



华安宝利配置证券投资基金 2007 年年度报告

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
签发日期：二〇〇八年三月二十七日

目 录

一、	重要提示.....	3
二、	基金产品概况.....	3
	1、基金概况.....	3
	2、基金的投资.....	3
	3、基金管理人.....	4
	4、基金托管人.....	4
	5、信息披露.....	4
	6、其他有关资料.....	5
三、	主要财务指标和基金净值表现.....	5
	1、主要财务指标.....	5
	2、净值表现.....	5
	3、过往三年基金收益分配情况.....	7
四、	管理人报告.....	7
	1、基金管理人和基金经理简介.....	7
	2、基金运作合规性声明.....	7
	3、基金经理工作报告.....	8
	4、内部监察报告.....	9
五、	托管人报告.....	9
六、	审计报告.....	10
七、	财务会计报告.....	11
	(一)、资产负债表.....	11
	(二)、利润表.....	12
	(三)、所有者权益(基金净值)变动表.....	13
	(四)、会计报表附注.....	13
八、	投资组合报告.....	31
	(一)、基金资产组合.....	31
	(二)、股票投资组合.....	32
	(三)、股票明细.....	32
	(四)、报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
	(五)、债券投资组合.....	36
	(六)、前五名债券明细.....	37
	(七)、权证投资组合.....	37
	(八)、资产支持证券投资组合.....	37
	(九)、投资组合报告附注.....	37
九、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	38
十、	开放式基金份额变动.....	38
十一、	重大事件.....	38
十二、	备查文件目录.....	45

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 3 月 25 日复核了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,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,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告的财务报表部分已经审计。

二、基金产品概况

1、基金概况

基金名称:	华安宝利配置证券投资基金
基金简称:	华安宝利
交易代码:	040004
深交所行情代码:	160404
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2004 年 8 月 24 日
期末基金份额总额:	2,815,001,464.89 份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

投资目标: 本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。

投资策略: 基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。

业绩比较基准: $35\% \times \text{天相转债指数收益率} + 30\% \times \text{天相 280}$

指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+
5%×金融同业存款利率

风险收益特征:

本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险,政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险,管理风险,巨额赎回风险等。

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
总经理: 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@huanan.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(简称“交通银行”)
注册地址及办公地址: 上海市浦东新区银城中路 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.huanan.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

会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司
办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
登记注册机构：华安基金管理有限公司
办公地点：上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

1、主要财务指标

序号	财务指标	2007 年度	2006 年度	2005 年度
1	本期利润：	1,634,175,911.37	838,068,249.74	75,505,697.79
2	基金本期利润扣减本期公 允价值变动损益后的净额：	1,609,630,194.39	714,888,931.66	17,162,792.29
3	加权平均份额本期利润：	0.8792	1.0880	0.1153
4	期末可供分配利润	122,680,051.48	43,861,245.25	-9,220,882.64
5	期末可供分配份额利润	0.0436	0.0298	-0.0093
6	期末基金资产净值：	3,234,899,997.13	1,699,034,787.31	1,064,076,460.83
7	期末基金份额净值：	1.149	1.153	1.078
8	加权平均净值利润率：	65.12%	75.15%	11.15%
9	本期份额净值增长率：	108.00%	124.82%	12.75%
10	份额累计净值增长率：	428.34%	154.01%	12.98%

提示：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、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、净值表现

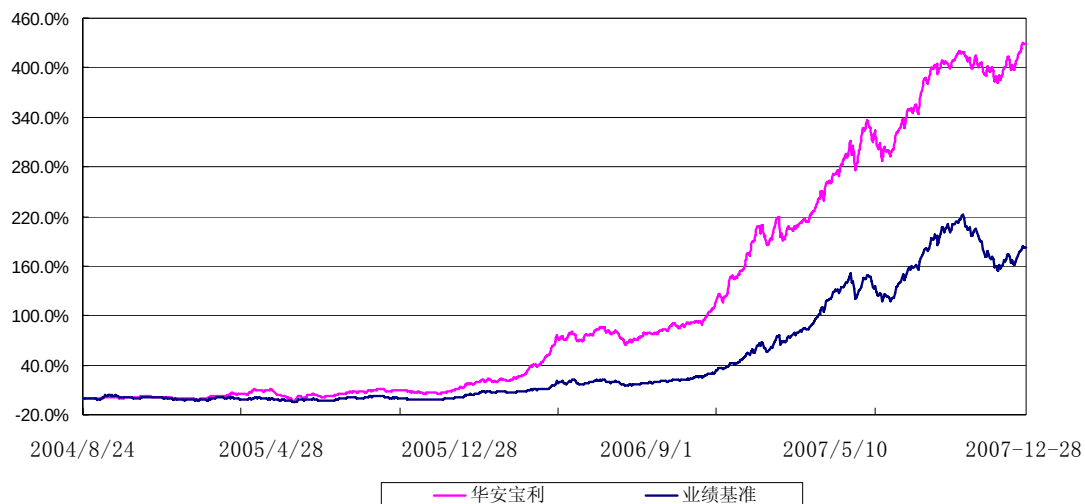
A、本报告期基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

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
过去三个月	3.79%	1.02%	-7.02%	1.04%	10.81%	-0.02%
过去六个月	30.63%	1.17%	19.91%	1.13%	10.72%	0.04%
过去一年	108.00%	1.53%	80.75%	1.25%	27.25%	0.28%
过去三年	427.29%	1.20%	190.68%	0.86%	236.61%	0.34%
自基金合同 生效起至今	428.34%	1.14%	183.14%	0.83%	245.20%	0.31%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

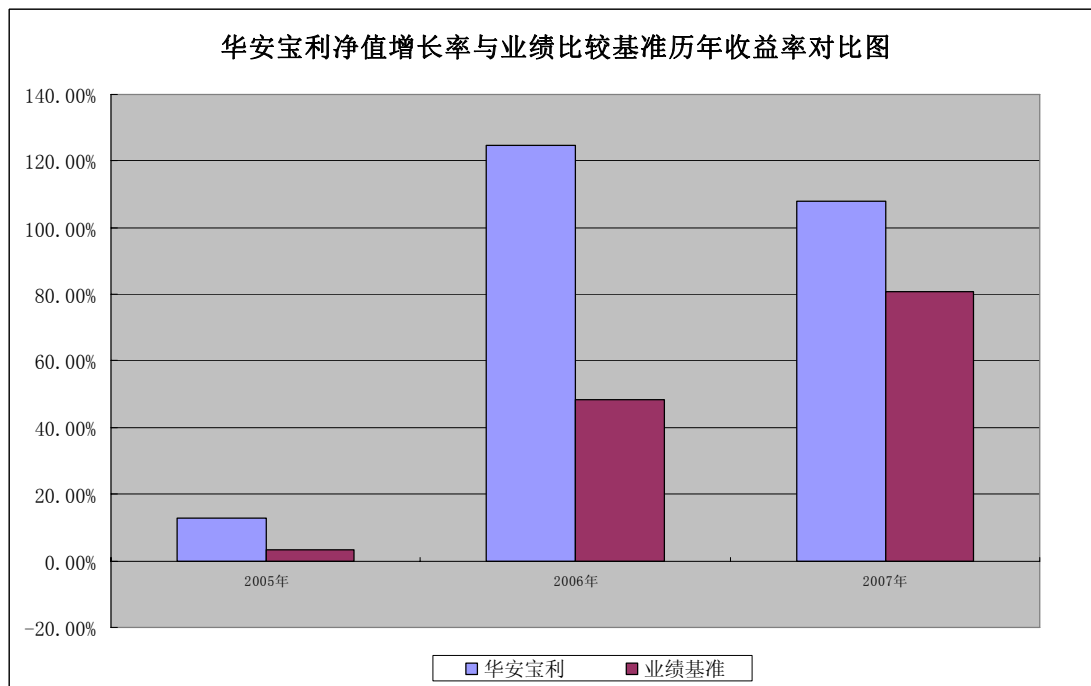
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华安宝利份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图
2004/8/24--2007/12/31



C、图示基金过往三年每年的净值增长率

基金过往三年每年的净值增长率与同期业绩比较基准的收益率对比图



3、过往三年基金收益分配情况

年度	每 10 份基金份额分红数	备注
2005 年度	0.500 元	
2006 年度	10.900 元	
2007 年度	11.000 元	
合计	22.400 元	

四、 管理人报告

1、基金管理人和基金经理简介

(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 2007 年 12 月 31 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、华安国际配置(QDII)等 9 只开放式基金，管理资产规模达到 1074 亿人民币、1.31 亿美元。

(2) 基金经理

袁蓓女士：经济学学士，8 年证券从业经历。曾在中国平安保险（集团）股份有限公司投资管理中心工作，任首席交易员、债券交易室主任、债券投资组副主任。2003 年 1 月加入华安基金管理有限公司，在基金投资部从事证券投资和研究工作，自 2004 年 7 月本基金发行之日起至今任华安宝利配置基金基金经理。

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《华安宝利配置证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置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，除以下说明外，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

(1)、8 月 15 日，华安宝利基金持有的上电转债(证券代码 110021)共 25,370 张，因 8 月 14 日收市之前没有及时转股被发债人赎回。以 8 月 14 日基金持有该债券的市值（包括应收利息）5,748,315.14 元和税后赎回总值 2,607,021.20 元计算，其中价差为 3,141,293.94 元。公司发现上述问题后，本着“诚实信用、勤勉尽责”的原则，8 月 15 日当日即动用风险准备金弥补此交易的价差。因此，上述事件未损害到基金持有人利益。公司已加强相关程序控制，以避免此类事件

的发生。

(2)、9 月 17 日, 由于操作失误, 买入侨城认购权证超过上一日基金净值的 0.5%。

3、基金经理工作报告

(1) 本基金业绩表现

截止 2007 年 12 月 31 日, 本基金单位净值为 1.149 元。全年单位净值复合增长 108.00%, 同期衡量业绩的比较基准上涨 80.75%; 本年度实施了三次分红(其中最后一次为跨年度实施), 合计每十份分红 11.40 元, 自成立以来本基金累计净值上升 428.34%, 同期衡量业绩的比较基准上涨 183.14%。

(2) 基金运作情况回顾

资产配置, 基于对股票市场的良好预期, 2007 年维持了对股性资产的较高配置, 并伴随市场估值的提高逐步进行了适度的下调。总结过去一年的投资运作, 整体效果良好, 但遗憾仍不乏其中。“投资是遗憾的艺术”, 期望对过去三年多的总结能够让我们在遗憾中不断进步, 在未来给投资者带来更多稳健持续的收益。

普通债券的投资, 本基金维持低仓位低久期的配置, 同时积极参与了一些阶段性的机会, 有效地回避了债券市场的下跌风险; 可转债的投资, 考虑到流动性和行业风格集中等因素, 维持较低的配置; 股票市场的投资, 沿用精选细分行业和个股的主要策略, 以成长的可持续性为主线, 选择相对估值潜力较大的优质公司, 并基于宏观调控、次债危机和企业利润增速等因素的考量, 在三季度末进行了降低股票配置和向中小盘成长类风格转换的操作。

(3) 2008 年市场展望和投资策略

在流动性持续过剩和企业盈利持续超预期的双重刺激下, 连续翻番的上涨使得 A 股市场用两年时间完成了其他新兴市场 3 到 5 年甚至更长时间才能完成的上涨幅度, 让全球投资者从另一个角度感受到“中国制造”的效率, 也把国内投资者的收益预期提高到了一个非正常的水平。展望 2008 年的资本市场, 充满挑战, 首先应降低收益预期, 提高风险意识。

宏观紧缩、通货膨胀、美国次债事件和供求关系等四个方面将是左右 2008 年股票和债券市场的最重要因素。换个角度来看, 这些因素是风险也是机会, 关键在于跟踪、分析和落实到操作。正是这些因素的存在给我们带来更多的投资机会和配置空间, 作为一个配置型基金, 我们会更多的从这些因素出发, 积极的寻找机会灵活调整各类资产的配比。同时作为一个稳中求进的配置型基金, 当前我们试图引入绝对收益的思维方式, 摒弃短期排名和波动带来的干扰, 以盈利的持续增长为主线, 于股票和债券市场上寻找更稳健的净值增长模式。

普通债券的投资, 出于对物价维持高位适度波动的判断, 在 2008 年将适度拉长久期, 提高组合的收益能力, 并注重收益率曲线形态变化带来的收益。同时基于新股收益率降低的判断, 将降低流动资金在现金上的配比, 适度提高债券(包括短债)的比重。重点关注全球范围内的经济趋势特别是物价趋势和实际利率水平。

可转债的投资，维持其具有良好估值吸引力的判断，但基于短期内市场容量小、流动性不足等缺陷，维持低于基准的配置比重，加强对新品种的提前跟踪与分析，仍待市场容量上升后逐步提高配置。

股票市场的投资，人民币升值、资产整合、和谐社会和通货膨胀是 2008 年重要的四条投资主线，我们会主要依据这四条主线进行个股和行业的挑选。同时我们判断市场不确定性仍主要来自于宏观调控的执行力度、上市公司业绩增速的变化程度、次债对实体经济的影响深度和股票供给增加的程度，大小非流通、通货膨胀、全民加薪、税制改革、股指期货、融资和奥运等已经不同程度为市场所预期的因素将会是市场起伏的主要导火索。在分化和波动都会有所加大的情况下，我们会继续保持并加强与整个研究团队的交流与合作，坚持基本面出发的个股选择策略和资产配置调整策略指导下的适度灵活操作。

4、内部监察报告

本报告期内，监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，强化员工的合规意识，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 积极配合公司管理层推行“主动合规”的管理理念，在制定了“合规政策”的同时，监察稽核部门经常性地组织员工进行法律法规的学习、培训，来强化员工的合规意识；

(2) 根据中国证监会颁布的《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》的精神，组织投资公司投资、研究、交易人员签署了遵守投资管理人员职业道德、坚持基金份额持有人利益优先的“承诺书”；

(3) 按照证监会基金部《关于加强基金结算风险控制有关问题的通知》的要求，组织公司相关部门进行结算风险自查；

(4) 进一步完善投资交易系统控制功能，防范合规风险，提高合规监察效率；

(5) 除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察外，还有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

五、托管人报告

2007 年年度，托管人在华安宝利配置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。

2007 年年度，华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金的基金

资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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。托管人在基金的投资运作中对基金持有上电转债未能及时转股被发行人赎回和购买权证交易量超过规定的行为进行了提示，管理人进行了相应处理。

2007 年年度，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华安宝利配置证券投资基金的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、 审计报告

普华永道中天审字(2008)第 20239 号

华安宝利配置证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安宝利配置证券投资基金(以下简称“华安宝利配置基金”)的财务报表，包括 2007 年 12 月 31 日的资产负债表、2007 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华安宝利配置基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华安宝利配置基金 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司
中国·上海市

注册会计师 薛 竞
注册会计师 金 毅
2008 年 3 月 27 日

七、 财务会计报告

(一)、资产负债表

二零零七年十二月三十一日

单位：人民币元

项 目	附注	2007年12月31日	2006年12月31日
资产：			
银行存款		114,223,202.81	148,464,268.88
结算备付金		217,804,209.03	4,145,192.49
存出保证金		1,842,527.51	609,609.61
交易性金融资产	9(1)	2,887,457,269.02	1,521,952,286.05
其中：股票投资		2,020,380,319.72	1,140,285,922.33
债券投资		867,076,949.30	381,666,363.72
衍生金融资产	9(2)	495,534.08	25,928,793.60
买入返售金融资产		0.00	0.00
应收证券清算款		6,659,692.17	10,034,187.78
应收利息	9(3)	15,157,692.50	2,490,005.07
应收申购款		17,071,494.67	31,164,927.09
其他资产		0.00	0.00
资产合计		<u>3,260,711,621.79</u>	<u>1,744,789,270.57</u>
负债：			
应付证券清算款		3,880,673.22	0.00
应付赎回款		15,459,201.95	41,793,550.83
应付管理人报酬		3,135,729.05	1,179,203.57
应付托管费		653,276.89	245,667.40
应付交易费用	9(4)	1,353,713.87	1,821,547.93
应交税费		505,937.20	96,372.20
其他负债	9(5)	<u>823,092.48</u>	<u>618,141.33</u>

负债合计		25,811,624.66	45,754,483.26
所有者权益：			
实收基金	9(6)	2,815,001,464.89	1,473,522,718.96
未分配利润		419,898,532.24	225,512,068.35
所有者权益合计		3,234,899,997.13	1,699,034,787.31
负债和所有者权益合计		3,260,711,621.79	1,744,789,270.57
基金份额总额(份)		2,815,001,464.89	1,473,522,718.96
基金份额净值		1.149	1.153

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、利润表

自二零零七年一月一日至二零零七年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年度	2006年度
一、收入			
1. 利息收入(合计)		22,499,913.72	7,494,937.68
其中：存款利息收入		4,207,021.23	837,474.14
债券利息收入		18,199,655.02	6,634,032.31
买入返售金融资产收入		93,237.47	23,431.23
2. 投资收益(合计)		1,651,829,727.41	732,364,603.23
其中：股票投资收益	9(7)	1,531,768,585.87	669,778,252.34
债券投资收益	9(8)	81,665,800.49	9,848,765.39
衍生工具收益	9(9)	29,257,932.69	42,014,522.27
股利收益		9,137,408.36	10,723,063.23
3. 公允价值变动收益	9(10)	24,545,716.98	123,179,318.08
4. 其他收入	9(11)	7,715,620.88	3,022,906.48
收入合计		1,706,590,978.99	866,061,765.47
二、费用			
1. 管理人报酬	8(3)	29,968,161.26	13,359,575.14
2. 托管费	8(3)	6,243,366.88	2,783,244.74
3. 销售服务费		0.00	0.00
4. 交易费用	9(12)	27,329,264.25	9,781,633.98
5. 利息支出		8,467,529.75	1,668,666.48
其中：卖出回购金融资产支出		8,467,529.75	1,668,666.48
6. 其他费用	9(13)	406,745.48	400,395.39
费用合计		72,415,067.62	27,993,515.73
三、利润总额		1,634,175,911.37	838,068,249.74

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

自二零零七年一月一日至二零零七年十二月三十一日止期间

单位：人民币元

	实收基金	2007年度 未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	1, 473, 522, 718. 96	225, 512, 068. 35	1, 699, 034, 787. 31
本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	0. 00	1, 634, 175, 911. 37	1, 634, 175, 911. 37
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	1, 341, 478, 745. 93	297, 627, 075. 74	1, 639, 105, 821. 67
其中：基金申购款	4, 158, 604, 984. 81	1, 248, 839, 032. 09	5, 407, 444, 016. 90
基金赎回款	2, 817, 126, 238. 88	951, 211, 956. 35	3, 768, 338, 195. 23
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0. 00	1, 737, 416, 523. 22	1, 737, 416, 523. 22
年末所有者权益(基金净值)	2, 815, 001, 464. 89	419, 898, 532. 24	3, 234, 899, 997. 13

	实收基金	2006年度 未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	986, 910, 091. 28	77, 166, 369. 55	1, 064, 076, 460. 83
本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	0. 00	838, 068, 249. 74	838, 068, 249. 74
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	486, 612, 627. 68	-68, 258, 288. 04	418, 354, 339. 64
其中：基金申购款	2, 364, 898, 316. 06	715, 208, 712. 05	3, 080, 107, 028. 11
基金赎回款	1, 878, 285, 688. 38	783, 467, 000. 09	2, 661, 752, 688. 47
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	0. 00	621, 464, 262. 90	621, 464, 262. 90
年末所有者权益(基金净值)	1, 473, 522, 718. 96	225, 512, 068. 35	1, 699, 034, 787. 31

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、会计报表附注

1. 基金的基本情况

华安宝利配置证券投资基金(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[2004]第 97 号《关于同意华安宝利配置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《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宝利配置证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 1,130,461,912.15 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(2004)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于 2004 年 8 月 24 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,480,770.08 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,857.93 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》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。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%（其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%）；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+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 2008 年 3 月 27 日批准报出。

2. 财务报表的编制基础

本基金原以 2006 年 2 月 15 日以前颁布的企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》（以下合称“原会计准则和制度”）、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》以及中国证监会允许的基金行业实务操作的规定编制财务报表。自 2007 年 7 月 1 日起，本基金开始执行财政部于 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”）和中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》。2007 年度财务报表为本基金首份按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 4 所列示的基金行业实务操作的规定编制的年度财务报表。

在编制 2007 年度财务报表时，2006 年度以及 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，涉及的主要内容包括：将所持有的股票投资、债券投资和权证投资等划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产；以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值调整账面价值，且将原计入所有者权益的公允价值变动计入当期损益。

本财务报表所有报表项目已按照企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》重新列报。按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则和《证券投资基金会计核算业务指引》列报的所有者权益及净损益的金额调节过程列示于本财务报表附注 12。

3. 遵循企业会计准则的声明

本基金 2007 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 2007 年 12 月 31 日的财务状况以及 2007 年度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：

1) 会计年度。

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

2) 记账本位币。

本基金的记帐本位币为人民币。

3) 金融资产和金融负债的分类及抵销

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，其他金融资产划分为贷款和应收款项，暂无金融资产划分为可供出售金融资产或持有至到期投资。除衍生工具所产生的金融资产外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。除衍生工具所产生的金融负债外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示。衍生工具所产生的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

4) 基金资产的估值原则。

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行基金资产估值，主要资产的估值方法如下：

(i) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次公开发行但未上市的股票按成本估值。

首次公开发行有明确锁定期的股票，在同一股票上市交易后，在锁定期内按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

由于送股、转增股、配股和公开增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

2006 年 11 月 13 日之前取得的非公开发行股票，在锁定期内按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。自 2006 年 11 月 13 日起基金新投资的非公开发行股票在锁定期内的估值方法为：若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(ii) 债券投资

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

银行间同业市场交易的债券按采用估值技术确定的公允价值估值。

未上市流通的债券按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值。

(iii) 权证投资

从获赠确认日、买入交易日或因认购新发行分离交易可转债而取得的权证从权证确认日起到卖出交易日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，按最近交易日的市场交易收盘价估值；估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价以确定公允价值并估值。

首次发行未上市交易的权证投资按采用估值技术确定的公允价值估值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下按成本估值；因持有股票而享有的配股权证以及停止交易但未行权的权证按采用估值技术确定的公允价值估值。

(iv) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，本基

金的基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后按最能反映公允价值的价格估值。

5) 证券投资基金成本计价方法。

(i) 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。2007 年 7 月 1 日之前，股票投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，股票投资成本按交易日股票的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于交易日确认股票投资收益/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(2) 债券投资

2007 年 7 月 1 日之前，买入证券交易所交易的债券于交易日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资成本按交易日应支付的全部价款并扣除债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)后的金额确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额。

自 2007 年 7 月 1 日起，买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本按交易日债券的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益，上述公允价值不包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息(作为应收利息单独核算)。

认购新发行的分离交易可转债于交易日按支付的全部价款确认为债券投资，同时按附注 4(5)(i)(3)所示的方法单独核算权证成本，并相应调整债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于交易日确认债券差价收入/(损失)。2007 年 7 月 1 日之前，卖出银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认债券投资收益/(损失)；自 2007 年 7 月 1 日起，卖出银行间同业市场交易的债券于交易日确认债券投资收益/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

(3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。2007 年 7 月 1 日之前，权证投资成本按交易日应支付的全部价款确认，取得时发生的相关交易费用计入初始确认金额；自 2007 年 7 月 1 日起，权证投资成本按交易日权证的公允价值确认，取得时发生的相关交易费用直接计入当期损益。因认购新发行的分离交易可转债而取得的权证在债券取得日，按权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本。获赠权证(包括配股权证)在除权日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增加的权证数量。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益/(损失)。出售权证的成本按移动加权平均法于交易日结转。

(ii) 贷款和应收款项

2007 年 7 月 1 日之前，贷款和应收款项按实际支付或应收取的金额入账，并采用名义利率法确认相关的利息收入，其中买入返售金融资产以协议融出资金额作为入账金额；自 2007 年 7 月 1 日起，贷款和应收款项以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中买入返售金融资产以融出资金应付或实际支付的总额作为初始确认金额。

(iii) 其他金融负债

2007 年 7 月 1 日之前，其他金融负债按实际收取或应支付的金额入账，并采用名义利率法确认负债相关的利息支出，其中卖出回购金融资产款以协议融入资金额作为入账金额；自 2007 年 7 月 1 日起，其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法，其中卖出回购金融资产款以融入资金应收或实际收到的总额作为初始确认金额。

6) 收入/(损失)的确认和计量。

股票投资收益/(损失)于交易日按卖出股票成交金额与其成本的差额确认。

债券投资收益/(损失)按卖出债券成交金额与其成本和应收利息的差额确认。

衍生工具收益于交易日按卖出权证成交金额与其成本的差额确认。

股利收益于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，在债券实际持有期内逐日确认。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后确认利息收入。自 2007 年 7 月 1 日起，若票面利率与实际利率出现重大差异则按实际利率计算利息收入。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前，买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额在回购期内按直线法逐日确认；自 2007 年 7 月 1 日起，买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在回购期内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益/(损失)于估值日按以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动形成的利得或损失确认。

7) 费用的确认和计量。

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日之前, 卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额在回购期内以直线法逐日确认; 自 2007 年 7 月 1 日起, 卖出回购金融资产支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额, 在回购期内以实际利率法逐日确认, 直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

8) 实收基金。

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

9) 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

10) 基金的收益分配政策。

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配, 但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。基金收益分配每年至少一次, 收益分配比例不得低于基金净收益的 90%。基金当期收益先弥补上一年度亏损后方可进行当年收益分配。基金可分配收益不包括基金经营活动产生的未实现收益以及基金份额交易产生的未实现平准金等未实现部分。基金当年亏损则不进行收益分配。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

11) 为处理对基金财务状况及基金运作有重大影响的事项而采取的其他会计政策和会计估计: 无。

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[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[2007]84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。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。
- (d) 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。
- (e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

6. 资产负债表日后事项:

本基金的基金管理人于 2007 年 12 月 27 日宣告 2008 年度第 1 次分红,向截至 2008 年 1 月 7 日止在本基金注册登记人华安基金公司登记在册的全体份额持有人,按每 10 份基金份额派发红利 0.40 元。

7. 重大会计差错的内容和更正金额:

无。

8. 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 基金注册登记机构 基金销售机构	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 基金代销机构	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(原名为 上海国际信托投资有限公司)	基金管理人的股东		
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 (a)	基金管理人的股东 (自 2007 年 11 月 20 日起)		
上海广电(集团)有限公司(a)	基金管理人的原股东 (2007 年 11 月 20 日之前)		

(a) 根据华安基金公司于 2007 年 11 月 20 日发布的公告, 经公司股东会审议通过, 并报经中国证监会证监基金字(2007)282 号文批准, 上海广电(集团)有限公司将其持有的华安基金公司 20% 的股权转让给上海锦江国际投资管理有限公司。

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交易单元的股票成交量: 无。

上年度通过关联人交易单元的股票成交量: 无。

② 本报告期通过关联人交易单元的债券、回购和权证成交量: 无。

上年度通过关联人交易单元的债券、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:

	2007 年度	2006 年度
卖出债券结算金额	99,939,600.00	193,166,654.79
卖出回购金融资产协议金额	753,800,000.00	0.00
卖出回购金融资产支出	703,242.71	0.00

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费, 按前一日基金资产净值的 1.2% 的年费率计提, 计算方法如下:

$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应支付的管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人的管理费每日计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

本基金在本报告期间需支付基金管理费 29,968,161.26 元。(2006 年 13,359,575.14 元)

② 基金托管费

本基金应支付基金托管人托管费, 按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提, 计算方法如下:

$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管人的托管费每日计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付, 由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

本基金在本报告期间需支付基金托管费 6,243,366.88 元。(2006 年 2,783,244.74 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 2007 年 12 月 31 日保管的银行存款余额为 114,223,202.81 元(2006 年 12 月 31 日：148,464,268.88 元)。本年度由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 2,742,175.12 元(2006 年度：651,550.59 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 2007 年 12 月 31 日的相关余额 217,804,209.03 元计入“结算备付金”科目(2006 年 12 月 31 日：4,145,192.49 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：

2007 年度基金管理有限公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	年末数		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	50,000,000.00	3.39%	53,499,278.50	0.00	103,499,278.50	3.68%	0.00

*本年度华安基金公司持有的基金份额增加皆为红利再投资所获得。

2006 年度基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	年初数		买入	卖出	年末数		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	50,000,000.00	5.07%	0.00	0.00	50,000,000.00	3.39%	0.00

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：无。

9. 基金会计报表重要项目的说明：

(1) 交易性金融资产项目说明：

	成本	2007 年 12 月 31 日	
		公允价值	估值增值/(减值)
股票投资	1,812,242,639.35	2,020,380,319.72	208,137,680.37
债券投资	869,148,758.41	867,076,949.30	(2,071,809.11)
—交易所市场	115,553,841.74	113,760,949.30	(1,792,892.44)
—银行间同业市场	753,594,916.67	753,316,000.00	(278,916.67)
	2,681,391,397.76	2,887,457,269.02	206,065,871.26

	成本	2006 年 12 月 31 日	
		公允价值	估值增值
股票投资	973,589,196.12	1,140,285,922.33	166,696,726.21

债券投资	374,055,358.62	381,666,363.72	7,611,005.10
—交易所市场	104,044,050.40	111,652,747.89	7,608,697.49
—银行间同业市场	270,011,308.22	270,013,615.83	2,307.61
	1,347,644,554.74	1,521,952,286.05	174,307,731.31

(2) 衍生金融资产项目说明:

	成本	2007 年 12 月 31 日 公允价值	估值增值
权证投资	473,335.90	495,534.08	22,198.18

	成本	2006 年 12 月 31 日 公允价值	估值增值
权证投资	18,694,172.45	25,928,793.60	7,234,621.15

(3) 应收利息项目说明:

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应收债券利息	14,993,514.44	2,416,744.05
应收结算备付金利息	99,140.20	4,023.21
应收银行存款利息	49,864.25	69,188.51
应收申购款利息	15,128.01	0.00
应收存出保证金利息	45.60	49.30
合计	15,157,692.50	2,490,005.07

(4) 应付交易费用项目说明:

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付银行间市场交易费用	11,711.87	0.00
应付交易所交易佣金	1,342,002.00	1,821,547.93
其中:		
渤海证券有限责任公司	586,204.71	504,167.50
海通证券股份有限公司	360,339.45	242,529.57
中信建投证券有限责任公司	0.00	304,408.79
申银万国证券股份有限公司	395,457.84	480,394.05
兴业证券股份有限公司	0.00	290,048.02
合计	1,353,713.87	1,821,547.93

(5) 其他负债项目说明:

明细项目	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00

预提费用	260,000.00	100,000.00
应付赎回费	63,092.48	18,141.33
合计	823,092.48	618,141.33

(6) 实收基金变动明细:

	基金份额总额	实收基金
2006 年 12 月 31 日	1,473,522,718.96	1,473,522,718.96
加: 本期因申购增加数	4,158,604,984.81	4,158,604,984.81
其中: 红利再投资	838,588,033.14	838,588,033.14
减: 本期因赎回减少数	2,817,126,238.88	2,817,126,238.88
2007 年 12 月 31 日	2,815,001,464.89	2,815,001,464.89

(7) 股票投资收益项目说明:

明细项目	2007 年度	2006 年度
卖出股票成交总额	4,412,168,182.90	2,624,607,979.30
减: 卖出股票成本总额	2,880,399,597.03	1,954,829,726.96
股票投资收益	1,531,768,585.87	669,778,252.34

本基金于本年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价
(2006 年度: 3,580,223.05 元, 已全额冲减股票投资成本)。

(8) 债券投资收益项目说明:

明细项目	2007 年度	2006 年度
卖出及到期兑付债券结算金额	1,894,397,801.59	5,329,878,467.94
减: 卖出及到期兑付债券成本总额	1,779,276,117.18	5,290,568,202.71
减: 应收利息总额	33,455,883.92	29,461,499.84
债券投资收益	81,665,800.49	9,848,765.39

(9) 衍生工具投资收益项目说明:

明细项目	2007 年度	2006 年度
卖出及行权权证成交金额	135,225,332.08	59,020,771.20
减: 卖出及行权权证成本总额	105,967,399.39	17,006,248.93
衍生工具投资收益项目	29,257,932.69	42,014,522.27

(10) 公允价值变动收益/损失项目说明

项目名称	2007 年度	2006 年度
交易性金融资产		
—股票投资	41,440,954.16	109,944,147.74
—债券投资	-9,682,814.21	6,000,549.19
—资产支持证券投资	0.00	0.00
衍生工具		

—权证投资	-7,212,422.97	7,234,621.15
交易性金融负债	0.00	0.00
合计	24,545,716.98	123,179,318.08

(11) 其他收入:

明细项目	2007 年度	2006 年度
赎回基金补偿收入(a)	4,566,211.49	3,022,906.48
债券差价补偿收入(b)	3,141,293.94	0.00
其他	8,115.45	0.00
合计	7,715,620.88	3,022,906.48

(a) 本基金的赎回费率按持有期间递减,赎回费总额的 25%归入基金资产。

(b) 本基金本年度因投资的上电转债未能在发行人实施赎回权前进行有效操作而被强制赎回造成的投资损失。为维护基金份额持有人的利益,本基金的基金管理人动用公司一般风险准备金弥补上述债券差价损失,相关补偿款项已全额支付本基金并计入其他收入。

(12) 交易费用:

明细项目	2007 年度	2006 年度
交易所市场交易费用	27,302,597.60	9,728,986.48
银行间市场交易费用	26,666.65	52,647.50
合计	27,329,264.25	9,781,633.98

(13) 其他费用:

明细项目	2007 年度	2006 年度
信息披露费	260,000.00	260,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
银行托管帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	28,745.48	20,395.39
其他	0.00	2,000.00
合计	406,745.48	400,395.39

(14) 收益分配:

	登记日	分红率	现金 形式发放	再投资 形式发放	发放红利 合计
第一次中期分红	07/06/07	每 10 份基金份额 3.00 元	161,090,419.27	208,749,149.74	369,839,569.01
第二次中期分红	07/09/20	每 10 份基金份额 8.00 元	596,997,885.90	770,579,068.31	1,367,576,954.21
			758,088,305.17	979,328,218.05	1,737,416,523.22

10. 本基金流通受限、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 2007 年 12 月 31 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	33.40	1,500,000	39,000,000.00	50,100,000.00
601857	中国石油	2007-10-30	2008-2-5	新股网下申购	16.70	30.96	1,045,500	17,459,850.00	32,368,680.00
601390	中国中铁	2007-11-23	2008-3-3	新股网下申购	4.80	11.49	1,903,178	9,135,254.40	21,867,515.22
002092	中泰化学	2007-12-20	2008-1-7	公开增发	30.90	38.10	565,472	17,473,084.80	21,544,483.20
601088	中国神华	2007-9-27	2008-1-9	新股网下申购	36.99	65.61	279,800	10,349,802.00	18,357,678.00
601601	中国太保	2007-12-18	2008-3-26	新股网下申购	30.00	49.45	135,732	4,071,960.00	6,711,947.40
601866	中海集运	2007-12-7	2008-3-12	新股网下申购	6.62	12.15	546,091	3,615,122.42	6,635,005.65
002202	金风科技	2007-12-18	2008-3-26	新股网下申购	36.00	140.45	40,866	1,471,176.00	5,739,629.70
601999	出版传媒	2007-12-18	2008-3-21	新股网下申购	4.64	20.24	203,277	943,205.28	4,114,326.48
002194	武汉凡谷	2007-11-28	2008-3-7	新股网下申购	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
002176	江特电机	2007-9-26	2008-1-14	新股网下申购	11.80	35.08	47,222	557,219.60	1,656,547.76
002175	广陆数测	2007-9-26	2008-1-14	新股网下申购	11.09	35.20	39,000	432,510.00	1,372,800.00
002186	全聚德	2007-11-7	2008-2-20	新股网下申购	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
002197	证通电子	2007-12-6	2008-3-18	新股网下申购	11.28	31.90	33,365	376,357.20	1,064,343.50
601918	国投新集	2007-12-7	2008-3-20	新股网下申购	5.88	15.92	63,300	372,204.00	1,007,736.00
002187	广百股份	2007-11-12	2008-2-22	新股网下申购	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
002179	中航光电	2007-10-22	2008-2-1	新股网下申购	16.19	45.85	17,146	277,593.74	786,144.10
002177	御银股份	2007-10-24	2008-2-1	新股网下申购	13.79	68.00	10,305	142,105.95	700,740.00
002184	海得控制	2007-11-7	2008-2-18	新股网下申购	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52
002189	利达光电	2007-11-19	2008-3-3	新股网下申购	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
002181	粤传媒	2007-11-7	2008-2-18	新股网下申购	7.49	26.68	12,421	93,033.29	331,392.28
002201	九鼎新材	2007-12-13	2008-3-26	新股网下申购	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
002190	成飞集成	2007-11-19	2008-3-3	新股网下申购	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68
002178	延华智能	2007-10-24	2008-2-1	新股网下申购	7.89	23.20	10,994	86,742.66	255,060.80
002199	东晶电子	2007-12-12	2008-3-21	新股网下申购	8.80	25.50	9,645	84,876.00	245,947.50
002196	方正电机	2007-12-4	2008-3-12	新股网下申购	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
002188	新嘉联	2007-11-12	2008-2-22	新股网下申购	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
002195	海隆软件	2007-12-4	2008-3-12	新股网下申购	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
合计								107,921,624.05	180,578,065.76

(b)、截至 2007 年 12 月 31 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
600415	小商品城	2007-12-11	86.59	公告重大事项	2008-03-05	95.25	686,868	63,079,440.29	59,475,900.12
600236	桂冠电力	2007-11-23	11.95	公告重大事项	2008-01-03	13.15	3,604,591	53,189,519.87	43,074,862.45
000400	许继电气	2007-09-08	18.90	未按时披露信息	2008-01-07	20.79	200,000	3,146,020.00	3,780,000.00
600331	宏达股份	2007-09-27	80.20	公告重大事项	未知	未知	22,730	1,575,189.00	1,822,946.00
合计								120,990,169.16	108,153,708.57

(2)、流通受限制不能自由转让的债券：

基金认购新发行分离交易可转债而取得的债券，从债券认购日至债券上市日期间暂无法流通。本基金截至 2007 年 12 月 31 日止流通受限制的债券情况如下：

债券代码	债券名称	成功认购日期	可流通日期	单位成本	年末估值单价	认购数量	年末成本总额	年末估值总额
126008	08 上汽债	2007-12-24	2008-01-08	68.75	71.80	15,150	1,041,531.28	1,087,770.00

(3)、流通受限制不能自由转让的权证：

基金认购新发行分离交易可转债而取得的权证，从权证获配日至权证上市日期间暂无法流通。本基金截至 2007 年 12 月 31 日止流通受限制的权证情况如下：

权证代码	权证名称	成功送配日期	可流通日期	单位成本	年末估值单价	送配数量	年末成本总额	年末估值总额
580016	上汽 CWB1	2007-12-24	2008-01-08	8.68	9.0857	54,540	473,335.90	495,534.08

(4)、期末债券正回购交易中作为质押的债券：

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金从事银行间同业市场的债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元(2006 年：0.00 元)，是以如下债券作为质押：

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量	期末估值总额
-	-	-	-	-	-
合 计				-	-

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0.00 元(2006 年：0.00 元)。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

(5)、期末买断式逆回购交易中取得的债券

截至 2007 年 12 月 31 日止，基金在买断式逆回购交易时收到的、在债券所有人没有违约时就可以出售或在用于质押的债券的公允价值及基金实际再出售或质押情况如下：

2007 年末和 2006 年末均无。

11. 风险管理

(a) 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务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制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立风险控制委员会，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；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，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风险管理部和合规监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。风险管理部和合规监察稽核部对公司总经理负责，并由副总经理和督察长分管。

本基金的基金管理人建立了以风险控制委员会为核心、由督察长、合规与风险管理委员会、风险管理部、合规监察稽核部和相关业务部门共同构成的风险管理架构体系。

(b) 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券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发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险。

(c) 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。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，因此除在附注 10 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，其余均能及时变现。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。本基金所持有的金融负债的合约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。

本基金的基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险

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。

(d) 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，包括市场价格风险、利率风险和外汇风险。

(i) 市场价格风险

市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且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。

本基金投资组合中可转换债券及其对应的基础股票投资比例为基金资产净值的 10%-70%，除可转换债券外的其它债券投资比例为基金资产净值的 10%-65%，除可转换债券所对应基础股票外的其它股票投资比例为基金资产净值的 10%-65%。于 2007 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

	2007 年 12 月 31 日		2006 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值的比例	公允价值	占基金资产净值的比例
交易性金融资产				
- 股票投资	2,020,380,319.72	62.46%	1,140,285,922.33	67.11%
- 债券投资	867,076,949.30	26.80%	381,666,363.72	22.46%
衍生金融资产				
- 权证投资	495,534.08	0.02%	25,928,793.60	1.53%
	<u>2,887,952,803.10</u>	<u>89.27%</u>	<u>1,547,881,079.65</u>	<u>91.10%</u>

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准(见附注 1)上升 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约 1.09 亿元(2006 年：8,234 万元)；反之，若本基金业绩比较基准(见附注 1)下降 5%且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约 1.09 亿元(2006 年：8,234 万元)。

(ii) 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。本基金的基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。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者予以分类。

2007 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	114,223,202.81	-	-	-	114,223,202.81

结算备付金	217,804,209.03	-	-	-	217,804,209.03
存出保证金	101,282.05	-	-	1,741,245.46	1,842,527.51
交易性金融资产	753,316,000.00	110,386,695.10	3,374,254.20	2,020,380,319.72	2,887,457,269.02
衍生金融资产	-	-	-	495,534.08	495,534.08
应收证券清算款	-	-	-	6,659,692.17	6,659,692.17
应收利息	-	-	-	15,157,692.50	15,157,692.50
应收申购款	-	-	-	17,071,494.67	17,071,494.67
资产总计	1,085,444,693.89	110,386,695.10	3,374,254.20	2,061,505,978.60	3,260,711,621.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,880,673.22	3,880,673.22
应付赎回款	-	-	-	15,459,201.95	15,459,201.95
应付管理人报酬	-	-	-	3,135,729.05	3,135,729.05
应付托管费	-	-	-	653,276.89	653,276.89
应付交易费用	-	-	-	1,353,713.87	1,353,713.87
应交税费	-	-	-	505,937.20	505,937.20
其他负债	-	-	-	823,092.48	823,092.48
负债总计	-	-	-	25,811,624.66	25,811,624.66
利率敏感度缺口	1,085,444,693.89	110,386,695.10	3,374,254.20	2,035,694,353.94	3,234,899,997.13

2006 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	148,464,268.88	-	-	-	148,464,268.88
结算备付金	4,145,192.49	-	-	-	4,145,192.49
存出保证金	109,609.61	-	-	500,000.00	609,609.61
交易性金融资产	306,897,040.63	66,796,789.29	7,972,533.80	1,140,285,922.33	1,521,952,286.05
衍生金融资产	-	-	-	25,928,793.60	25,928,793.60
应收证券清算款	-	-	-	10,034,187.78	10,034,187.78
应收利息	-	-	-	2,490,005.07	2,490,005.07
应收申购款	-	-	-	31,164,927.09	31,164,927.09
资产总计	459,616,111.61	66,796,789.29	7,972,533.80	1,210,403,835.87	1,744,789,270.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	41,793,550.83	41,793,550.83
应付管理人报酬	-	-	-	1,179,203.57	1,179,203.57
应付托管费	-	-	-	245,667.40	245,667.40
应付交易费用	-	-	-	1,821,547.93	1,821,547.93
应交税费	-	-	-	96,372.20	96,372.20
其他负债	-	-	-	618,141.33	618,141.33
负债总计	-	-	-	45,754,483.26	45,754,483.26
利率敏感度缺口	459,616,111.61	66,796,789.29	7,972,533.80	1,164,649,352.61	1,699,034,787.31

于 2007 年 12 月 31 日，若市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加约 173 万元(2006 年：150 万元)；反之，若市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变，本基金资产净值则将相应下降约 173 万元(2006 年：150 万元)。

(iii) 外汇风险

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。

12. 首次执行企业会计准则

如附注 2 所述，本财务报表为本基金首份按照企业会计准则编制的财务报表。2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的相关数字已按照《企业会计准则第 38 号—首次执行企业会计准则》的要求进行追溯调整，所有报表项目已按照本财务报表的披露方式进行了重分类。

按原会计准则和制度列报的 2006 年 1 月 1 日、2006 年 12 月 31 日和 2007 年 6 月 30 日的所有者权益，以及 2006 年度和 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间的净损益调整为按企业会计准则列报的所有者权益及净损益的调节过程列示如下：

	2006 年 1 月 1 日 所有者权益	2006 年度 净损益	2006 年 12 月 31 日 所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	1,064,076,460.83	714,888,931.66	1,699,034,787.31
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	123,179,318.08	-
按企业会计准则列报的金额	1,064,076,460.83	838,068,249.74	1,699,034,787.31

	2007 年 1 月 1 日 所有者权益	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日 止期间净损益	2007 年 6 月 30 日 所有者权益
按原会计准则和制度列报的金额	1,699,034,787.31	548,017,864.22	2,099,583,813.23
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	414,798,651.18	-
按企业会计准则列报的金额	1,699,034,787.31	962,816,515.40	2,099,583,813.23

根据上述追溯调整，按原会计准则和制度直接记入所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目的投资估值增值/(减值)净变动现按企业会计准则在利润表中的“公允价值变动收益/(损失)”科目中核算，相应的未实现损益平准金现按企业会计准则直接记入“未分配利润/(累计亏损)”科目。于会计期末，按原会计准则和制度列示于所有者权益下“未实现利得/(损失)”科目中的全部余额，现按企业会计准则包含于“未分配利润/(累计亏损)”科目中。

八、投资组合报告

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	2,020,380,319.72	61.96%

2	债券	867,076,949.30	26.59%
3	权证	495,534.08	0.02%
4	银行存款和结算备付金	332,027,411.84	10.18%
5	其它资产	40,731,406.85	1.25%
	合计	3,260,711,621.79	100.00%

(二)、股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
B	采掘业	80,644,321.17	2.49%
C	制造业	819,540,378.01	25.33%
C0	食品、饮料	3,028,000.00	0.09%
C3	造纸、印刷	3,593,056.50	0.11%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	149,160,543.65	4.61%
C5	电子	90,944,251.40	2.81%
C6	金属、非金属	166,989,257.07	5.16%
C7	机械、设备、仪表	270,100,237.26	8.35%
C8	医药、生物制品	135,725,032.13	4.20%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,584,754.00	0.05%
E	建筑业	69,622,365.22	2.15%
F	交通运输、仓储业	177,681,401.17	5.49%
G	信息技术业	26,303,975.54	0.81%
H	批发和零售贸易	241,113,556.54	7.45%
I	金融、保险业	297,404,942.27	9.19%
J	房地产业	91,523,002.40	2.83%
K	社会服务业	111,938,862.52	3.46%
L	传播与文化产业	43,546,860.76	1.35%
M	综合类	59,475,900.12	1.84%
	合计	2,020,380,319.72	62.46%

(三)、股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	市值	占资产净值比例
1	600830	大红鹰	6,666,600	150,331,830.00	4.65%
2	000581	威孚高科	7,777,700	145,520,767.00	4.50%
3	601919	中国远洋	2,855,551	121,817,805.66	3.77%
4	600036	招商银行	2,787,776	110,479,562.88	3.42%
5	600825	新华传媒	1,759,583	89,932,287.13	2.78%
6	600383	金地集团	2,127,353	75,696,002.40	2.34%
7	600309	烟台万华	1,933,792	73,580,785.60	2.27%
8	002022	科华生物	1,800,000	63,900,000.00	1.98%
9	600478	力元新材	2,200,000	61,402,000.00	1.90%
10	600415	小商品城	686,868	59,475,900.12	1.84%
11	000069	华侨城A	1,100,000	55,275,000.00	1.71%
12	600000	浦发银行	1,036,370	54,720,336.00	1.69%



13	601318	中国平安	509,933	54,103,891.30	1.67%
14	601939	建设银行	5,219,516	51,412,232.60	1.59%
15	601088	中国神华	735,797	48,275,641.17	1.49%
16	600102	莱钢股份	2,350,000	46,671,000.00	1.44%
17	600236	桂冠电力	3,604,591	43,074,862.45	1.33%
18	002092	中泰化学	1,085,472	41,356,483.20	1.28%
19	600001	邯郸钢铁	5,000,000	40,550,000.00	1.25%
20	600037	歌华有线	1,242,341	39,059,201.04	1.21%
21	600479	千金药业	880,000	38,473,600.00	1.19%
22	600266	北京城建	1,200,000	34,776,000.00	1.08%
23	600029	南方航空	1,198,819	33,495,002.86	1.04%
24	601857	中国石油	1,045,500	32,368,680.00	1.00%
25	600786	东方锅炉	377,885	31,912,388.25	0.99%
26	600584	长电科技	1,600,000	27,856,000.00	0.86%
27	000410	沈阳机床	1,333,333	27,239,993.19	0.84%
28	600219	南山铝业	1,008,988	26,929,889.72	0.83%
29	000401	冀东水泥	1,267,962	26,310,211.50	0.81%
30	601390	中国中铁	2,268,178	26,061,365.22	0.81%
31	000717	韶钢松山	2,080,126	24,004,654.04	0.74%
32	600536	中国软件	1,333,617	23,978,433.66	0.74%
33	000822	山东海化	1,102,220	18,903,073.00	0.58%
34	000963	华东医药	1,085,736	17,914,644.00	0.55%
35	600641	万业企业	700,000	15,827,000.00	0.49%
36	002152	广电运通	138,876	14,930,558.76	0.46%
37	000527	美的电器	373,597	13,864,184.67	0.43%
38	000912	泸天化	669,839	13,497,255.85	0.42%
39	600269	赣粤高速	631,600	11,602,492.00	0.36%
40	600030	中信证券	122,342	10,921,470.34	0.34%
41	002031	巨轮股份	669,800	10,602,934.00	0.33%
42	601601	中国太保	213,732	10,569,047.40	0.33%
43	600379	宝光股份	939,785	10,516,194.15	0.33%
44	000978	桂林旅游	431,950	10,103,310.50	0.31%
45	000028	一致药业	394,850	8,884,125.00	0.27%
46	600496	长江精工	500,000	8,785,000.00	0.27%
47	601866	中海集运	546,091	6,635,005.65	0.21%
48	600535	天士力	297,713	6,552,663.13	0.20%
49	002202	金风科技	40,866	5,739,629.70	0.18%
50	601166	兴业银行	100,000	5,186,000.00	0.16%
51	600009	上海机场	110,000	4,127,200.00	0.13%
52	601999	出版传媒	203,277	4,114,326.48	0.13%
53	000400	许继电气	200,000	3,780,000.00	0.12%
54	600308	华泰股份	125,150	3,593,056.50	0.11%
55	600132	重庆啤酒	100,000	3,028,000.00	0.09%
56	002140	东华科技	20,000	1,944,000.00	0.06%
57	600331	宏达股份	22,730	1,822,946.00	0.06%



58	002194	武汉凡谷	33,001	1,713,081.91	0.05%
59	002176	江特电机	47,222	1,656,547.76	0.05%
60	601918	国投新集	99,300	1,580,856.00	0.05%
61	002171	精诚铜业	46,723	1,404,960.61	0.04%
62	002175	广陆数测	39,000	1,372,800.00	0.04%
63	002177	御银股份	19,305	1,312,740.00	0.04%
64	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.03%
65	002197	证通电子	33,365	1,064,343.50	0.03%
66	002187	广百股份	19,759	849,439.41	0.03%
67	002179	中航光电	17,146	786,144.10	0.02%
68	000960	锡业股份	10,000	660,600.00	0.02%
69	002178	延华智能	19,994	463,860.80	0.01%
70	002201	九鼎新材	14,176	451,789.12	0.01%
71	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.01%
72	002181	粤传媒	13,993	373,333.24	0.01%
73	002189	利达光电	24,710	363,237.00	0.01%
74	002190	成飞集成	14,098	298,313.68	0.01%
75	002199	东晶电子	11,645	296,947.50	0.01%
76	002196	方正电机	9,880	240,874.40	0.01%
77	002188	新嘉联	11,180	239,922.80	0.01%
78	002195	海隆软件	6,796	223,316.56	0.01%
79	000651	格力电器	972	47,968.20	0.00%
80	601628	中国人寿	200	11,588.00	0.00%
81	000060	中金岭南	100	4,444.00	0.00%
82	600900	长江电力	200	3,898.00	0.00%
83	600428	中远航运	100	3,895.00	0.00%
84	000039	中集集团	66	1,708.08	0.00%
85	600588	用友软件	27	1,378.89	0.00%
86	600016	民生银行	39	577.98	0.00%
87	601398	工商银行	29	235.77	0.00%

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期初基金资产 净值的比例
1	000581	威孚高科	171,483,548.98	10.09%
2	600036	招商银行	157,171,981.32	9.25%
3	600015	华夏银行	126,651,281.58	7.45%
4	601919	中国远洋	124,740,292.89	7.34%
5	600830	大红鹰	119,626,155.00	7.04%
6	002022	科华生物	114,578,654.95	6.74%
7	600000	浦发银行	103,870,666.51	6.11%
8	000069	华侨城 A	90,916,009.47	5.35%

9	000401	冀东水泥	86,714,173.04	5.10%
10	601318	中国平安	84,776,557.00	4.99%
11	600383	金地集团	81,394,431.66	4.79%
12	600825	新华传媒	81,287,765.94	4.78%
13	601398	工商银行	75,841,275.44	4.46%
14	600415	小商品城	72,511,031.97	4.27%
15	002092	中泰化学	68,890,483.03	4.05%
16	601939	建设银行	68,580,279.32	4.04%
17	600309	烟台万华	64,596,841.51	3.80%
18	600001	邯郸钢铁	62,989,680.43	3.71%
19	600050	中国联通	61,986,554.50	3.65%
20	000039	中集集团	60,818,882.00	3.58%
21	600102	莱钢股份	60,728,765.25	3.57%
22	600009	上海机场	59,580,791.83	3.51%
23	601006	大秦铁路	57,039,458.84	3.36%
24	600478	力元新材	56,431,853.42	3.32%
25	600236	桂冠电力	53,189,519.87	3.13%
26	000088	盐田港	50,021,129.81	2.94%
27	600016	民生银行	49,928,201.14	2.94%
28	601088	中国神华	47,027,498.60	2.77%
29	600019	宝钢股份	42,030,873.43	2.47%
30	600479	千金药业	41,019,962.08	2.41%
31	000822	山东海化	39,666,627.00	2.33%
32	600639	浦东金桥	38,793,863.01	2.28%
33	600379	宝光股份	38,130,043.72	2.24%
34	600037	歌华有线	37,774,874.59	2.22%
35	600786	东方锅炉	37,539,390.89	2.21%
36	600029	南方航空	36,931,802.30	2.17%
37	600219	南山铝业	36,680,009.57	2.16%
38	600325	华发股份	36,236,868.01	2.13%
39	600266	北京城建	34,774,254.26	2.05%
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额(元)	占期初基金资产 净值的比例
1	000401	冀东水泥	231,973,502.75	13.65%
2	600000	浦发银行	200,592,959.66	11.81%
3	600009	上海机场	163,651,333.95	9.63%
4	600015	华夏银行	162,076,681.23	9.54%
5	601006	大秦铁路	144,196,420.26	8.49%
6	000792	盐湖钾肥	116,397,009.92	6.85%
7	600456	宝钛股份	114,828,282.53	6.76%
8	600383	金地集团	114,302,476.04	6.73%
9	600596	新安股份	111,326,203.25	6.55%
10	600761	安徽合力	107,420,718.63	6.32%
11	002022	科华生物	105,592,931.57	6.21%
12	600028	中国石化	101,336,998.88	5.96%

13	000951	中国重汽	100,710,736.52	5.93%
14	000858	五 粮 液	93,237,215.93	5.49%
15	601398	工商银行	89,972,216.17	5.30%
16	600276	恒瑞医药	80,475,362.78	4.74%
17	600016	民生银行	77,423,434.84	4.56%
18	600036	招商银行	77,229,835.86	4.55%
19	600050	中国联通	71,903,543.17	4.23%
20	600694	大商股份	68,929,916.75	4.06%
21	600639	浦东金桥	64,864,824.71	3.82%
22	600561	江西长运	56,541,758.36	3.33%
23	600019	宝钢股份	54,739,319.64	3.22%
24	000039	中集集团	53,228,871.92	3.13%
25	600037	歌华有线	52,237,379.96	3.07%
26	002092	中泰化学	52,225,748.52	3.07%
27	000088	盐 田 港	50,418,768.43	2.97%
28	600026	中海发展	49,767,017.85	2.93%
29	600325	华发股份	47,035,645.95	2.77%
30	002025	航天电器	46,588,978.97	2.74%
31	600290	华仪电气	46,363,698.70	2.73%
32	600549	厦门钨业	44,009,233.60	2.59%
33	000528	柳 工	42,346,288.33	2.49%
34	601318	中国平安	41,716,283.60	2.46%
35	600268	国电南自	40,484,003.34	2.38%
36	600150	中国船舶	39,062,811.53	2.30%
37	000061	农 产 品	34,842,298.27	2.05%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额。

买入股票的成本总额：	3,719,053,040.26
卖出股票的收入总额：	4,412,168,182.90

(五)、 债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	14,634.00	0.00%
2	金融债券	48,590,000.00	1.50%
3	企业债券	102,042,202.90	3.15%
4	央行票据	675,377,000.00	20.88%
5	可转换债券	11,704,112.40	0.36%
6	企业短期融资券	29,349,000.00	0.91%
	合计	867,076,949.30	26.80%

(六)、前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	0701004	07 央票 04	2,500,000	243,200,000.00	7.52%
2	0701025	07 央票 25	1,500,000	145,560,000.00	4.50%
3	0701141	07 央票 141	1,000,000	99,170,000.00	3.07%
4	0501031	05 央票 31	800,000	79,976,000.00	2.47%
5	0701018	07 央票 18	800,000	77,720,000.00	2.40%

(七)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	市值(元)	占资产净值比例
1	580016	上汽 CWB1	54,540	495,534.08	0.02%

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

本基金持有的上市证券采用公告内容截止日（或最近交易日）的市场收盘价计算，已发行未上市股票采用成本价计算，未上市交易的权证投资（包括配股权证）按公允价值估值。

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

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

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	128031	巨轮转债	48,070	10,062,012.40	0.31%

5、整个报告期内获得的权证明细

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

九、基金份额持有人户数和持有人结构

1、基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	115,596 户	
平均每户持有基金份额	24,352.07	
机构投资者持有的基金份额	746,930,112.50	26.53%
个人投资者持有的基金份额	2,068,071,352.39	73.47%

2、期末基金管理公司从业人员投资开放式基金的情况

项 目	期末持有本开放式基金份 额的总量(份)	占本基金总份额的比 例(%)
基金管理公司持有本基金的所有 从业人员	103,269.62	0.004%

十、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	1,130,480,770.08
期初基金份额总额	1,473,522,718.96
加：本期申购基金份额总额	4,158,604,984.81
减：本期赎回基金份额总额	2,817,126,238.88
期末基金份额总额	2,815,001,464.89

十一、重大事件

- (一)、 基金份额持有人大会决议：无。
- (二)、 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。
- 1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 2007 年 3 月 22 日, 本基金管理人发布关于董事变更的公告, 经华安基金管理有限公司股东会议决议, 同意张军先生因个人原因辞去本公司董事职务。

(2). 2007 年 5 月 11 日, 本基金管理人发布关于高管人员变动的公告, 经华安基金管理有限公司董事会审议通过, 同意姚毓林先生由于个人原因辞去华安基金管理有限公司副总经理职务。

(3). 2007 年 7 月 26 日, 本基金管理人发布关于聘任总经理、副总经理的公告, 经华安基金管理有限公司第三届董事会审议通过, 决定聘请俞妙根先生担任公司总经理职务, 聘请韩勇先生担任副总经理职务。

(4). 2007 年 4 月 18 日, 由于汤礼辉先生因个人原因提出辞职, 经华安基金管理公司董事会审议批准, 汤礼辉先生不再担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理, 袁蓓女士仍继续担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下:

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

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

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

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

(三)、本年度无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

(四)、基金投资策略的改变: 无。

(五)、基金收益分配事项:

	权益登记日、除 息日	红利划出日、红利 再投资日	每10份基金份额 收益分配金额
本报告期第1次分红	2007 年 6 月 7 日	2007 年 6 月 8 日	3.00 元
本报告期第2次分红	2007 年 9 月 20 日	2007 年 9 月 21 日	8.00 元
本报告期第3次分红	2008 年 1 月 7 日	2008 年 1 月 8 日	0.40 元

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况: 本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况如下: 100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限: 自基金合同生效日起至今。

(七)、基金管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情形, 包括稽查或处罚的次数、原因及结论, 如监管部门提出整改意见的, 应简单说明整改情况: 无。

(八)、本报告期间租用证券公司交易单元情况如下：

1. 报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

新增交易单元：

券商名称	上交所交易单元数	深交所交易单元数
中信证券股份有限公司	1	0

2. 交易成交量及佣金情况：

(1). 股票交易情况：

券商名称	租用交易单元数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
渤海证券有限责任公司	1	2,131,633,600.87	27.43%	1,747,884.76	27.80%
海通证券股份有限公司	1	1,691,928,772.85	21.77%	1,323,944.55	21.06%
中信建投证券有限责任公司	1	559,587,964.86	7.20%	437,880.68	6.96%
申银万国股份有限公司	1	1,421,961,953.15	18.30%	1,165,990.43	18.54%
兴业证券股份有限公司	1	288,295,895.60	3.71%	236,400.86	3.76%
中信证券股份有限公司	1	1,677,644,265.80	21.59%	1,375,662.56	21.88%
合 计	6	7,771,052,453.13	100.00%	6,287,763.84	100.00%

(2). 债券、回购及权证交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例	权证成交量	占总成交总量比例
渤海证券有限责任公司	15,111,938.50	11.40%	100,000,000.00	76.92%	37,921,439.69	19.30%
海通证券股份有限公司	26,010,526.09	19.62%	0.00	0.00%	95,526,149.43	48.61%
中信建投证券有限责任公司	2,009,040.00	1.52%	0.00	0.00%	44,732,573.01	22.76%
申银万国股份有限公司	12,490,933.80	9.42%	30,000,000.00	23.08%	0.00	0.00%
兴业证券股份有限公司	9,066,362.10	6.84%	0.00	0.00%	13,545,081.50	6.89%
中信证券股份有限公司	67,908,071.90	51.21%	0.00	0.00%	4,786,455.30	2.44%
合 计	132,596,872.39	100.00%	130,000,000.00	100.00%	196,511,698.93	100.00%

3. 券商专用交易单元选择标准：

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

(1) 资历雄厚，信誉良好；

(2) 财务状况良好，经营行为规范；

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

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

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

4. 券商专用交易单元选择程序:

(1) 对候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部等部门组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管副总审批

公司分管副总对研究发展部等部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

(九)、其他事项:

1. 变更基金份额发售机构:

公告事项	披露日期
1) 关于华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金在中信建投证券有限责任公司开展网上申购费率优惠活动的公告	[2007-01-19]
2) 关于新增中信金通证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-04-06]
3) 关于新增中信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-04-12]
4) 关于增加中国农业银行金穗卡持有人办理基金网上交易业务的公告	[2007-06-08]
5) 关于新增中国工商银行股份有限公司为华安宝利配置证券投资基金代销机构的公告	[2007-06-29]
6) 关于新增德邦证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-08-01]
7) 关于新增中国建设银行股份有限公司代销华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金的公告	[2007-08-03]
8) 关于新增东方证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	[2007-08-10]
9) 关于开通中国建设银行股份有限公司代销旗下六只开放式基金定期定额申购业务的公告	[2007-08-10]
10) 关于新增招商银行股份有限公司代销华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基	[2007-08-24]

- 金的公告
- 11) 关于在中国工商银行股份有限公司开通华安宝利配置证券投资基金定期定额投资计划的公告 [2007-08-27]
 - 12) 关于参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告 [2007-09-13]
 - 13) 关于增加中国邮政储蓄银行代销华安宝利配置证券投资基金的公告 [2007-09-17]
 - 14) 关于新增深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告 [2007-09-19]
 - 15) 关于华安基金管理有限公司在深圳发展银行开展网上银行申购费率优惠活动的公告 [2007-09-19]
 - 16) 关于参加交通银行基金定期定额申购优惠活动的公告 [2007-09-28]
 - 17) 关于新增长江证券有限责任公司为华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-19]
 - 18) 关于新增上海证券有限责任公司为华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-19]
 - 19) 关于新增北京银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-10-25]
 - 20) 关于新增中信银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-11-06]
 - 21) 关于新增国都证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-11-08]
 - 22) 关于新增宏源证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2007-11-10]
 - 23) 关于在中国邮政储蓄银行开通定期定额投资计划的公告 [2007-12-03]
 - 24) 关于参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告 [2007-12-26]
 - 25) 关于新增中国民生银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2008-01-15]
 - 26) 关于参加建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 [2008-01-25]
 - 27) 关于新增中国光大银行为华安宝利配置证券投资基金代销机构的公告 [2008-01-28]
 - 28) 关于参加建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 [2008-01-28]
 - 29) 关于新增华安宝利配置证券投资基金参加中国光大银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 [2008-01-29]
 - 30) 关于新增安信证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告 [2008-01-31]
 - 31) 关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告 [2008-02-25]
 - 32) 华安基金管理有限公司关于新增中原证券股份有限公司为华安宝利配置证券投资基金代销机构的公告 [2008-03-03]
 - 33) 华安基金管理有限公司关于新增深圳平安银行为开放式基金代销机构的公告 [2008-03-21]
 - 34) 华安基金管理有限公司关于新增华泰证券有限责任公司为

- 开放式基金代销机构的公告
- 35) 华安基金管理有限公司关于新增华安证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 [2008-03-24]
- 36) 华安基金管理有限公司关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告 [2008-03-24]
- 37) 华安基金管理有限公司关于调整华安宝利配置证券投资基金电子直销申购费率的公告 [2008-03-24]

2. 股权变动:

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

3. 基金合同修改:

- | 公告事项 | 披露日期 |
|---|--------------|
| 1) 关于修改旗下基金基金合同的公告, 本基金的申购费用及申购份额的计算条款修改为: “本基金采用 “外扣法” 计算申购费用及申购份额, 具体计算公式如下:
净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)
申购费用 = 申购金额 - 净申购金额
申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值” | [2007-05-11] |
| 2) 关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告, 自 2007 年 5 月 15 日起, 本基金的申购费用及申购份额统一调整为 “外扣法” 计算。 | [2007-05-11] |
| 3) 关于调整华安基金管理有限公司旗下基金基金转换计算方法的公告, 自 2007 年 6 月 1 日起, 我公司旗下华安创新证券投资基金 (简称 “华安创新”, 基金代码 040001), 华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 (简称 “华安中国 A 股”, 基金代码 040002)、华安宝利配置证券投资基金 (简称 “华安宝利”, 基金代码 040004) 和华安宏利股票型证券投资基金 (简称 “华安宏利”, 基金代码 040005) 之间及其与我公司旗下华安现金富利投资基金 (简称 “华安富利”, 基金代码 040003) 之间的基金转换费用中涉及的申购补差费计算将根据各基金不同的申购费率或固定费用统一调整为 “外扣法” 计算。 | [2007-05-29] |
| 4) 关于证券投资基金实施新的会计准则的公告, 根据中国证监会的相关规定, 我公司管理的所有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后, 基金将全面采 | [2007-07-02] |

用公允价值进行会计计量，请投资者关注相关法规的规定。实施新会计准则后，基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。

- 5) 关于修改华安宏利股票型证券投资基金的基金合同和托管协议的公告，根据中国证监会《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》（证监会计字[2006]23 号），证券投资基金自 2007 年 7 月 1 日起执行新会计准则。为了维护投资者利益，经与华安宏利股票型证券投资基金的托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并经向中国证监会备案，根据相关法律法规的规定及基金合同的约定，对华安宏利基金的基金合同中的基金资产估值的条款和基金收益构成的条款进行修改。 [2007-09-29]

4. 其他重要事项:

- | | 公告事项 | 披露日期 |
|----|---|--------------|
| 1) | 关于总机变更的公告，华安基金管理有限公司的电话总机自 2007 年 5 月 28 日起由（021）58881111 变更为（021）38969999。 | [2007-05-25] |
| 2) | 关于旗下基金投资金地集团（600383）非公开发行股票的公告 | [2007-07-11] |

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



十二、备查文件目录

- 1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宝利配置证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：
存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互
联网站 <http://www.huaan.com.cn>。
查阅方式：投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基
金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
2008 年 3 月 27 日