		1,664,114,378.08	34,214,602.18
本期基金净收益		950,476,842.81	1,663,488.28
加：期初累计基金净收益		79,337,649.97	-
本期申购基金份额的损益平准金		582,536,256.42	-
本期赎回基金份额的损益平准金		(642,749,782.51)	-
可供分配基金净收益		969,600,966.69	1,663,488.28
减：本期已分配基金净收益		-	-
期末未分配基金净收益		969,600,966.69	1,663,488.28

中小企业板交易型开放式指数基金
2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
基金净值变动表

(除特别注明外, 金额单位为人民币元)

2006 年 6 月 8 日(基金
合同生效日)至 2006 年

	附注	本期数	6 月 30 日止期间
期初基金净值		2,347,164,837.03	3,965,967,258.69
本期经营活动			
基金净收益		950,476,842.81	1,663,488.28
未实现估值增值变动数		713,637,535.27	32,551,113.90
经营活动产生的基金净值变动数		1,664,114,378.08	34,214,602.18
本期基金份额交易			
基金申购款		4,007,770,047.70	-
基金赎回款		(4,289,125,771.48)	-
基金份额交易产生的基金净值变动数		(281,355,723.78)	-
本期向基金持有人分配收益			
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数		-	-
期末基金净值		3,729,923,491.33	4,000,181,860.87

后附会计报表附注为本会计报表的组成部分。

(二) 会计报表附注

(除特别标明外, 金额单位为人民币元)

1、基金基本情况

中小企业板交易型开放式指数基金(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[2006]第 92 号《关于同意中小企业板交易型开放式指数基金设立的批复》核准,由华夏基金管理有限公司依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他有关规定以及《中小企业板交易型开放式指数基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式, 存续期限不定, 首次设立募集不包括认购资金利息共募集 3,965,335,792.44 元, 业经普华永道中天会计师事务所有限公

司普华永道中天验字(2006)第 66 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中小企业板交易型开放式指数基金合同》于 2006 年 6 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,965,967,258.69 份基金份额,其中认购资金利息折合 631,466.25 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中小企业板交易型开放式指数基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股,可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2006]第 106 号文审核同意,本基金 2,329,107,641 份基金份额于 2006 年 9 月 5 日在深交所挂牌交易。投资者可使用深圳证券账户,采用组合证券方式,通过深交所场内系统办理申购、赎回业务(以下简称“场内申购、赎回”)。投资者可使用开放式基金账户,采用现金方式,通过基金管理人办理场外申购、赎回业务(以下简称“场外申购、赎回”)。自 2006 年 9 月 11 日起,投资者可使用开放式基金账户,采用现金方式,通过中国建设银行办理场外申购、赎回。

根据《中小企业板交易型开放式指数基金招募说明书》及《华夏基金管理有限公司关于中小企业板交易型开放式指数基金调整场外申购、赎回价格计算方法的公告》,基金管理人将对当日场外申购、赎回进行轧差处理,对于超过上个交易日基金总份额的 1%的净申购、净赎回资金根据当日申购赎回清单买入相应的组合证券对价或根据当日申购赎回清单卖出相应的组合证券对价。

2、会计报表编制基础

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《中小企业板交易型开放式指数基金合同》及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、主要会计政策和会计估计

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

4、主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金

有关税收问题的通知》、财税字[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《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项规定如下:

营业税

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。

基金买卖股票、债券的差价收入,自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税。

所得税

基金买卖股票、债券的差价收入,自 2004 年 1 月 1 日起继续免征企业所得税。

基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日起基金从上市公司取得的股息红利所得,暂减按 50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定代扣代缴个人所得税。

股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税和个人所得税。

印花税

自 2005 年 6 月 13 日起股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

基金买卖股票于 2007 年 5 月 30 日前按照 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,自 2007 年 5 月 30 日起按 0.3%的税率缴纳。

5、本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6、重大关联方关系及关联方交易

(1) 关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人、基金场外申购赎回销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金场外申购赎回销售机构
中信证券股份有限公司	基金管理人的股东、场内申购赎回销售机构
西南证券有限责任公司	基金管理人的股东
北京证券有限责任公司	基金管理人的股东
中国科技证券有限责任公司	基金管理人的股东

北京市国有资产经营有限责任公司

基金管理人的原股东

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) 通过关联方席位进行的证券交易及交易佣金

本报告期及上年同期（2006 年 6 月 8 日基金合同生效日至 2006 年 6 月 30 日止）本基金未租用关联方席位进行证券交易。

(3) 基金管理人报酬

支付基金管理人华夏基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%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：
日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金管理人报酬 8,467,002.56 元，上年同期（2006 年 6 月 8 日基金合同生效日至 2006 年 6 月 30 日止）：1,147,437.17 元。

(4) 基金托管费

支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%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 × 0.1% / 当年天数。

本基金在本报告期需支付基金托管费 1,693,400.54 元，上年同期（2006 年 6 月 8 日基金合同生效日至 2006 年 6 月 30 日止）：240,352.14 元。

(5) 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中国建设银行保管，并按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 174,162,055.78 元（2006 年 6 月 30 日：2,760,367,093.48 元）。本期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 530,966.18 元，上年同期（2006 年 6 月 8 日基金合同生效日至 2006 年 6 月 30 日止）：1,673,450.90 元。

(6) 与关联方通过银行间同业市场进行的债券（含回购）交易

本基金报告期内与上年同期（2006 年 6 月 8 日基金合同生效日至 2006 年 6 月 30 日止）未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

(7) 本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构持有的基金份额

本基金关联方及基金管理公司主要股东的控制机构在本报告期期末及上年同期期末未持有基金份额，本基金管理人在本报告期间及上年同期（2006 年 6 月 8 日基金合同生效日至 2006 年 6 月 30 日止）未持有基金份额。

7、基金会计报表重要项目说明

a、银行存款

	2007 年 6 月 30 日
活期存款	174,162,055.78
定期存款	-
合计	174,162,055.78

b、清算备付金和交易保证金

	2007 年 6 月 30 日
清算备付金	577,081.56
其中：最低清算备付金	577,081.56
交易保证金	2,053,576.26
其中：深圳交易保证金	2,053,576.26

c、应收利息

	2007 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	40,652.02
应收债券利息	15,461.92
应收申购款利息	868.11
应收清算备付金利息	426.12
合计	57,408.17

d、其他应收款

	2007 年 6 月 30 日
赎回待结转	4,988,965.00
合计	4,988,965.00

e、应付佣金

	2007 年 6 月 30 日
中国银河证券股份有限公司	1,650,736.43
国泰君安证券股份有限公司	1,447,334.83
申银万国证券股份有限公司	604,453.50
光大证券股份有限公司	249,099.44
合计	3,951,624.20

f、其他应付款

	2007 年 6 月 30 日
申购待结转	5,986,758.00
应付券商席位保证金	1,000,000.00
可退替代款	242,850.10
应付替代款	35,508.30
可退替代款估值增值	490.00
其他应付款	4.12
合计	7,265,610.52

g、预提费用

	2007 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费用	39,671.58
上市费用	29,752.78
合计	128,931.73

h、实收基金

	基金份额数（份）	金额
2006 年 12 月 31 日	1,965,122,498.64	1,965,122,498.64
本期申购	2,181,483,934.23	2,181,483,934.23
本期赎回	(2,376,144,990.48)	(2,376,144,990.48)
2007 年 6 月 30 日	1,770,461,442.39	1,770,461,442.39

i、未实现利得

	未实现估值 增值/（减值）(1)	未实现利得 /(损失)平准金	合计
2006 年 12 月 31 日	381,049,881.93	(78,345,193.51)	302,704,688.42
本期净变动数	713,637,535.27	-	713,637,535.27
本期申购基金份额	-	1,243,749,857.05	1,243,749,857.05
本期赎回基金份额	-	(1,270,230,998.49)	(1,270,230,998.49)
2007 年 6 月 30 日	1,094,687,417.20	(104,826,334.95)	989,861,082.25

（1）未实现估值增值/（减值）按投资类别分项列示如下：

	2007 年 6 月 30 日
股票投资	1,092,520,098.83
债券投资	2,167,808.37
可退替代款	(490.00)
合计	1,094,687,417.20

j、股票差价收入

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
卖出及赎回转出股票成交总额	3,239,431,303.10
减：应付佣金总额	(915,321.81)
减：卖出及赎回转出股票成本总额	(2,295,349,991.14)
股票差价收入	943,165,990.15

本报告期本基金无因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价。

k、其他收入

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
赎回费收入（1）	3,012,626.21
替代损益	86,589.47
合计	3,099,215.68

（1）根据《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》及《中小企业板交易型开放

式指数基金招募说明书（更新）》的有关规定，投资者在办理场外赎回时需交纳赎回费用，赎回费率为赎回总额的 0.5%。所收取赎回费用的 25% 须归入基金资产，其余用作销售机构、登记结算机构的手续费。

1、其他费用

	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间
审计费用	59,507.37
信息披露费	39,671.58
上市年费	29,752.78
银行费用	2,986.41
合计	131,918.14

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

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止未持有因股权分置改革而暂时停牌的股票。

本基金截至 2007 年 6 月 30 日止持有的因申购新股获得的股票流通受限情况

如下：

股票名称	成功申购日期	上市日期	可流通日期	申购价格	期末估价	成功申购股数（股）	成本	市值	占净值比
获配新股									
连云港	2007-4-17	2007-4-26	2007-7-26	4.98	14.60	64,403	320,726.94	940,283.80	0.03%
银轮股份	2007-4-9	2007-4-18	2007-7-18	8.38	18.06	35,867	300,565.46	647,758.02	0.02%
露天煤业	2007-4-10	2007-4-18	2007-7-18	9.80	36.10	45,044	441,431.20	1,626,088.40	0.04%
沃尔核材	2007-4-10	2007-4-20	2007-7-20	15.72	48.85	15,964	250,954.08	779,841.40	0.02%
利欧股份	2007-4-17	2007-4-27	2007-7-27	13.69	30.31	19,284	263,997.96	584,498.04	0.02%
恒星科技	2007-4-17	2007-4-27	2007-7-27	8.00	18.80	44,423	355,384.00	835,152.40	0.02%
广宇集团	2007-4-20	2007-4-27	2007-7-27	10.80	17.79	119,692	1,292,673.60	2,129,320.68	0.06%
东南网架	2007-5-11	2007-5-30	2007-8-30	9.60	23.24	46,891	450,153.60	1,089,746.84	0.03%
拓邦电子	2007-6-22	2007-6-29	2007-10-8	10.48	60.00	17,838	186,942.24	1,070,280.00	0.03%
合计							3,862,829.08	9,702,969.58	0.26%

（2）流通受限制不能自由转让的债券

本报告期末本基金未持有流通受限制的债券。

（3）估值方法

上述流通受限的基金资产估值方法与上年度采用的估值方法一致。

六、投资组合报告

（一）报告期末基金资产组合情况

	金额（元）	占总资产比例
股票	3,565,440,744.78	94.99%
债券	5,286,508.37	0.14%
权证	-	-
资产支持证券	-	-
银行存款和清算备付金合计	174,739,137.34	4.66%
其他资产	8,087,054.50	0.22%
合计	3,753,553,444.99	100.00%

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1、成份股投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值（元）	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	87,293,332.54	2.34%
B	采掘业	-	-
C	制造业	2,292,913,831.00	61.47%
C0	其中：食品、饮料	35,159,198.76	0.94%
C1	纺织、服装、皮毛	212,778,806.68	5.70%
C2	木材、家具	12,522,375.60	0.34%
C3	造纸、印刷	124,259,345.22	3.33%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	409,349,776.39	10.97%
C5	电子	329,368,588.62	8.83%
C6	金属、非金属	309,275,977.39	8.29%
C7	机械、设备、仪表	410,299,790.34	11.00%
C8	医药、生物制品	369,779,850.70	9.91%
C99	其他制造业	80,120,121.30	2.15%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	60,599,691.03	1.62%
F	交通运输、仓储业	35,049,082.16	0.94%
G	信息技术业	147,667,206.40	3.96%
H	批发和零售贸易	839,768,491.04	22.51%
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	72,613,714.75	1.95%

L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	18,143,016.28	0.49%
	合计	3,554,048,365.20	95.28%

2、新股投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值（元）	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,626,088.40	0.04%
C	制造业	5,606,939.86	0.15%
C0	其中：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	801,500.00	0.02%
C5	电子	1,070,280.00	0.03%
C6	金属、非金属	835,152.40	0.02%
C7	机械、设备、仪表	1,232,256.06	0.03%
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	1,667,751.40	0.04%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,089,746.84	0.03%
F	交通运输、仓储业	940,283.80	0.03%
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	2,129,320.68	0.06%
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	11,392,379.58	0.31%

（三）报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

1、成份股投资按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末市值（元）	占净值比例
1	002024	苏宁电器	17,630,399	827,923,537.04	22.20%
2	002007	华兰生物	3,171,969	131,953,910.40	3.54%
3	002008	大族激光	5,004,941	113,862,407.75	3.05%
4	002022	科华生物	3,984,303	100,404,435.60	2.69%
5	002078	太阳纸业	2,562,400	66,648,024.00	1.79%
6	002028	思源电气	1,044,664	65,688,472.32	1.76%

7	002075	高新张铜	4,493,706	65,023,925.82	1.74%
8	002032	苏泊尔	1,766,966	63,964,169.20	1.71%
9	002097	山河智能	873,335	61,482,784.00	1.65%
10	002064	华峰氨纶	1,212,702	60,950,402.52	1.63%
11	002038	双鹭药业	1,552,487	58,218,262.50	1.56%
12	002069	獐子岛	743,480	56,445,001.60	1.51%
13	002092	中泰化学	2,621,644	52,642,611.52	1.41%
14	002019	鑫富药业	1,239,059	52,040,478.00	1.40%
15	002106	莱宝高科	1,651,207	49,552,722.07	1.33%
16	002025	航天电器	1,804,452	47,980,378.68	1.29%
17	002056	横店东磁	1,575,850	45,542,065.00	1.22%
18	002010	传化股份	2,551,364	43,704,865.32	1.17%
19	002029	七匹狼	2,245,351	40,798,027.67	1.09%
20	002051	中工国际	1,575,992	40,108,996.40	1.08%
21	002036	宜科科技	1,730,493	39,714,814.35	1.06%
22	002009	天奇股份	2,006,848	37,869,221.76	1.02%
23	002083	孚日股份	2,711,261	37,632,302.68	1.01%
24	002004	华邦制药	1,502,887	35,918,999.30	0.96%
25	002084	海鸥卫浴	1,151,177	35,721,022.31	0.96%
26	002021	中捷股份	2,972,330	35,370,727.00	0.95%
27	002052	同洲电子	1,535,120	30,364,673.60	0.81%
28	002073	青岛软控	945,160	30,339,636.00	0.81%
29	002045	广州国光	2,546,141	29,637,081.24	0.79%
30	002080	中材科技	983,739	29,335,096.98	0.79%
31	002088	鲁阳股份	843,574	28,124,757.16	0.75%
32	002001	新和成	3,535,281	27,964,072.71	0.75%
33	002093	国脉科技	433,870	26,769,779.00	0.72%
34	002081	金螳螂	634,485	25,709,332.20	0.69%
35	002098	浔兴股份	1,440,894	25,575,868.50	0.69%
36	002018	华星化工	1,580,185	25,093,337.80	0.67%
37	002095	网盛科技	390,375	24,972,288.75	0.67%
38	002003	伟星股份	1,130,577	24,872,694.00	0.67%
39	002067	景兴纸业	2,727,487	24,711,032.22	0.66%
40	002053	云南盐化	1,834,606	24,106,722.84	0.65%
41	002014	永新股份	1,585,359	23,780,385.00	0.64%
42	002031	巨轮股份	1,749,563	23,024,249.08	0.62%
43	002030	达安基因	1,862,238	22,533,079.80	0.60%
44	002046	轴研科技	1,612,930	22,242,304.70	0.60%
45	002027	七喜控股	3,472,455	21,807,017.40	0.58%
46	002037	久联发展	1,702,680	21,794,304.00	0.58%
47	002061	江山化工	1,000,541	21,711,739.70	0.58%
48	002068	黑猫股份	921,866	21,018,544.80	0.56%

49	002033	丽江旅游	1,216,856	20,820,406.16	0.56%
50	002012	凯恩股份	3,095,724	20,122,206.00	0.54%
51	002076	雪 莱 特	1,076,492	19,602,919.32	0.53%
52	002013	中航精机	1,006,947	19,534,771.80	0.52%
53	002060	粤 水 电	2,147,052	19,344,938.52	0.52%
54	002015	霞客环保	1,819,123	18,827,923.05	0.50%
55	002065	东华合创	853,185	18,795,665.55	0.50%
56	002085	万丰奥威	2,315,201	18,567,912.02	0.50%
57	002041	登海种业	1,907,050	18,517,455.50	0.50%
58	002040	南 京 港	2,684,820	18,391,017.00	0.49%
59	002077	大港股份	2,209,868	18,143,016.28	0.49%
60	002016	威尔科技	1,260,893	17,803,809.16	0.48%
61	002047	成霖股份	2,566,397	17,194,859.90	0.46%
62	002017	东信和平	1,656,102	17,057,850.60	0.46%
63	002050	三花股份	1,440,339	16,707,932.40	0.45%
64	002023	海特高新	1,305,491	16,658,065.16	0.45%
65	002035	华帝股份	2,214,445	16,409,037.45	0.44%
66	002054	德美化工	895,226	15,961,879.58	0.43%
67	002062	宏润建设	1,115,967	15,545,420.31	0.42%
68	002026	山东威达	2,200,420	15,534,965.20	0.42%
69	002087	新野纺织	2,102,165	15,513,977.70	0.42%
70	002082	栋梁新材	1,094,247	15,111,551.07	0.41%
71	002042	飞亚股份	1,659,885	14,689,982.25	0.39%
72	002048	宁波华翔	921,313	14,151,367.68	0.38%
73	002063	远光软件	738,789	13,963,112.10	0.37%
74	002005	德豪润达	1,907,362	13,771,153.64	0.37%
75	002002	江苏琼花	1,893,376	13,291,499.52	0.36%
76	002011	盾安环境	1,073,107	13,242,140.38	0.36%
77	002094	青岛金王	624,441	12,613,708.20	0.34%
78	002070	众和股份	839,443	12,549,672.85	0.34%
79	002110	三钢闽光	889,999	12,548,985.90	0.34%
80	002043	兔 宝 宝	1,569,220	12,522,375.60	0.34%
81	002072	德棉股份	1,834,426	12,474,096.80	0.33%
82	002086	东方海洋	912,047	12,330,875.44	0.33%
83	002099	海翔药业	1,060,321	12,299,723.60	0.33%
84	002049	晶源电子	1,038,314	12,085,974.96	0.32%
85	002091	江苏国泰	1,024,650	11,844,954.00	0.32%
86	002059	世博股份	1,440,729	11,684,312.19	0.31%
87	002079	苏州固锔	957,331	11,105,039.60	0.30%
88	002100	天康生物	617,112	11,052,475.92	0.30%
89	002090	金智科技	639,225	10,994,670.00	0.29%
90	002034	美 欣 达	1,333,309	10,693,138.18	0.29%

91	002096	南岭民爆	390,970	10,556,190.00	0.28%
92	002006	精工科技	1,453,937	10,468,346.40	0.28%
93	002071	江苏宏宝	1,321,488	10,307,606.40	0.28%
94	002074	东源电器	716,783	10,034,962.00	0.27%
95	002044	江苏三友	1,537,305	9,884,871.15	0.27%
96	002109	兴化股份	536,924	9,557,247.20	0.26%
97	002057	中钢天源	951,047	9,282,218.72	0.25%
98	002020	京新药业	1,008,525	8,451,439.50	0.23%
99	002105	信隆实业	868,100	7,109,739.00	0.19%
100	002103	广博股份	572,560	5,668,344.00	0.15%

2、新股投资按市值占基金资产净值比例大小排序的所有股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	期末市值（元）	占净值比例
1	002133	广宇集团	119,692	2,129,320.68	0.06%
2	002128	露天煤业	45,044	1,626,088.40	0.04%
3	002135	东南网架	46,891	1,089,746.84	0.03%
4	002139	拓邦电子	17,838	1,070,280.00	0.03%
5	601008	连云港	64,403	940,283.80	0.03%
6	002104	恒宝股份	51,000	887,910.00	0.02%
7	002132	恒星科技	44,423	835,152.40	0.02%
8	002113	天润发展	50,000	801,500.00	0.02%
9	002130	沃尔核材	15,964	779,841.40	0.02%
10	002126	银轮股份	35,867	647,758.02	0.02%
11	002131	利欧股份	19,284	584,498.04	0.02%

（四）报告期内股票投资组合的重大变动

1、报告期内累计买入价值超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	002024	苏宁电器	94,026,460.45	4.01%
2	002069	獐子岛	63,031,036.15	2.69%
3	002078	太阳纸业	59,490,627.43	2.53%
4	002106	莱宝高科	48,444,255.59	2.06%
5	002097	山河智能	36,648,144.48	1.56%
6	002075	高新张铜	34,005,562.53	1.45%
7	002084	海鸥卫浴	33,191,351.30	1.41%
8	002080	中材科技	29,249,212.98	1.25%
9	002092	中泰化学	28,718,691.96	1.22%
10	002098	浔兴股份	26,297,204.67	1.12%
11	002109	兴化股份	22,694,656.02	0.97%
12	002095	网盛科技	22,457,888.13	0.96%
13	002076	雪莱特	20,867,366.50	0.89%

14	002022	科华生物	19,994,437.06	0.85%
15	002082	栋梁新材	19,834,567.83	0.85%
16	002088	鲁阳股份	19,027,099.76	0.81%
17	002007	华兰生物	17,397,278.58	0.74%
18	002077	大港股份	16,864,655.41	0.72%
19	002073	青岛软控	16,119,407.85	0.69%
20	002087	新野纺织	14,340,428.54	0.61%

2、报告期内累计卖出价值超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

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	002024	苏宁电器	131,725,960.16	5.61%
2	601988	中国银行	112,038,194.85	4.77%
3	002039	黔源电力	70,145,397.55	2.99%
4	601006	大秦铁路	64,950,734.57	2.77%
5	002032	苏 泊 尔	45,401,903.86	1.93%
6	002025	航天电器	28,322,941.47	1.21%
7	002021	中捷股份	24,451,011.30	1.04%
8	002007	华兰生物	22,880,223.95	0.97%
9	002031	巨轮股份	20,347,086.91	0.87%
10	002008	大族激光	19,580,371.38	0.83%
11	002023	海特高新	17,822,918.11	0.76%
12	002022	科华生物	17,573,462.45	0.75%
13	002010	传化股份	17,467,984.58	0.74%
14	002052	同洲电子	16,449,180.96	0.70%
15	002003	伟星股份	16,021,801.43	0.68%
16	002056	横店东磁	15,899,834.79	0.68%
17	002029	七 匹 狼	15,283,693.25	0.65%
18	002001	新 和 成	14,869,065.84	0.63%
19	002038	双鹭药业	14,848,625.20	0.63%
20	002064	华峰氨纶	13,965,619.35	0.60%

3、报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：元

买入股票成本总额	959,747,288.48
卖出股票收入总额	1,116,612,887.57
因申购产生的股票成本总额	1,917,620,936.11
因赎回产生的股票收入总额	2,122,818,415.53

(五) 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值（元）	占净值比例
1	国 债	-	-
2	金 融 债	-	-
3	央行票据	-	-
4	企 业 债	-	-
5	可 转 债	5,286,508.37	0.14%
	合 计	5,286,508.37	0.14%

(六) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券名称	市值（元）	占净值比例
1	巨轮转债	5,286,508.37	0.14%
2	-	-	-
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

(七) 报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券明细

截至本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

(八) 投资组合报告附注

1、报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

3、报告期末本基金持有的权证及报告期内获得的权证

(1) 报告期末本基金持有权证明细

截至本报告期末，本基金未持有权证。

(2) 报告期内本基金获得权证明细

本报告期本基金未获得权证。

4、报告期末本基金的其他资产构成

单位：元

其他应收款	4,988,965.00
交易保证金	2,053,576.26
证券清算款	987,105.07
应收利息	57,408.17
合计	8,087,054.50

5、至本报告期末，本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

截至本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

七、基金份额持有人户数、持有人结构及前十名持有人

截至 2007 年 6 月 30 日中小板 ETF 持有人情况如下：

（一）持有人户数

报告期末基金份额持有人户数	83,582 户
报告期末平均每户持有基金份额	21,182.33 份

（二）持有人结构

	持有份额（份）	占基金总份额比例
机构投资者持有的基金份额	270,653,540.81	15.29%
个人投资者持有的基金份额	1,499,807,901.58	84.71%
合 计	1,770,461,442.39	100.00%

（三）报告期末本基金场内基金份额前十名持有人情况

序号	持有人名称	持有份额（份）	占基金总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	44,494,480	2.51%
2	光大证券—中国工商银行—光大阳光 2 号集合资产管理计划	31,291,250	1.77%
3	广发证券—招行—广发增强型基金优选集合资产管理计划	22,888,200	1.29%
4	平安信托投资有限责任公司—平安·晓扬中国机会一期	21,902,768	1.24%
5	国信—中行—国信“金理财”经典组合基金集合资产管理计划	20,925,419	1.18%
6	KBC FINANCIAL PRODUCTS UK LIMITED	11,339,109	0.64%
7	高新投资发展有限公司	10,000,600	0.56%
8	中信证券—花旗—野村证券株式会社	10,000,000	0.56%
9	平安信托投资有限责任公司—平安·晓扬中国机会	9,990,117	0.56%

	二期集合信托		
10	美国友邦保险有限公司上海分公司一投连一个险投连	8,893,532	0.50%

注：以上数据依据注册登记机构提供信息编制。

（四）报告期末本基金管理人基金从业人员持有本基金情况

本基金管理人基金从业人员持有基金份额	1,254.06 份
本基金管理人基金从业人员持有基金份额占总份额比例	0.00%

八、开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日基金份额总额	3,965,967,258.69
期初基金份额总额	1,965,122,498.64
基金份额折算增加份额	-
报告期内基金总申购份额	2,181,483,934.23
报告期内基金总赎回份额	2,376,144,990.48
报告期末基金份额总额	1,770,461,442.39

九、重大事件揭示

（一）本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

（二）本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

（三）本报告期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）本报告期本基金投资策略未发生改变。

（五）本报告期无基金收益分配事项。

（六）本报告期本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

（七）本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的高级管理人员在本期内未受到任何处分。

（八）选择证券经营机构交易席位的情况

为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

- 1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- 2、公司财务状况良好；

- 3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；
- 4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- 5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

券商专用席位选择程序：

- 1、对席位候选券商的研究服务进行评估

本基金管理人组织相关人员依据席位选择标准对席位候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易席位的券商。

- 2、协议签署及通知托管人

本基金管理人与被选择的券商签订席位租用协议，并通知基金托管人。

根据以上标准，本基金分别选择了中国银河证券、国泰君安证券、光大证券、申银万国证券共计 5 个交易席位。本报告期内租用证券公司席位无变更情况。席位佣金为股票成交金额的 1%扣除应由券商负担的交易手续费、证管费及结算风险金。

各席位交易量及佣金提取情况如下：

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日租用各券商席位的数量、股票交易量及佣金情况如下：

单位：元

序号	券商名称	租用该券商席位的数量	股票交易量	占股票交易总量比例	应付佣金	占应付佣金总量比例
1	中国银河证券	2	1,893,765,725.63	66.60%	1,481,883.25	66.40%
2	申银万国证券	1	772,457,106.46	27.17%	604,453.50	27.09%
3	光大证券	1	177,206,606.71	6.23%	145,307.99	6.51%
	合计	4	2,843,429,438.80	100.00%	2,231,644.74	100.00%

2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日本基金无债券、回购交易。

（九）其他重大事件

1、本基金管理人于 2007 年 6 月 8 日发布关于调整旗下部分开放式基金申购费用、申购份额计算方法的公告；

2、本基金管理人于 2007 年 6 月 5 日发布关于更换信息披露负责人的公告，廖为女士担任华夏基金管理有限公司信息披露负责人；

3、本基金管理人于 2007 年 4 月 27 日发布开通广东发展银行借记卡基金网

上交易的公告；

4、本基金管理人于 2007 年 4 月 13 日发布关于旗下基金投资基金管理人非控股股东承销“深圳市沃尔核材股份有限公司首次公开发行 A 股”的公告；

5、本基金管理人于 2007 年 3 月 6 日发布关于中小企业板交易型开放式指数基金恢复办理场外申购业务的公告；

6、本基金管理人于 2007 年 1 月 23 日发布关于中小企业板交易型开放式指数证券投资基金暂停场外申购业务的公告；

7、本基金管理人于 2007 年 1 月 20 日发布华夏基金管理有限公司关于中小企业板交易型开放式指数基金调整场外申购、赎回价格计算方法的公告；

8、本基金管理人于 2007 年 1 月 11 日发布中小企业板交易型开放式指数基金申购赎回清单现金替代设置方法调整的公告。

投资者可通过《证券时报》和基金管理人网站 www.ChinaAMC.com 查阅上述公告。

十、基金管理人简介

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海和深圳设有分公司。华夏基金是全国首批社保基金投资管理人、首批企业年金基金投资管理人及中国内地首只 ETF 基金管理人。华夏基金还成为国内基金公司首批获得 QDII 业务资格的基金管理公司，并且是国内唯一获得亚洲债券基金管理资格的投资管理机构。

截至 2007 年 6 月，华夏基金管理有限公司管理资产规模超过 1400 亿元人民币，累计分红超过 194 亿元人民币，是国内基金业管理资产规模最大的基金公司之一，也是为投资人分红最多的基金公司之一。

华夏基金旗下共有 12 只开放式基金，3 只封闭式基金，1 只亚洲债券独立组合以及多只全国社保基金投资组合和企业年金。从低风险的货币市场基金到高收益的股票型基金，华夏基金已经初步建立了完善的产品线，可以满足各类风险偏好投资者的需求，是国内管理基金数目最多的基金管理公司之一。

华夏基金始终坚持维护持有人利益，不断提高客户服务水平。今年上半

年：

- 华夏基金通过电话线路扩容、网站稳定性改造等手段，进一步提高人工电话接通率，为客户提供稳定、便捷的网站服务。继续通过网站热点问题、服务提示、电子邮件、短信服务等方式加强主动服务工作，提高服务质量。
- 华夏基金的网上交易目前可支持建行卡、农行卡、兴业卡、广发卡、招行卡、ChinaPay CD 卡等多种银行卡支付，方便投资人进行网上交易。

为帮助投资人培养健康、理性的基金投资观念，今年上半年华夏基金在投资者教育方面做了大量工作：

- 华夏基金成立了投资者教育工作领导小组及投资者教育工作办公室。
- 华夏基金在网站开辟投资者教育专区，制作专题页面，并开展“我的基金理财故事”有奖征文活动。
- 华夏基金编辑出版了 50 万册投资者教育丛书《基金投资百问百答》，在六家媒体开设“投资者教育专栏”，并举办投资者教育系列活动“华夏基金理财大讲堂”。

今年以来，华夏基金获多家中介机构评选的多种奖项：

- 2007 年 1 月，在《中国证券报》主办的“第四届中国基金金牛奖”评选中，华夏基金获“2006 年度十大金牛基金公司奖”。
- 2007 年 1 月 26 日，华夏基金获得由《21 世纪经济报道》评选的“中国基金管理公司综合实力奖”。
- 2007 年 1 月 27 日，公司获得由和讯网评选出的“2006 年度中国十大品牌基金公司奖”和“2006 年度中国基金业杰出创新奖”。
- 2007 年 2 月，在香港《亚洲资产管理》杂志 2006 年评选活动中，华夏基金获得了“亚洲地区最佳客户服务奖”及“中国最佳社会服务奖”。
- 2007 年 4 月，在《上海证券报》主办的“第四届中国最佳基金公司评选”活动中，成为唯一一家荣获“中国最佳基金公司 TOP 大奖”的基金管理公司。

十一、备查文件目录

（一）备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《中小企业板交易型开放式指数基金基金合同》；
- 3、《中小企业板交易型开放式指数基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

（二）存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

（三）查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的办公场所、营业场所及网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇〇七年八月二十八日