

华安创新证券投资基金 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
	(一)、基金概况	3
	(二)、基金的投资	3
	(三)、基金管理人	4
	(四)、基金托管人	4
	(五)、信息披露	5
	(六)、其他有关资料	5
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
	(一)、主要财务指标	5
	(二)、净值表现	6
	(三)、过往三年基金收益分配情况	7
四、	管理人报告	7
	(一)、基金管理人及基金经理简介	7
	(二)、基金运作合规性声明	8
	(三)、基金经理工作报告	8
	(四)、基金内部监察报告	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	14
八、	投资组合报告	32
	(一)、 基金资产组合	32
	(二)、 按行业分类的股票投资组合	32
	(三)、 股票明细	33
	(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动	35
	(五)、 按债券品种分类的债券投资组合	38
	(六)、 基金投资前五名债券明细	38
	(七)、 权证投资组合	38
	(八)、 资产支持证券投资组合	38
	(九)、 投资组合报告附注	38
九、	基金份额持有人户数和持有人结构	39
十、	开放式基金份额变动	39
十一、	重大事件	40
十二、	备查文件目录	48

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、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。

本年度财务报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计。

二、基金产品概况

(一)、基金概况

基金名称:	华安创新证券投资基金
基金简称:	华安创新
交易代码:	040001
深交所行情代码:	160401
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2001 年 9 月 21 日
期末基金份额总额:	14,456,717,159.41 份
基金存续期:	不定期

(二)、基金的投资

投资目标:	基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极追求投资收益的稳定增长为目标,以诚信原则及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。
-------	--

投资策略:	本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。
-------	--

这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。

高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。

传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。

本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务市场空间大，财务状况良好，具有相当竞争优势等。

本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。

业绩比较基准：基金整体业绩比较基准=75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率

（注：中信国债指数于 2006 年 4 月 12 日起更名为中信标普国债指数）。

风险收益特征：无

（三）、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

（四）、基金托管人

基金托管人：	交通银行股份有限公司
注册及办公地址：	上海市浦东新区银城中路 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

(五)、信息披露

信息披露报纸: 中国证券报、上海证券报、证券时报
 管理人互联网地址: <http://www.huaan.com.cn>
 报告置备地点: 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

(六)、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

(一)、主要财务指标

序号	主要财务指标	2007 年	2006 年	2005 年
1	本期利润	1,986,592,860.00	1,905,775,078.00	138,261,695.90
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	1,670,853,194.66	1,535,877,970.95	-87,837,600.71
3	加权平均份额本期利润	2.4207	1.0201	0.0569
4	期末可供分配利润	8,305,182,018.31	802,692,391.10	-168,091,431.68
5	期末可供分配份额利润	0.5745	0.7244	-0.0720
6	期末基金资产净值	14,415,317,074.83	2,228,030,516.022,366,196,286.38	
7	期末基金份额净值	0.997	2.011	1.013
8	加权平均净值利润率	38.44%	74.77%	5.92%
9	本期份额净值增长率	113.05%	112.08%	6.52%
10	份额累计净值增长率	418.67%	143.45%	14.79%

提示: 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。

注: 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)

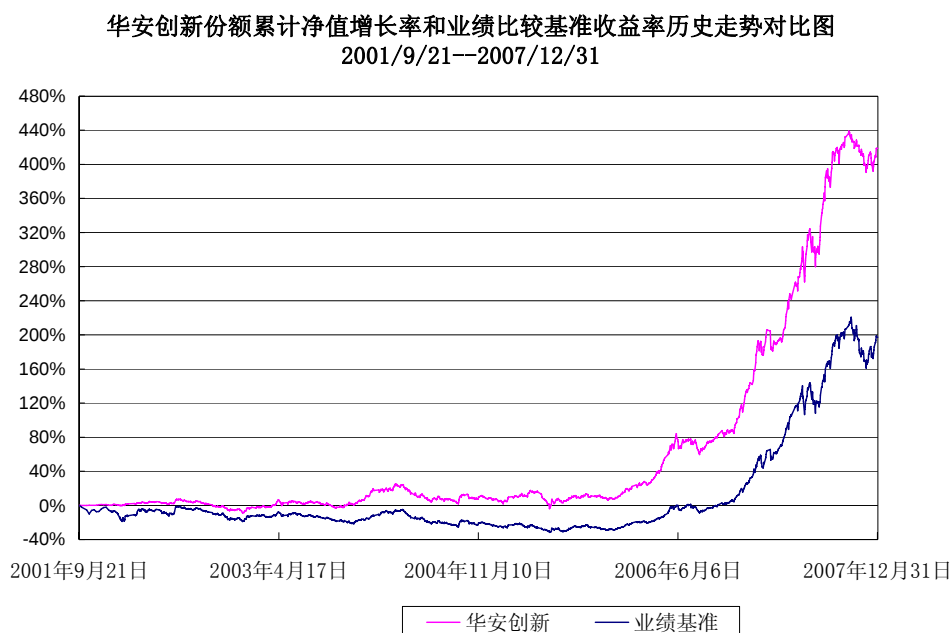
(二)、净值表现

A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值 增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.54%	0.86%	-2.41%	1.47%	-0.13%	-0.61%
过去六个月	30.19%	1.28%	31.04%	1.55%	-0.85%	-0.27%
过去一年	113.05%	1.59%	120.93%	1.72%	-7.88%	-0.13%
过去三年	381.30%	1.31%	327.19%	1.30%	54.11%	0.01%
过去五年	454.16%	1.16%	284.62%	1.16%	169.54%	0.00%
自基金合同 生效起至今	418.67%	1.05%	197.18%	1.18%	221.49%	-0.13%

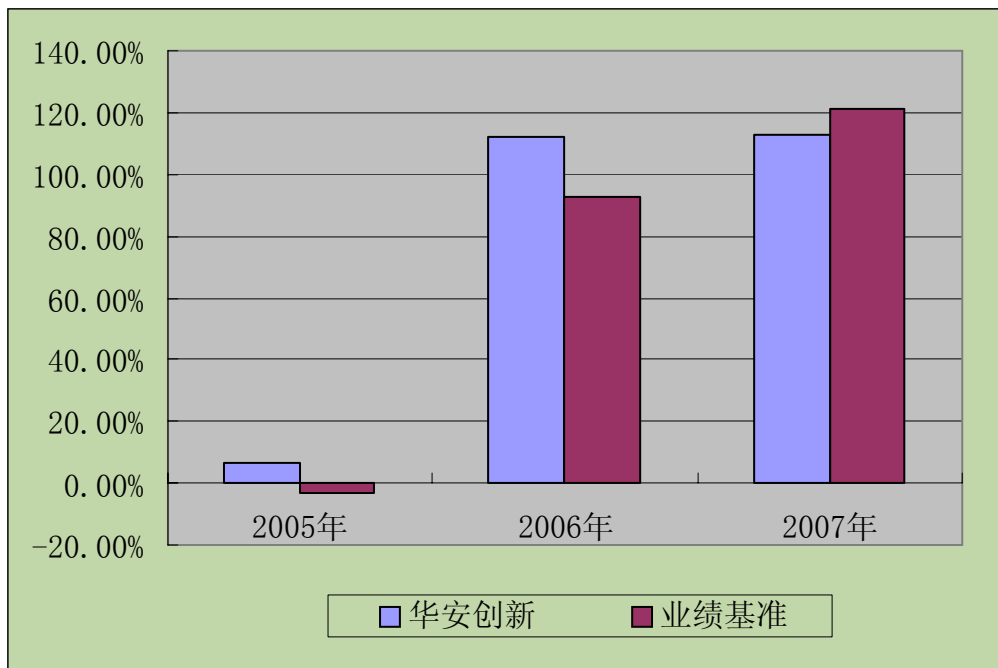
B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

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



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



(三)、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
2007 年度	无	
2006 年度	1.000 元	
2005 年度	无	
合计	1.000 元	

四、 管理人报告

(一)、基金管理人及基金经理简介

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。

刘新勇先生，硕士，持有基金从业人员资格证书，11 年证券从业经历。曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999 年 5 月加入华安基金管理有限公司后，曾任研究发展部高级研究员，2002 年 11 月至 2003 年 9 月担任华安上证 180 指数增强型证券投资基金（后更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金）的基金经理，2007 年 4 月至 2008 年 2 月担任基金安信的基金经

理，2003 年 9 月至今担任华安创新证券投资基金的基金经理。现任华安创新证券投资基金的基金经理。

（二）、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《华安创新证券投资基金基金合同》、《华安创新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。

（三）、基金经理工作报告

（1） 行情回顾

2007 年，市场继续演绎牛市行情，上证指数全年上涨了 96.66%。国民经济高速增长、人民币加速升值、流动性过剩、上市公司业绩超预期等诸多有利因素直接推动了指数的大幅上涨。但进入四季度后，诸多不利因素开始显现。美国次贷危机、货币紧缩政策、市场高估值等因素集中体现，市场开始中期调整，投资者情绪和信心表现出一定的不稳定性。全年华安创新净值增长为 113.05%，在晨星积极配置型基金中净值增长率居于前四分之一。华安创新于 10 月底完成拆分，规模扩大了近 3 倍。

（2） 操作回顾

华安创新总结前几年投资的经验和教训，围绕两条主线投资。第一，基于制度变革和产业结构优化给许多创新型企业带来的巨大成长机会，重点挖掘了一批尚未被市场完全认识的优质高成长企业，深入的研究和超前的判断为组合带来了较好的超额收益。第二，基于行业景气轮动的特点，分阶段调整了资产配置。上半年基于牛市的思路和周期性行业景气的特点，重点投资了有色金属行业和房地产行业，下半年减持了周期性行业增持了消费服务领域的稳定性行业，获得了较好的投资效果。第一条投资主线是基于上市公司研究的主要投资方法，是华安公司精选个股的投资理念的体现和基金经理的优势所在。第二条主线是基于行业研究的辅助投资方法，把握起来有较高的难度。全年对房地产行业的投资说明了这一点。二季度对房地产行业的布局及三季度房地产行业的良好表现奠定了收益的基础，但四季度对房地产行业的调控政策却没有引起足够的重视，致使损失了部分收益。

反思全年的投资过程，我们认为，2007 年的投资方法从单一个股选择到精选个股与行业轮动投资方法综合把握，是投资方法的一个转变。后者更适合于大资金的投资。2007 年的实践为今后的投资以及良好业绩的取得奠定了坚实的基础。

（3） 展望

2008 年无论对于全球经济，还是中国经济或者中国证券市场，都将面临较多不确定性。从外部环境看，美国经济的衰退或减速可能会传导给中国，而外围市场的变化又助推国内投资者的心理变化。从内部环境看，十年来首次提出的货币从紧政策对其他宏观政策、行业格局演变都有深远影响，中国经济面临转型。落实到证券市场，一个不容忽视的因素是，股票供给增大会阶段性打破市场和个股业已形成的传统式平衡。在这种情况下，我们仍然对 2008 年寄予希望。第一，

中国经济增长的长期动力依然强劲，农业工业化、农村城市化、地区不平衡决定了中国经济远未达到成熟水平。第二，2007 年消费对 GDP 的贡献比例显著提高，至首次超过投资的贡献，这对于缓解外部经济变化的压力将起到持续的推动作用。中央关于提高民生的规划也将促进财政政策转型。第三，历次的宏观调控都表明，对于有准备的优势企业，每一次调控都是更快发展的机遇，基金经理的工作就是要把这类企业找出来，长期分享企业成长的成果。因此，2008 年我们将更加强调精选个股的操作策略。行业方面将重点投资消费服务等稳定性行业及稀缺资源行业。同时，关注由于市场过度悲观导致超跌带来的阶段性机会。

（四）、基金内部监察报告

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，托管人在华安创新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创新证券投资基金投资运作、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。

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创新证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、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 20236 号

华安创新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创新证券投资基金(以下简称“华安创新基金”)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、《华安创新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创新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、《华安创新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创新基金 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

注册会计师

薛 竞

中国·上海市

注册会计师

2008 年 3 月 27 日

金 毅

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		163,236,866.83	270,537,951.95
结算备付金		2,556,336,034.38	28,490,677.43
存出保证金		1,179,938.10	1,109,609.61
交易性金融资产	9(1)	11,640,070,832.48	1,868,553,280.74
其中：股票投资		8,517,479,888.08	1,410,343,869.98
债券投资		3,122,590,944.40	458,209,410.76
衍生金融资产	9(2)	-	42,600,000.00
应收证券清算款		41,428,500.20	29,111,403.39
应收利息	9(3)	74,546,937.32	3,885,652.48
应收申购款		702,894.45	1,763,001.57
资产总计		14,477,502,003.76	2,246,051,577.17
负债：			
应付证券清算款		8,423,089.18	-
应付赎回款		24,856,738.18	11,530,441.36
应付管理人报酬		18,033,870.28	2,697,519.27

应付托管费		3,005,645.03	449,586.52
应付交易费用	9(4)	6,671,811.80	2,371,930.22
其他负债	9(5)	1,193,774.46	971,583.78
负债合计		62,184,928.93	18,021,061.15

所有者权益：

实收基金	9(6)	3,364,097,609.57	1,108,064,557.40
未分配利润		11,051,219,465.26	1,119,965,958.62
所有者权益合计		14,415,317,074.83	2,228,030,516.02
负债和所有者权益总计		14,477,502,003.76	2,246,051,577.17

基金份额总额(份)	14,456,717,159.41	1,108,064,557.40
基金份额净值	0.997	2.011

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
收入：			
利息收入		34,254,852.64	18,070,541.09
其中：存款利息收入		14,268,918.49	2,153,645.23
债券利息收入		19,961,978.13	15,769,387.22
买入返售金融资产收入		23,956.02	147,508.64
投资收益		1,782,240,486.82	1,580,901,317.36
其中：股票投资收益	9(7)	1,730,229,848.47	1,473,669,401.14
债券投资收益	9(8)	-2,633,573.94	1,145,358.46
衍生工具收益	9(9)	47,516,908.71	77,146,992.06
股利收益		7,127,303.58	28,939,565.70
公允价值变动收益	9(10)	315,739,665.34	369,897,107.05
其他收入	9(11)	4,992,172.69	9,848,410.35
收入合计		2,137,227,177.49	1,978,717,375.85

费用：

管理人报酬		75,488,005.67	38,331,479.19
托管费		12,581,334.12	6,388,579.90
交易费用	9(12)	55,115,362.77	24,552,304.54
利息支出		7,018,201.38	3,233,201.02
其中：卖出回购金融资产支出		7,018,201.38	3,233,201.02
其他费用	9(13)	431,413.55	436,733.20
费用合计		150,634,317.49	72,942,297.85

利润总额	1,986,592,860.00	1,905,775,078.00
------	------------------	------------------

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

	2007 年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	1,108,064,557.40	1,119,965,958.62	2,228,030,516.02
本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	-	1,986,592,860.00	1,986,592,860.00
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	2,256,033,052.17	7,944,660,646.64	10,200,693,698.81
其中：基金申购款	2,922,234,819.58	9,507,111,439.52	12,429,346,259.10
基金赎回款	666,201,767.41	1,562,450,792.88	2,228,652,560.29
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	-	-
年末所有者权益(基金净值)	3,364,097,609.57	11,051,219,465.26	14,415,317,074.83
	2006 年度		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
年初所有者权益(基金净值)	2,335,850,095.99	30,346,190.39	2,366,196,286.38
本年经营活动产生的基金净值变动数(本年净利润)	-	1,905,775,078.00	1,905,775,078.00
本年基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,227,785,538.59	-605,776,697.07	-1,833,562,235.66
其中：基金申购款	1,615,919,767.71	491,419,411.17	2,107,339,178.88
基金赎回款	2,843,705,306.30	1,097,196,108.24	3,940,901,414.54
本年向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数	-	210,378,612.70	210,378,612.70
年末所有者权益(基金净值)	1,108,064,557.40	1,119,965,958.62	2,228,030,516.02

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、 会计报表附注

1. 基金基本情况

华安创新证券投资基金(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[2001]第 33 号《关于同意华安创新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《华安创新证券投资基金基金契约》(后更名为《华安创新证券投资基金基金合同》)发起,并于 2001 年 9 月 21 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 5,000,001,124.00 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(2001)第 84 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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华安创新证券投资基金招募说明书》和《华安创新证券投资基金基金份额拆分公告》的有关规定,本基金于 2007 年 10 月 26 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1: 4.297369516,并于 2007 年 10 月 29 日进行了份额变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创新证券投资基金基金合同》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。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率 $\times$ 75%+中信标普国债指数收益率 $\times$ 25%。

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”)、《华安创新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》、《华安创新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. 重要会计政策和会计估计

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

本基金的记账本位币为人民币。

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。除衍生工具外的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。衍生工具在资产负债表中以衍生金融资产或衍生金融负债列示。

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。

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。

自 2006 年 11 月 13 日起基金取得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记入当期损益，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）。

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记入当期损益。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 1.5%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。基金份额拆分通过调整实收基金科目对应的基金份额数实现，由于基金份额拆分增加的基金份额数于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。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。基金当期可分配收益先弥补以前年度亏损后方可进行当年收益分配。基金当年亏损则不进行收益分配。

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。

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：

- 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) 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

无。

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 基金销售机构 基金注册登记机构	提取管理费	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
买入债券结算金额	-	93,723,904.11
卖出债券结算金额	-	136,682,767.12
卖出回购证券协议金额	856,400,000.00	-
卖出回购证券利息支出	560,334.13	-

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

支付基金管理人华安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 $\times$ 1.5% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金管理人报酬 75,488,005.67 元 (2006 年：38,331,479.19 元)。

② 基金托管费

支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日基金托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.25% / 当年天数。

本基金在本年度需支付基金托管费 12,581,334.12 元 (2006 年：6,388,579.90 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 163,236,866.83 元 (2006 年：270,537,951.95 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 8,956,714.83 元 (2006 年：1,549,178.99 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 2,556,336,034.38 元计入“结算备付金”科目 (2006 年：28,490,677.43 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 年度及 2006 年度基金管理有限公司均未投资本基金、均未持有本基金。

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：

2007 年末及 2006 年末基金管理公司主要股东及其控制的机构均未投资本基金、均未持有本基金。

9. 基金会计报表重要项目的说明

1) 交易性金融资产

成本	2007 年 12 月 31 日	
	公允价值	估值增值

股票投资	7,533,226,863.35	8,517,479,888.08	984,253,024.73
债券投资：	3,128,550,191.93	3,122,590,944.40	-5,959,247.53
—银行间市场	2,753,052,462.60	2,748,756,000.00	-4,296,462.60
—交易所	375,497,729.33	373,834,944.40	-1,662,784.93
	<u>10,661,777,055.28</u>	<u>11,640,070,832.48</u>	<u>978,293,777.20</u>

	成本	2006 年 12 月 31 日 公允价值	估值增值
股票投资	778,301,643.94	1,410,343,869.98	632,042,226.04
债券投资：	458,072,862.05	458,209,410.76	136,548.71
—银行间市场	292,047,856.16	292,047,856.16	-
—交易所	166,025,005.89	166,161,554.60	136,548.71
	<u>1,236,374,505.99</u>	<u>1,868,553,280.74</u>	<u>632,178,774.75</u>

2) 衍生金融资产

截至 2007 年 12 月 31 日止，本基金未持有衍生金融资产。本基金于 2006 年 12 月 31 日持有衍生金融资产的情况如下：

	成本	2006 年 12 月 31 日 公允价值	估值增值
权证投资	12,224,662.89	42,600,000.00	30,375,337.11

3) 应收利息

	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应收债券利息	72,536,918.16	3,794,327.22
应收结算备付金利息	1,861,516.12	12,006.26
应收银行存款利息	147,975.64	79,269.70
应收申购款利息	481.80	-
应收存出保证金利息	45.60	49.30
	<u>74,546,937.32</u>	<u>3,885,652.48</u>

4) 应付交易费用

	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付交易所交易佣金	6,665,836.42	2,371,930.22
应付银行间市场交易费用	5,975.38	-
	<u>6,671,811.80</u>	<u>2,371,930.22</u>

5) 其他负债

	2007 年 12 月 31 日	2006 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
预提费用	420,000.00	220,000.00
应付赎回费	23,774.46	1,583.78
	<u>1,193,774.46</u>	<u>971,583.78</u>

6) 实收基金

	基金份额	金额
2006 年 12 月 31 日	1,108,064,557.40	1,108,064,557.40
本期申购	1,934,306,868.48	1,934,306,868.48
其中：红利再投资	-	-
本期赎回	547,125,780.05	547,125,780.05
2007 年 10 月 26 日拆分前	<u>2,495,245,645.83</u>	<u>2,495,245,645.83</u>
基金份额拆分调整份额	8,227,746,928.60	
本期申购	4,245,491,877.39	987,927,951.10
其中：红利再投资	-	-
本期赎回	511,767,292.41	119,075,987.36
2007 年 12 月 31 日	<u>14,456,717,159.41</u>	<u>3,364,097,609.57</u>

根据《华安创新证券投资基金招募说明书》和《华安创新证券投资基金基金份额拆分公告》，基金管理人华安基金管理有限公司确定 2007 年 10 月 26 日为本基金的基金份额拆分日。当日基金资产净值为 10,722,992,574.43 元，拆分前基金份额总额为 2,495,245,645.83 份，拆分前基金份额净值为 4.297 元。根据基金份额拆分公式，基金份额折算比例为 1: 4.297369516，拆分后基金份额总额为 10,722,992,574.43 份，折算后基金份额净值为 1.000 元。华安基金管理有限公司已根据上述拆分比例，对各基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于 2007 年 10 月 29 日进行了份额变更登记。

7) 股票投资收益

	2007 年度	2006 年度
卖出股票成交总额	5,894,120,836.26	7,110,485,507.36
减：卖出股票成本总额	<u>4,163,890,987.79</u>	<u>5,636,816,106.22</u>
	<u>1,730,229,848.47</u>	<u>1,473,669,401.14</u>

本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 2,210.20 元(2006 年：9,200,304.24)，已全额冲减股票投资成本。

8) 债券投资收益/(损失)

	2007 年度	2006 年度
卖出及到期兑付债券结算金额	1, 118, 607, 250. 56	2, 299, 941, 167. 53
减: 应收利息总额	17, 070, 861. 03	43, 462, 069. 94
减: 卖出及到期兑付债券成本总额	1, 104, 169, 963. 47	2, 255, 333, 739. 13
	<u>-2, 633, 573. 94</u>	<u>1, 145, 358. 46</u>

9) 衍生工具收益

	2007 年度	2006 年度
卖出及行权权证成交金额	212, 353, 755. 40	130, 058, 631. 95
减: 卖出及行权权证成本总额	164, 836, 846. 69	52, 911, 639. 89
	<u>47, 516, 908. 71</u>	<u>77, 146, 992. 06</u>

10) 公允价值变动收益

	2007 年度	2006 年度
交易性金融资产		
—股票投资	352, 210, 798. 69	345, 293, 522. 67
—债券投资	-6, 095, 796. 24	-5, 771, 752. 73
衍生金融资产		
—权证投资	-30, 375, 337. 11	30, 375, 337. 11
	<u>315, 739, 665. 34</u>	<u>369, 897, 107. 05</u>

11) 其他收入

	2007 年度	2006 年度
赎回基金补偿收入(a)	4, 990, 822. 96	9, 848, 410. 35
其他	1, 349. 73	-
	<u>4, 992, 172. 69</u>	<u>9, 848, 410. 35</u>

本基金的赎回费率按持有期间递减, 赎回费在扣除不超过赎回总金额的 0. 1% 的基金注册与过户登记费后的余额列入基金资产。

12) 交易费用

	2007 年度	2006 年度
交易所交易费用	55,096,005.47	24,532,709.54
银行间市场交易费用	19,357.30	19,595.00
	<u>55,115,362.77</u>	<u>24,552,304.54</u>

13) 其他费用

	2007 年度	2006 年度
信息披露费	300,000.00	300,000.00
审计费用	100,000.00	100,000.00
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	13,413.55	13,733.20
其他	-	5,000.00
	<u>431,413.55</u>	<u>436,733.20</u>

10. 流通受限制不能自由转让的基金资产

1) 流通受限制不能自由转让的股票

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

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

本基金截至 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
601857	中国石油	07/10/30	08/02/05	新股网下申购	16.70	30.96	3,865,650	64,556,355.00	119,680,524.00
600383	金地集团	07/07/09	08/07/04	非公开发行	26.00	33.40	1,500,000	39,000,000.00	50,100,000.00
601088	中国神华	07/09/27	08/01/09	新股网下申购	36.99	65.61	475,660	17,594,663.40	31,208,052.60
601918	国投新集	07/12/07	08/03/20	新股网下申购	5.88	15.92	445,632	2,620,316.16	7,094,461.44
002202	金风科技	07/12/18	08/03/26	新股网下申购	36.00	140.45	40,866	1,471,176.00	5,739,629.70
002191	劲嘉股份	07/11/23	08/03/05	新股网下申购	17.78	33.20	131,115	2,331,224.70	4,353,018.00
601999	出版传媒	07/12/18	08/03/21	新股网下申购	4.64	20.24	203,277	943,205.28	4,114,326.48
002194	武汉凡谷	07/11/28	08/03/07	新股网下申购	21.10	51.91	33,001	696,321.10	1,713,081.91
002183	怡亚通	07/11/02	08/02/13	新股网下申购	24.89	77.95	20,376	507,158.64	1,588,309.20
002186	全聚德	07/11/07	08/02/20	新股网下申购	11.39	59.03	18,259	207,970.01	1,077,828.77
002197	证通电子	07/12/06	08/03/18	新股网下申购	11.28	31.90	33,365	376,357.20	1,064,343.50
002182	云海金属	07/11/02	08/02/13	新股网下申购	10.79	27.93	32,956	355,595.24	920,461.08
002187	广百股份	07/11/12	08/02/22	新股网下申购	11.68	42.99	19,759	230,785.12	849,439.41
002185	华天科技	07/11/08	08/02/20	新股网下申购	10.55	21.44	33,697	355,503.35	722,463.68
002184	海得控制	07/11/07	08/02/18	新股网下申购	12.90	23.01	16,852	217,390.80	387,764.52



002189	利达光电	07/11/19	08/03/03	新股网下申购	5.10	14.70	24,710	126,021.00	363,237.00
002181	粤传媒	07/11/07	08/02/18	新股网下申购	7.49	26.68	12,421	93,033.29	331,392.28
002201	九鼎新材	07/12/13	08/03/26	新股网下申购	10.19	31.87	10,176	103,693.44	324,309.12
002190	成飞集成	07/11/19	08/03/03	新股网下申购	9.90	21.16	14,098	139,570.20	298,313.68
002199	东晶电子	07/12/12	08/03/21	新股网下申购	8.80	25.50	9,645	84,876.00	245,947.50
002196	方正电机	07/12/04	08/03/12	新股网下申购	7.48	24.38	9,880	73,902.40	240,874.40
002188	新嘉联	07/11/12	08/02/22	新股网下申购	10.07	21.46	11,180	112,582.60	239,922.80
002195	海隆软件	07/12/04	08/03/12	新股网下申购	10.49	32.86	6,796	71,290.04	223,316.56
合 计								132,268,990.97	232,881,017.63

(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
600331	宏达股份	07/09/27	80.20	公告重大事项	未知	未知	2,500,000	69,492,505.67	200,500,000.00
600415	小商品城	07/12/11	86.59	公告重大事项	07/03/05	95.25	1,463,962	126,060,185.20	126,764,469.58
合 计								195,552,690.87	327,264,469.58

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 计								-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-
合 计								-

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：无

2006 年末：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。

本基金投资组合中股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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	8,517,479,888.08	59.09%	1,410,343,869.98	63.30%
－ 债券投资	3,122,590,944.40	21.66%	458,209,410.76	20.57%
衍生金融资产	—	—	42,600,000.00	1.91%
	<u>11,640,070,832.48</u>	<u>80.75%</u>	<u>1,911,153,280.74</u>	<u>85.78%</u>

于 2007 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准的上升 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 6.11 亿元(2006 年：1.14 亿元)；反之，若本基金业绩比较基准下降 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 6.11 亿元(2006 年：1.14 亿元)。

(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，并按照合同约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	163,236,866.83	-	-	-	163,236,866.83
结算备付金	2,556,336,034.38	-	-	-	2,556,336,034.38
存出保证金	101,282.05	-	-	1,078,656.05	1,179,938.10
交易性金融资产	2,712,662,724.80	371,635,811.00	38,292,408.60	8,517,479,888.08	11,640,070,832.48
应收证券清算款	-	-	-	41,428,500.20	41,428,500.20
应收利息	-	-	-	74,546,937.32	74,546,937.32
应收申购款	-	-	-	702,894.45	702,894.45
资产总计	5,432,336,908.06	371,635,811.00	38,292,408.60	8,635,236,876.10	14,477,502,003.76
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,423,089.18	8,423,089.18
应付赎回款	-	-	-	24,856,738.18	24,856,738.18
应付管理人报酬	-	-	-	18,033,870.28	18,033,870.28
应付托管费	-	-	-	3,005,645.03	3,005,645.03
应付交易费用	-	-	-	6,671,811.80	6,671,811.80
其他负债	-	-	-	1,193,774.46	1,193,774.46
负债总计	-	-	-	62,184,928.93	62,184,928.93
利率敏感度缺口	5,432,336,908.06	371,635,811.00	38,292,408.60	8,573,051,947.17	14,415,317,074.83

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	270,537,951.95	-	-	-	270,537,951.95
结算备付金	28,490,677.43	-	-	-	28,490,677.43
存出保证金	109,609.61	-	-	1,000,000.00	1,109,609.61
交易性金融资产	-	363,154,771.71	95,054,639.05	1,410,343,869.98	1,868,553,280.74
衍生金融资产	-	-	-	42,600,000.00	42,600,000.00
应收证券清算款	-	-	-	29,111,403.39	29,111,403.39
应收利息	-	-	-	3,885,652.48	3,885,652.48
应收申购款	-	-	-	1,763,001.57	1,763,001.57
资产总计	299,138,238.99	363,154,771.71	95,054,639.05	1,488,703,927.42	2,246,051,577.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	11,530,441.36	11,530,441.36

应付管理人报酬	-	-	-	2,697,519.27	2,697,519.27
应付托管费	-	-	-	449,586.52	449,586.52
应付交易费用	-	-	-	2,371,930.22	2,371,930.22
其他负债	-	-	-	971,583.78	971,583.78
负债总计	-	-	-	18,021,061.15	18,021,061.15
利率敏感度缺口	299,138,238.99	363,154,771.71	95,054,639.05	1,470,682,866.27	2,228,030,516.02

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 353 万元(2006 年：421 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 353 万元(2006 年：421 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，并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	2,366,196,286.38	1,535,877,970.95	2,228,030,516.02
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	369,897,107.05	-
按企业会计准则列报的金额	2,366,196,286.38	1,905,775,078.00	2,228,030,516.02
	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	2,228,030,516.02	1,078,314,719.27	2,717,568,299.26
以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产	-	179,541,798.55	-

按企业会计准则列报的金
额

2, 228, 030, 516. 02 1, 257, 856, 517. 82 2, 717, 568, 299. 26

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	8, 517, 479, 888. 08	58. 83%
2	债券	3, 122, 590, 944. 40	21. 57%
3	权证	0. 00	0. 00%
4	银行存款和结算备付金合计	2, 719, 572, 901. 21	18. 78%
5	其他资产	117, 858, 270. 07	0. 81%
	合计	14, 477, 502, 003. 76	100. 00%

(二)、按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	18, 940, 849. 20	0. 13%
B	采掘业	189, 476, 922. 70	1. 31%
C	制造业	1, 995, 470, 587. 71	13. 84%
C0	其中: 食品、饮料	187, 220, 988. 72	1. 30%
C1	纺织、服装、皮毛	59, 977, 000. 00	0. 42%
C3	造纸、印刷	4, 353, 018. 00	0. 03%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	870, 211, 120. 30	6. 04%
C5	电子	11, 961, 214. 63	0. 08%
C6	金属、非金属	117, 341, 985. 20	0. 81%
C7	机械、设备、仪表	458, 703, 169. 22	3. 18%
C8	医药、生物制品	285, 702, 091. 64	1. 98%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9, 043, 461. 44	0. 06%
E	建筑业	108, 071, 694. 36	0. 75%
F	交通运输、仓储业	329, 726, 900. 77	2. 29%
G	信息技术业	3, 570, 002. 99	0. 02%
H	批发和零售贸易业	479, 066, 002. 83	3. 32%
I	金融、保险业	1, 899, 147, 595. 63	13. 17%
J	房地产业	2, 274, 033, 987. 72	15. 78%
K	社会服务业	548, 430, 851. 47	3. 80%

L	传播与文化产业	4,445,718.76	0.03%
M	综合类	658,055,312.50	4.56%
	合计	8,517,479,888.08	59.09%

(三)、股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	市值(元)	占净值比例
1	000002	万 科 A	32,716,303	943,538,178.52	6.55%
2	600036	招商银行	12,537,559	496,863,463.17	3.45%
3	600048	保利地产	6,200,122	401,891,908.04	2.79%
4	000069	华侨城 A	7,200,054	361,802,713.50	2.51%
5	600290	华仪电气	7,660,277	312,539,301.60	2.17%
6	600016	民生银行	19,001,234	281,598,287.88	1.95%
7	600383	金地集团	6,700,479	262,279,543.20	1.82%
8	600858	银座股份	6,000,038	225,541,428.42	1.56%
9	600683	银泰股份	14,002,278	214,094,830.62	1.49%
10	601318	中国平安	1,996,350	211,812,735.00	1.47%
11	600052	*ST 广厦	14,331,674	208,382,539.96	1.45%
12	000024	招商地产	3,500,883	207,252,273.60	1.44%
13	600331	宏达股份	2,500,000	200,500,000.00	1.39%
14	601939	建设银行	20,000,000	197,000,000.00	1.37%
15	600830	大红鹰	8,700,000	196,185,000.00	1.36%
16	002183	怡 亚 通	2,380,376	185,550,309.20	1.29%
17	601398	工商银行	22,000,000	178,860,000.00	1.24%
18	600309	烟台万华	4,700,003	178,835,114.15	1.24%
19	000001	深发展 A	4,601,905	177,633,533.00	1.23%
20	600252	中恒集团	7,750,000	173,445,000.00	1.20%
21	600000	浦发银行	3,000,350	158,418,480.00	1.10%
22	600230	沧州大化	6,003,552	152,490,220.80	1.06%
23	002022	科华生物	3,801,590	134,956,445.00	0.94%
24	000537	广宇发展	9,800,327	132,304,414.50	0.92%
25	600415	小商品城	1,463,962	126,764,469.58	0.88%
26	601857	中国石油	3,865,650	119,680,524.00	0.83%
27	000960	锡业股份	1,750,000	115,605,000.00	0.80%
28	601919	中国远洋	2,600,000	110,916,000.00	0.77%
29	000422	湖北宜化	4,780,200	109,992,402.00	0.76%
30	600266	北京城建	3,729,182	108,071,694.36	0.75%
31	600240	华业地产	6,624,416	104,400,796.16	0.72%
32	601166	兴业银行	2,001,853	103,816,096.58	0.72%
33	600519	贵州茅台	450,000	103,500,000.00	0.72%
34	000869	张 裕 A	889,137	76,110,127.20	0.53%
35	600009	上海机场	1,990,446	74,681,533.92	0.52%



36	000423	东阿阿胶	2,000,000	65,120,000.00	0.45%
37	000667	名流置业	4,368,651	63,520,185.54	0.44%
38	000522	白云山 A	4,318,508	62,963,846.64	0.44%
39	600439	瑞贝卡	1,200,000	59,736,000.00	0.41%
40	000635	英力特	2,000,000	57,320,000.00	0.40%
41	002142	宁波银行	2,500,000	54,825,000.00	0.38%
42	000006	深振业 A	2,000,562	52,314,696.30	0.36%
43	601006	大秦铁路	2,000,000	51,240,000.00	0.36%
44	600315	上海家化	1,000,000	48,370,000.00	0.34%
45	600428	中远航运	1,195,003	46,545,366.85	0.32%
46	002152	广电运通	428,259	46,042,125.09	0.32%
47	600426	华鲁恒升	1,672,108	44,310,862.00	0.31%
48	600367	红星发展	2,507,046	40,764,567.96	0.28%
49	600015	华夏银行	2,000,000	38,320,000.00	0.27%
50	000677	山东海龙	1,626,803	37,627,953.39	0.26%
51	601088	中国神华	475,660	31,208,052.60	0.22%
52	600547	山东黄金	180,390	30,484,106.10	0.21%
53	002133	广宇集团	1,224,030	30,453,866.40	0.21%
54	000157	中联重科	520,000	29,874,000.00	0.21%
55	600875	东方电气	292,665	26,047,185.00	0.18%
56	000651	格力电器	518,300	25,578,105.00	0.18%
57	600825	新华传媒	500,000	25,555,000.00	0.18%
58	601866	中海集运	2,000,000	24,300,000.00	0.17%
59	600269	赣粤高速	1,200,000	22,044,000.00	0.15%
60	600251	冠农股份	440,895	18,940,849.20	0.13%
61	000650	ST 仁和	1,000,000	18,110,000.00	0.13%
62	000061	农产品	500,000	14,440,000.00	0.10%
63	002024	苏宁电器	200,000	14,370,000.00	0.10%
64	600478	力元新材	367,515	10,257,343.65	0.07%
65	000759	武汉中百	496,056	9,325,852.80	0.06%
66	002050	三花股份	299,800	9,038,970.00	0.06%
67	601808	中海油服	236,000	8,104,240.00	0.06%
68	000876	新希望	380,924	7,610,861.52	0.05%
69	601918	国投新集	445,632	7,094,461.44	0.05%
70	002202	金风科技	40,866	5,739,629.70	0.04%
71	600535	天士力	200,000	4,402,000.00	0.03%
72	002191	劲嘉股份	131,115	4,353,018.00	0.03%
73	601999	出版传媒	203,277	4,114,326.48	0.03%
74	000501	鄂武商 A	200,000	3,730,000.00	0.03%
75	002194	武汉凡谷	57,001	2,958,921.91	0.02%
76	600786	东方锅炉	25,025	2,113,361.25	0.01%
77	600900	长江电力	100,000	1,949,000.00	0.01%
78	002187	广百股份	31,759	1,365,319.41	0.01%

79	002186	全聚德	18,259	1,077,828.77	0.01%
80	002197	证通电子	33,365	1,064,343.50	0.01%
81	002182	云海金属	32,956	920,461.08	0.01%
82	002185	华天科技	33,697	722,463.68	0.01%
83	002189	利达光电	33,710	495,537.00	0.00%
84	002201	九鼎新材	14,676	467,724.12	0.00%
85	002190	成飞集成	20,098	425,273.68	0.00%
86	002184	海得控制	16,852	387,764.52	0.00%
87	600019	宝钢股份	20,000	348,800.00	0.00%
88	002181	粤传媒	12,421	331,392.28	0.00%
89	002199	东晶电子	9,645	245,947.50	0.00%
90	002193	山东如意	10,000	241,000.00	0.00%
91	002196	方正电机	9,880	240,874.40	0.00%
92	002188	新嘉联	11,180	239,922.80	0.00%
93	002195	海隆软件	6,796	223,316.56	0.00%
94	000513	丽珠集团	3,500	149,800.00	0.00%
合计				8,517,479,888.08	59.09%

(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%的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例
1	000002	万科A	1,117,373,241.94	50.15%
2	600036	招商银行	561,653,064.00	25.21%
3	600016	民生银行	434,810,025.78	19.52%
4	000069	华侨城A	417,123,395.62	18.72%
5	600048	保利地产	411,089,652.39	18.45%
6	601939	建设银行	327,168,444.51	14.68%
7	601398	工商银行	325,796,442.79	14.62%
8	600383	金地集团	314,388,800.88	14.11%
9	601318	中国平安	313,265,427.04	14.06%
10	600000	浦发银行	294,550,042.50	13.22%
11	000001	深发展A	262,037,743.31	11.76%
12	600030	中信证券	259,895,042.52	11.66%
13	000024	招商地产	215,240,415.85	9.66%
14	600683	银泰股份	201,585,439.60	9.05%
15	601166	兴业银行	181,621,115.70	8.15%
16	600052	*ST 广厦	166,171,620.61	7.46%
17	000537	广宇发展	165,637,261.69	7.43%
18	000878	云南铜业	150,168,190.68	6.74%
19	600252	中恒集团	149,845,693.89	6.73%
20	002183	怡亚通	142,235,138.97	6.38%



21	600830	大红鹰	140,727,160.98	6.32%
22	600240	华业地产	136,951,557.42	6.15%
23	601919	中国远洋	134,277,255.42	6.03%
24	600230	沧州大化	130,368,691.06	5.85%
25	600415	小商品城	126,060,185.20	5.66%
26	600266	北京城建	121,221,974.04	5.44%
27	002022	科华生物	119,942,999.23	5.38%
28	600309	烟台万华	110,558,076.84	4.96%
29	000960	锡业股份	104,332,106.29	4.68%
30	600086	东方金钰	102,597,300.05	4.60%
31	601390	中国中铁	98,982,573.68	4.44%
32	600331	宏达股份	83,453,855.83	3.75%
33	600519	贵州茅台	81,820,742.60	3.67%
34	600713	南京医药	80,661,431.32	3.62%
35	600009	上海机场	78,374,193.69	3.52%
36	000422	湖北宜化	77,774,877.01	3.49%
37	000667	名流置业	73,246,519.60	3.29%
38	600290	华仪电气	69,164,352.90	3.10%
39	000006	深振业 A	65,117,375.95	2.92%
40	601857	中国石油	64,556,355.00	2.90%
41	000869	张裕 A	64,242,726.71	2.88%
42	600325	华发股份	63,879,202.21	2.87%
43	600019	宝钢股份	63,598,190.60	2.85%
44	600538	北海国发	63,556,402.75	2.85%
45	600059	古越龙山	63,103,488.63	2.83%
46	600026	中海发展	61,936,231.33	2.78%
47	600005	武钢股份	61,537,297.75	2.76%
48	600600	青岛啤酒	58,604,310.80	2.63%
49	600367	红星发展	58,086,925.75	2.61%
50	000635	英力特	57,602,618.90	2.59%
51	000522	白云山 A	56,265,336.70	2.53%
52	600858	银座股份	55,284,717.32	2.48%
53	601006	大秦铁路	54,902,246.13	2.46%
54	000423	东阿阿胶	52,902,673.03	2.37%
55	001696	宗申动力	49,584,655.24	2.23%
56	600058	五矿发展	49,452,845.85	2.22%
57	600439	瑞贝卡	49,341,659.02	2.21%
58	601601	中国太保	47,250,000.00	2.12%
59	002142	宁波银行	47,054,992.68	2.11%
序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例
1	000061	农产品	333,053,336.99	14.95%
2	600030	中信证券	262,403,141.15	11.78%
3	000002	万科 A	241,999,805.67	10.86%

4	000878	云南铜业	205,162,512.19	9.21%
5	600036	招商银行	176,408,444.63	7.92%
6	600276	恒瑞医药	168,721,202.02	7.57%
7	601398	工商银行	152,239,954.94	6.83%
8	600383	金地集团	150,282,065.05	6.75%
9	600000	浦发银行	149,245,622.46	6.70%
10	000960	锡业股份	133,164,604.56	5.98%
11	600086	东方金钰	128,052,375.78	5.75%
12	600016	民生银行	127,846,503.68	5.74%
13	601390	中国中铁	126,117,029.22	5.66%
14	601939	建设银行	123,812,589.02	5.56%
15	600519	贵州茅台	122,715,231.29	5.51%
16	000001	深发展 A	118,502,677.02	5.32%
17	001696	宗申动力	114,171,835.06	5.12%
18	600059	古越龙山	112,238,876.80	5.04%
19	600315	上海家化	104,997,181.47	4.71%
20	600161	天坛生物	100,408,948.67	4.51%
21	600026	中海发展	99,525,574.17	4.47%
22	600058	五矿发展	97,896,354.80	4.39%
23	600713	南京医药	97,010,191.35	4.35%
24	600028	中国石化	88,743,811.01	3.98%
25	600052	*ST 广厦	78,868,229.02	3.54%
26	601601	中国太保	77,456,858.02	3.48%
27	600858	银座股份	70,057,128.45	3.14%
28	600019	宝钢股份	67,600,071.96	3.03%
29	600538	北海国发	65,127,018.93	2.92%
30	601318	中国平安	63,476,081.72	2.85%
31	600005	武钢股份	62,021,542.26	2.78%
32	601166	兴业银行	57,399,522.27	2.58%
33	600600	青岛啤酒	56,027,694.17	2.51%
34	600325	华发股份	55,904,994.22	2.51%
35	002036	宜科科技	54,928,197.22	2.47%
36	600428	中远航运	54,723,589.48	2.46%
37	600001	邯郸钢铁	46,179,227.90	2.07%
38	000888	峨眉山 A	45,625,707.83	2.05%
39	600240	华业地产	44,884,182.84	2.01%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额。

买入股票的成本总额：	10,918,816,207.20
卖出股票的收入总额：	5,894,120,836.26

*注：本基金于本年度获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价共计 2,210.20 元(2006 年：9,200,304.24)，已全额冲减股票投资成本。

(五)、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	373,834,944.40	2.59%
2	央行票据	2,363,383,000.00	16.39%
3	金融债券	385,373,000.00	2.67%
	合计	3,122,590,944.40	21.66%

(六)、基金投资前五名债券明细

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	0701002	07 央票 02	13,000,000	1,264,770,000.00	8.77%
2	0701004	07 央票 04	10,000,000	972,800,000.00	6.75%
3	010709	07 国债 09	2,000,000	199,140,000.00	1.38%
4	010702	07 国债 02	1,000,000	99,790,000.00	0.69%
5	060202	06 国开 02	800,000	77,744,000.00	0.54%

(七)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

本基金本报告期末无权证投资。

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

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

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	深圳结算保证金	1,078,656.05
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	41,428,500.20
5	应收利息	74,546,937.32
6	应收基金申购款	702,894.45
	合计	117,858,270.07

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
-	-	-	-	-	-

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	成本总额(元)	获得途径
1	580003	邯钢 JTB1	12,000,000.00	33,840,886.65	主动投资
2	031001	侨城 HQC1	2,501,728.00	118,775,260.33	主动投资
3	031003	深发 SFC1	100,000.00	0.00	股权分置改革被动持有
4	031004	深发 SFC2	50,000.00	0.00	股权分置改革被动持有

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	605,973	
平均每户持有基金份额	23,857.03	
机构投资者持有的基金份额	1,452,922,369.88	10.05%
个人投资者持有的基金份额	13,003,794,789.53	89.95%

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	0.00	0.00%

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	5,000,001,124.00
期初基金份额总额	1,108,064,557.40
加：本期申购基金份额总额	6,179,798,745.87

本期基金拆分增加份额	8,227,746,928.60
减：本期赎回基金份额总额	1,058,893,072.46
期末基金份额总额	14,456,717,159.41

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：

本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 本基金管理人于 2007 年 3 月 22 日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). 本基金管理人于 2007 年 5 月 11 日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). 本基金管理人于 2007 年 7 月 26 日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。

本基金托管人重大人事变动如下：

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

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

(三) 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：无。

(六) 基金改聘为其审计的会计师事务所情况：无。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2001 年 9 月 21 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：
无。

(八) 基金租用证券公司专用交易单元的有关情况：

1、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

退租交易单元：

券商名称	上交所交易单元数	深交所交易单元数
东方证券股份有限公司	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
东方证券股份有限公司	1	167,240,130.29	1.03%	130,866.30	1.00%
广发证券股份有限公司	1	4,541,238,909.58	27.90%	3,719,120.83	28.35%
国泰君安证券股份有限公司	2	379,185,385.50	2.33%	307,280.91	2.34%
海通证券股份有限公司	1	1,405,993,109.72	8.64%	1,100,195.86	8.39%
平安证券有限责任公司	1	1,060,667,895.85	6.52%	829,979.61	6.33%
申银万国证券股份有限公司	2	2,462,700,003.40	15.13%	2,012,986.64	15.34%
联合证券有限责任公司	1	1,774,716,068.04	10.91%	1,388,727.83	10.59%
中国银河证券股份有限公司	1	2,110,914,831.80	12.97%	1,725,872.51	13.16%
中国国际金融有限公司	1	1,279,951,164.39	7.86%	1,047,638.27	7.99%
招商证券股份有限公司	1	47,887,536.20	0.29%	39,267.70	0.30%
国信证券有限责任公司	1	1,043,571,460.16	6.41%	816,596.98	6.22%
合 计	13	16,274,066,494.93	100.00%	13,118,533.44	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
东方证券股份有限公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
广发证券股份有限公司	193,222,698.70	33.99%	671,500,000.00	33.59%	-	0.00%
国泰君安证券股份有限公司	120,973,738.90	21.28%	101,700,000.00	5.09%	-	0.00%
海通证券股份有限公司	-	0.00%	-	0.00%	43,469,251.15	18.71%
平安证券有限责任公司	11,066,118.55	1.95%	-	0.00%	2,601,727.34	1.12%
申银万国证券股份有限公司	21,276,500.00	3.74%	135,700,000.00	6.79%	27,573,298.16	11.87%
联合证券有限责任公司	-	0.00%	-	0.00%	115,858,919.65	49.87%
中国银河证券股份有限公司	177,926,244.00	31.29%	756,000,000.00	37.82%	-	0.00%
中国国际金融有限公司	44,080,523.50	7.75%	334,000,000.00	16.71%	39,901,120.88	17.18%
招商证券股份有限公司	-	0.00%	-	0.00%	-	0.00%
国信证券有限责任公司	-	0.00%	-	0.00%	2,915,000.00	1.25%
合 计	568,545,823.65	100.00%	1,998,900,000.00	100.00%	232,319,317.18	100.00%

3、券商专用交易单元选择标准：

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

(1) 资历雄厚，信誉良好；

(2) 财务状况良好，经营行为规范；

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

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

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

4、券商专用交易单元选择程序：

(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交易单元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和合规性进行阐述。

(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《证券交易交易单元使用协议》，并通知基金托管人。

(九) 其他重要事项：

1、股权变动：

- | | 公告事项 | 披露日期 |
|----|---|--------------|
| 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 | [2007-11-20] |



- 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。
- 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]

2、基金代销渠道：

	公告事项	披露日期
1)	关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	[2007-01-12]
2)	关于在中国工商银行股份有限公司开通华安宏利股票型证券投资基金、华安创新证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金定期定额投资计划的公告	[2007-01-14]
3)	关于增加旗下三只基金参加中国工商银行基金定投优惠活动的公告	[2007-01-14]
4)	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	[2007-01-15]
5)	关于参加中国光大银行基金定投优惠推广活动的公告	[2007-01-18]
6)	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]
7)	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	[2007-01-25]
8)	关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	[2007-01-26]
9)	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	[2007-01-28]
10)	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	[2007-01-31]
11)	关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	[2007-02-05]
12)	关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	[2007-02-19]
13)	关于在建设银行开通旗下基金转换业务的公告	[2007-02-25]
14)	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]
15)	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]
16)	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]
17)	关于旗下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、华安中小盘成长股票型证券投资基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率活动的公告	[2007-06-19]



- 18) 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]
- 19) 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]
- 20) 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]
- 21) 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]
- 22) 关于新增招商银行股份有限公司代销华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金、华安宝利配置证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金的公告 [2007-08-24]
- 23) 关于增加中国光大银行为开放式基金代销机构的公告 [2007-08-28]
- 24) 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]
- 25) 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]
- 26) 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]
- 27) 关于新增上海银行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代销机构的公告 [2007-10-16]
- 28) 关于增加中国邮政储蓄银行代销华安创新证券投资基金的公告 [2007-10-17]
- 29) 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]
- 30) 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]
- 31) 关于新增联合证券有限责任公司为华安创新证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-20]
- 32) 关于新增中原证券股份有限公司为华安创新证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-23]
- 33) 关于新增国都证券有限责任公司为华安创新证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-24]
- 34) 关于新增宏源证券股份有限公司为华安创新证券投资基金代销机构的公告 [2007-10-24]
- 35) 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]
- 36) 关于终止华安创新证券投资基金持续销售活动并暂停基金申购业务的公告 [2007-10-29]
- 37) 关于华安创新证券投资基金基金份额拆分比例和恢复基金转换转出业务的公告 [2007-10-30]

- 38) 关于华安创新证券投资基金实施规模控制的申购确认比例公告 [2007-10-30]
- 39) 关于华安创新证券投资基金部分开通基金定期定额投资业务的公告 [2007-11-02]
- 40) 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]
- 41) 关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 [2007-11-20]
- 42) 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]
- 43) 关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 [2007-12-04]
- 44) 关于增加上海银行办理旗下暂停申购基金定期定额投资业务的公告 [2007-12-05]
- 45) 关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 [2007-12-18]
- 46) 关于增加中国邮政储蓄银行办理旗下暂停申购基金定期定额投资业务的公告 [2007-12-20]
- 47) 关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 [2007-12-29]
- 48) 华安基金管理有限公司关于新增华泰证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告 [2008-03-24]
- 49) 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]
- 50) 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]
- 51) 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]
- 52) 华安基金管理有限公司关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 [2008-03-18]
- 53) 华安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加上海银行基金定期定额申购业务优惠推广活动的公告 [2008-03-12]
- 54) 华安基金管理有限公司关于华安创新证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告 [2008-03-04]

3、基金合同修改：

- | | 公告事项 | 披露日期 |
|----|--|--------------|
| 1) | <p>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：</p> <p>净申购金额 = 申购金额 / (1 + 申购费率)</p> <p>申购费用 = 申购金额 - 净申购金额</p> <p>申购份额 = 净申购金额 / T 日基金份额净值”</p> | [2007-05-11] |
| 2) | <p>关于调整旗下基金申购费用及申购份额计算方法的公告，</p> <p>自 2007 年 5 月 15 日起，本基金的申购费用及申购份额统</p> | [2007-05-11] |

- 一调整为“外扣法”计算。
- 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 [2007-05-29]
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。
 - 4) 华安基金管理有限公司关于证券投资基金实施新的会计准 [2007-07-02]
则的公告，根据中国证监会的相关规定，我公司管理的所
有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会
计准则后，基金将全面采用公允价值进行会计计量，请投
资者关注相关法规的规定。实施新会计准则后，基金估值
方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实
质性影响。
 - 5) 关于修改华安创新证券投资基金的基金合同和托管协议的 [2007-09-29]
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，经与华安创新证券投资基金的托
管人交通银行股份有限公司协商一致，并经向中国证监会备
案，根据相关法律法规的规定及基金合同的约定，对华安
创新基金的基金合同中的基金资产的估值方法条款和估值
对象以及特殊情形处理条款进行修改。
 - 6) 关于华安创新证券投资基金开展基金份额拆分和限量持续 [2007-10-22]
销售活动及修改基金合同的公告，经与本基金托管人交
通银行股份有限公司协商，本公司决定修改《华安创新证
券投资基金基金合同》中关于基金面值的条款，将基金合
第二部分“华安创新证券投资基金基本情况”中第一条“基
金的基本情况”第（三）款“基金份额每份面值”的条款“基
金份额每份面值为人民币 1 元”，修改为“基金份额每份初
始面值为人民币 1.00 元”。

4、其他事项：

- | | 公告事项 | 披露日期 |
|----|---|--------------|
| 1) | 关于华安创新持有银座集团股份有限公司比例变动的公告，华安创新证券投资基金原持有银座集团股份有限公司发行的流通股 610 万股，持股比例为 5.02%。2007 年 3 月 16 日华安创新通过二级市场卖出流通股 50 万股，减持比例为 0.412%。该日收市后华安创新持有银座股份流通股 560 | [2007-03-21] |



- 万股，持股比例为银座股份总股本的 4.61%。
- 2) 关于总机变更的公告，华安基金管理有限公司的电话总机 [2007-05-25]
自 2007 年 5 月 28 日起由 (021) 58881111 变更为 (021)
38969999。
- 3) 关于旗下基金投资金地集团 (600383) 非公开发行股票的 [2007-07-11]
公告
- 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》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

十二、备查文件目录

- 1、中国证监会批准华安创新证券投资基金设立的文件；
- 2、《华安创新证券投资基金基金合同》；
- 3、《华安创新证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华安创新证券投资基金托管协议》；
- 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