

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	审计报告	14
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	20
§ 8	投资组合报告	38
8.1	期末基金资产组合情况	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	38
8.2.1	指数投资期末按行业分类的股票投资组合	38
8.2.2	积极投资期末按行业分类的股票投资组合	39
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	40
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	61
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	61
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	61
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	61
8.9	投资组合报告附注	61

§ 9	基金份额持有人信息.....	62
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	63
§ 10	开放式基金份额变动.....	63
§ 11	重大事件揭示.....	63
11.1	基金份额持有人大会决议.....	63
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	63
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4	基金投资策略的改变.....	64
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
11.8	其他重大事件.....	66
§ 12	备查文件目录.....	73
12.1	备查文件目录.....	73
12.2	存放地点.....	73
12.3	查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中国 A 股增强指数	
基金主代码	040002	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002 年 11 月 8 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	7, 111, 925, 703. 93 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法, 通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离, 力求基金收益率适度超越本基金比较基准, 并在谋求基金资产长期增值的基础上, 择机实现一定的收益和分配。
投资策略	<p>(1) 资产配置: 本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下, 可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况, 适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资: 本基金以 MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重等指标为基础, 通过复制和有限度的增强管理方法, 构造指数化投资组合。在投资组合建立后, 基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度, 适时对投资组合进行调整, 使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外, 本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资: 本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具, 减少基金资产的风险并提高基金的收益。</p>

业绩比较基准	95% × MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5% × 金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东南路360号新上海国际大厦2楼、37楼、38楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李勍	姜建清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市浦东南路360号新上海国际大厦2楼、37楼、38楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	125,683,843.94	300,087,822.90	-1,432,998,451.59
本期利润	-152,255,361.64	2,845,747,620.13	-4,884,700,075.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0227	0.4465	-2.2131
本期加权平均净值利润率	-2.70%	55.76%	-99.32%
本期基金份额净值增长率	-6.65%	85.11%	-62.45%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	1,715,754,495.03	1,459,656,701.54	1,358,410,827.02
期末可供分配基金份额利润	0.2413	0.2436	0.1935
期末基金资产净值	6,214,275,443.17	5,733,841,768.20	3,627,316,273.50
期末基金份额净值	0.874	0.957	0.517
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	261.89%	287.69%	109.44%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去 3 个月	6.20%	1.65%	6.28%	1.65%	-0.08%	0.00%

过去 6 个月	24.86%	1.47%	24.04%	1.46%	0.82%	0.01%
过去 1 年	-6.65%	1.49%	-8.18%	1.49%	1.53%	0.00%
过去 3 年	-35.13%	2.14%	-35.13%	2.18%	0.00%	-0.04%
过去 5 年	264.61%	2.01%	245.32%	2.05%	19.29%	-0.04%
自基金成立起至今	261.89%	1.69%	191.99%	1.72%	69.90%	-0.03%

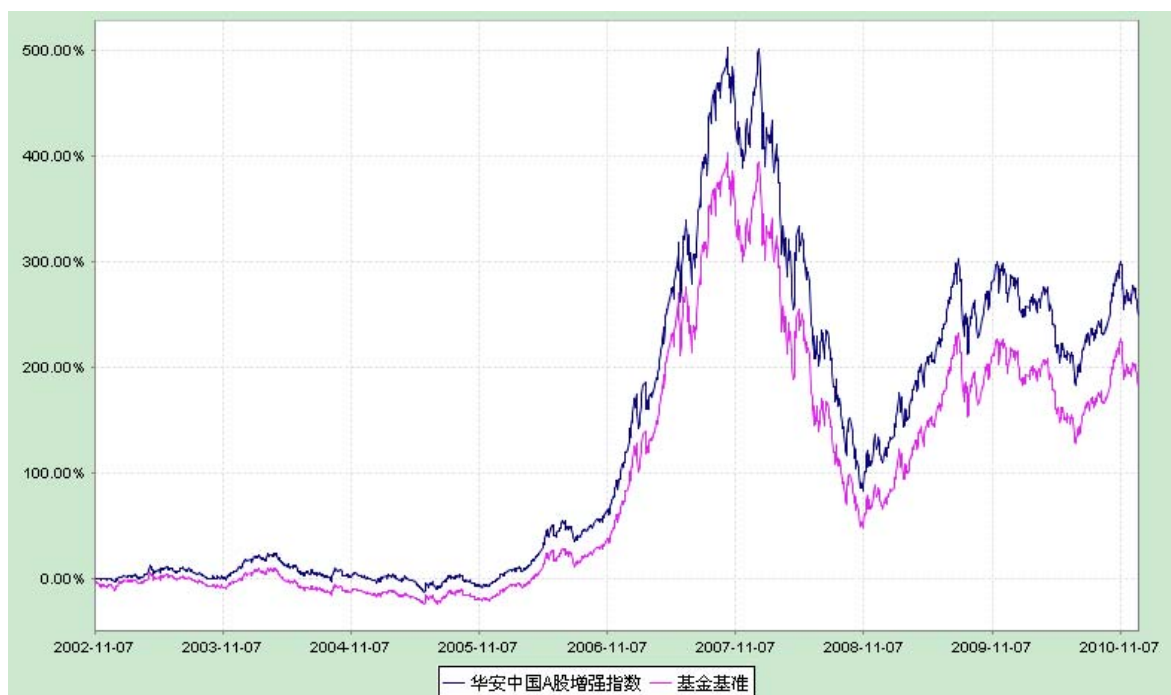
注：业绩比较基准收益率=95%×MSCI 中国 A 股指数+5%×金融同业存款利率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

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

截至 2010 年 12 月 31 日,本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 94.38%，其中权证投资比例为 0。投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金净资产为 5.43%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

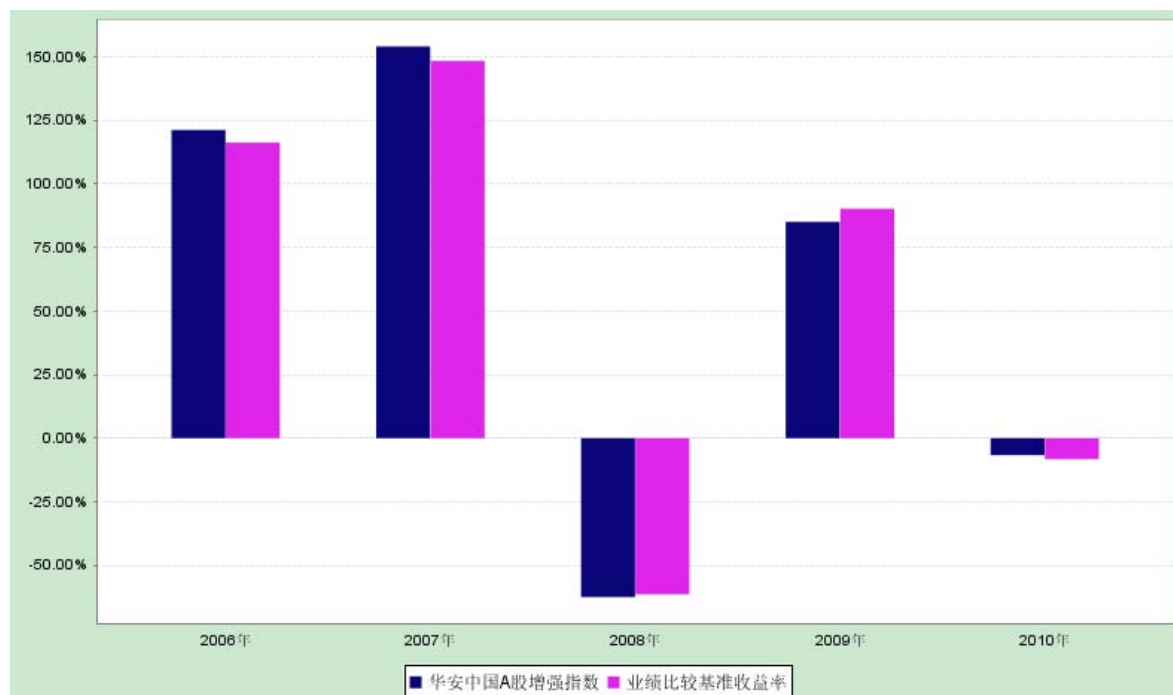
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2002 年 11 月 8 日至 2010 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 过去五年净值增长率图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	-
2009年	-	-	-	-	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2010 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、华安宏利股票、华

安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安稳固收益债券等 19 只开放式基金，管理资产规模达到 825.65 亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理，金融工程部总经理	2008-04-25	-	7 年	理学博士，7 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月起担任本基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及华安上证 180ETF 联接基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
刘瓔	本基金的基金经理	2008-04-25	2010-06-25	9 年	管理学硕士，9 年证券从业经历。曾在交通银行工作，2001 年加入华安基金管理有限公司，历任市场部高级投资顾问、专户理财部客户主管、上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。2007 年 3 月至 2010 年 6 月担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 6 月同时担任本基金的

					基金经理。
牛勇	本基金的基金经理	2010-09-02	-	6 年	复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），6 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任本基金的基金经理助理，2010 年 6 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金合同》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金

(账户)参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范,执行情况良好,未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年在国内经济结构转型方向确立的背景,以及地产调控政策下,A 股年度结构行情十分突出,新兴产业、医药、消费等行业表现突出,周期类行业表现受到地产调控与货币收紧政策压制,不同风格板块之间相对估值达到了历史的高点。本基金在控制跟踪误差前提下,全年整体低配地产、钢铁、银行等周期类行业,超配医药、消费、新能源等行业,基金收益相对比较基准获得一定超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内华安中国 A 股增强指数基金份额净值增长率为-6.65%,同期业绩比较基准增长率为-8.18%,基金净值表现领先比较基准 1.53%,截至 2010 年 12 月 31 日,本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.09% (按照基金合同和招募说明书规定)。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观与基本面来看 2011 年相对复杂,CPI 全年呈高位回落态势,但国际上局部政局不稳定推升国际油价,企业成本的上升为经济增速的回升增加不确定性。在政策与通胀的博弈中,外部需求是否回暖以转嫁国内生产成本的不确定性下,市场呈现宽幅震荡的概率较大。但从市场整体估值来看,目前沪深 300 指数 2011 年的市盈率约为 12 倍,全部 A 股的市盈率也仅为 14.57 倍,在货币政策不断紧缩背景下的下跌疲态,也证明了 A 股市场已经对通胀所带来的增长减速有了一定的预期。由此,我们对 A 股市场中期走势并不悲观。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人,我们继续坚持被动投资的原则,在充分拟合指数的前提下,通过适度增强策略,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,公司合规监察工作从保障基金合规运作、维护基金份额持有人利益出发,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,在强化员工的合规意识的同时,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) 继续深化“主动合规”的管理理念，落实《合规手册》，规范公司在业务运作、道德规范、反洗钱、利益冲突、客户信息保密、市场营销和客户投诉处理、投资和交易行为等环节的行为；

(2) 由公司督察长牵头与基金经理、投资经理一对一进行合规谈话，要求基金经理和投资经理在投资运作中严格遵守法律法规、基金合同、公司规章制度的各项规定，严格把握职业操守，坚决不碰“老鼠仓、内幕交易、利益输送”三条底线，并进行了合规考试；

(3) 通过合规培训以强化员工的合规意识和风险控制意识。本报告期内公司组织的合规培训包括：公司及基金行业违规及操作失误案例的合规培训；投资流程标准化操作培训；防止内幕交易、违规买卖股票和利用未公开信息交易的培训；基金销售合规培训等等；

(4) 按照中国证监会要求，组织投资研究部门对投资、研究、风险管理、投资人员管理等方面进行了一次全面性的自查，自查情况良好，基本达到了中国证监会的监管要求；

(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同时，强化了在基金新产品开发过程中的合规支持；

(6) 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。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面：

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

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

值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

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

李炳旺先生, 研究生学历, 24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理, 现任华安基金管理有限公司副总裁。

尚志民, 基金投资部总经理, 工商管理硕士, 曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作, 进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员, 华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理, 现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理, 基金投资部总经理。

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

黄勤, 固定收益部总经理, 经济学硕士, 13 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司, 曾任固定收益部债券投资经理, 现任华安现金富利货币、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

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

朱永红, 经济学学士, ACCA 英国特许公认会计师公会会员, CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理有限公司, 2010 年 11 月 19 日离职前任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

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

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息
无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 13 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 19 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.10 元。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010 年，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2010 年，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 118,966,417.38 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2010 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20329 号

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010

年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华安 MSCI 中国 A 股指数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和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华安 MSCI 中国 A 股指数基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 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

汪 棣

中国·上海市

注册会计师

金 毅

2011 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表
7.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	106,386,761.00	215,981,984.63
结算备付金		2,782,743.87	6,464,790.97
存出保证金		669,186.06	1,274,503.49
交易性金融资产	7.4.7.2	6,065,914,845.00	5,521,556,952.13
其中：股票投资		5,865,350,845.00	5,423,216,952.13
基金投资		-	-
债券投资		200,564,000.00	98,340,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		30,514,539.51	12,125,887.19
应收利息	7.4.7.5	6,990,732.86	774,213.86
应收股利		-	-
应收申购款		21,935,337.48	13,195,975.22
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,235,194,145.78	5,771,374,307.49
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		10,795,610.44	27,872,037.31
应付管理人报酬		5,359,357.62	4,788,139.85
应付托管费		1,071,871.51	957,627.97
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,777,706.81	3,159,033.26
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	914,156.23	755,700.90
负债合计		20,918,702.61	37,532,539.29
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,167,017,577.63	1,825,771,366.07
未分配利润	7.4.7.10	4,047,257,865.54	3,908,070,402.13
所有者权益合计		6,214,275,443.17	5,733,841,768.20
负债和所有者权益总计		6,235,194,145.78	5,771,374,307.49

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.874 元，基金份额总额 7,111,925,703.93 份。

7.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年 12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
一、收入		-73,192,187.51	2,931,940,106.62
1. 利息收入		5,546,022.69	4,645,782.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,764,462.38	2,006,029.45
债券利息收入		3,781,560.31	2,628,749.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	11,004.00

收入			
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		199,184,131.72	381,634,526.41
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 12	149,049,701.07	339,390,099.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7. 4. 7. 13	1,418,865.97	71,051.09
资产支持证券投资 收益		-	-
衍生工具收益	7. 4. 7. 14	-	2,026,910.05
股利收益	7. 4. 7. 15	48,715,564.68	40,146,465.44
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 16	-277,939,205.58	2,545,659,797.23
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 17	16,863.66	-
减：二、费用		79,063,174.13	86,192,486.49
1. 管理人报酬		56,343,932.33	50,642,274.74
2. 托管费		11,268,786.46	10,128,454.96
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7. 4. 7. 18	11,016,464.64	24,929,091.82
5. 利息支出		-	60,241.42
其中：卖出回购金融资产 支出		-	60,241.42
6. 其他费用	7. 4. 7. 19	433,990.70	432,423.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-152,255,361.64	2,845,747,620.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-152,255,361.64	2,845,747,620.13

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,825,771,366.07	3,908,070,402.13	5,733,841,768.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-152,255,361.64	-152,255,361.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	341,246,211.56	410,409,242.43	751,655,453.99
其中：1. 基金申购款	1,990,162,726.26	3,486,980,035.96	5,477,142,762.22
2. 基金赎回款	-1,648,916,514.70	-3,076,570,793.53	-4,725,487,308.23
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-118,966,417.38	-118,966,417.38
五、期末所有者权益（基金净值）	2,167,017,577.63	4,047,257,865.54	6,214,275,443.17
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,139,499,094.43	1,487,817,179.07	3,627,316,273.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,845,747,620.13	2,845,747,620.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-313,727,728.36	-425,494,397.07	-739,222,125.43
其中：1. 基金申购款	3,099,569,137.02	4,975,508,270.79	8,075,077,407.81
2. 基金赎回款	-3,413,296,865.38	-5,401,002,667.86	-8,814,299,533.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,825,771,366.07	3,908,070,402.13	5,733,841,768.20

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：李炳旺，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

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

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

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2011 年 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 MSCI 中国 A 股

指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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、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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所

有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。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。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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中列示。

7.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动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。

7.4.4.8 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损益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)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 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。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

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。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	106,386,761.00	215,981,984.63
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	106,386,761.00	215,981,984.63

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,476,546,241.57	5,865,350,845.00	388,804,603.43

债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	202,412,240.00	200,564,000.00	-1,848,240.00
	合计	202,412,240.00	200,564,000.00	-1,848,240.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,678,958,481.57	6,065,914,845.00	386,956,363.43
项目		上年度末		
		2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,758,404,983.12	5,423,216,952.13	664,811,969.01
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	98,256,400.00	98,340,000.00	83,600.00
	合计	98,256,400.00	98,340,000.00	83,600.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,856,661,383.12	5,521,556,952.13	664,895,569.01

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	24,592.48	42,520.12
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	973.90	2,262.60

应收债券利息	6,961,183.57	713,753.42
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	3,982.91	15,677.72
其他	-	-
合计	6,990,732.86	774,213.86

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,774,825.62	3,155,652.07
银行间市场应付交易费用	2,881.19	3,381.19
合计	2,777,706.81	3,159,033.26

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	156.23	200.90
预提费用	414,000.00	255,500.00
合计	914,156.23	755,700.90

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,991,712,872.20	1,825,771,366.07
本期申购	6,531,546,469.54	1,990,162,726.26
本期赎回（以“-”号填列）	-5,411,333,637.81	-1,648,916,514.70
本期末	7,111,925,703.93	2,167,017,577.63

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,459,656,701.54	2,448,413,700.59	3,908,070,402.13
本期利润	125,683,843.94	-277,939,205.58	-152,255,361.64
本期基金份额交易产生的变动数	249,380,366.93	161,028,875.50	410,409,242.43
其中：基金申购款	1,495,353,291.14	1,991,626,744.82	3,486,980,035.96
基金赎回款	-1,245,972,924.21	-1,830,597,869.32	-3,076,570,793.53
本期已分配利润	-118,966,417.38	-	-118,966,417.38
本期末	1,715,754,495.03	2,331,503,370.51	4,047,257,865.54

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	1,445,898.14	1,698,068.41
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	46,067.20	82,464.65
其他	272,497.04	225,496.39
合计	1,764,462.38	2,006,029.45

7.4.7.12 股票投资收益-买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	3,439,705,891.74	8,440,294,915.43
减：卖出股票成本总额	3,290,656,190.67	8,100,904,815.60
买卖股票差价收入	149,049,701.07	339,390,099.83

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日

卖出债券及债券到期兑付成交总额	372,711,280.34	552,113,005.21
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	365,704,700.00	541,611,918.01
减：应收利息总额	5,587,714.37	10,430,036.11
债券投资收益	1,418,865.97	71,051.09

7.4.7.14 衍生工具收益—买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
卖出权证成交总额	-	2,797,842.04
减：卖出权证成本总额	-	770,931.99
买卖权证差价收入	-	2,026,910.05

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	48,715,564.68	40,146,465.44
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	48,715,564.68	40,146,465.44

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	-277,939,205.58	2,546,872,969.58
——股票投资	-276,007,365.58	2,547,686,169.58
——债券投资	-1,931,840.00	-813,200.00
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-1,213,172.35
——权证投资	-	-1,213,172.35

3. 其他	-	-
合计	-277,939,205.58	2,545,659,797.23

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	-	-
印花税手续费返还收入	16,863.66	-
合计	16,863.66	-

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	11,014,164.64	24,924,466.82
银行间市场交易费用	2,300.00	4,625.00
合计	11,016,464.64	24,929,091.82

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	114,000.00	111,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	1,990.70	3,423.55
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	433,990.70	432,423.55

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 13 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 19 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金

份额派发红利 0.10 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	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
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	56,343,932.33	50,642,274.74
其中：支付销售机构的客户 维护费	2,177,726.62	1,790,307.45

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.0% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,268,786.46	10,128,454.96

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.2% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	106,386,761.00	1,445,898.14	215,981,984.63	1,698,068.41

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2010-01-14	2010-01-14	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	-
合计	-	-	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	-

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，审计报告日前宣告的利润分配情况，请参见附注资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002537	海立美达	2010-12-31	2011-01-10	新股网上认购	40.00	40.00	500	20,000.00	20,000.00	-
300158	振东制药	2010-12-29	2011-01-07	新股网上认购	38.80	38.80	500	19,400.00	19,400.00	-
002536	西泵股份	2010-12-31	2011-01-11	新股网上认购	36.00	36.00	500	18,000.00	18,000.00	-
002535	林州重机	2010-12-31	2011-01-11	新股网上认购	25.00	25.00	500	12,500.00	12,500.00	-
600963	岳阳纸业	2010-12-20	2011-01-06	老股东配售	7.70	10.09	1,273	9,802.10	12,844.57	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或者战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600664	哈药股份	2010-12-29	资产重组	22.57	2011-02-16	24.83	723,894	13,036,404.02	16,338,287.58	-
600816	安信信托	2010-06-02	公告重大事项	13.60	未知	未知	200,000	3,460,000.00	2,720,000.00	-
000917	电广传媒	2010-12-27	资产重组	24.40	未知	未知	572,828	8,959,591.25	13,977,003.20	-
000959	首钢股份	2010-10-29	资产重组	4.42	未知	未知	1,212,508	6,323,927.62	5,359,285.36	-

600518	康美药业	2010-12-28	配股 停牌	19.71	2011-01-06	17.29	1,282,890	17,921,519.94	25,285,761.90	-
000652	泰达股份	2010-11-20	公告 重大事项	7.78	未知	未知	1,236,754	8,854,907.47	9,621,946.12	-
000059	辽通化工	2010-12-02	公告 重大事项	11.59	未知	未知	67,864	682,746.84	786,543.76	-
600315	上海家化	2010-12-04	资产 重组	37.13	未知	未知	318,402	6,691,769.28	11,822,266.26	-

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2010 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资

目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

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

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

7.4.13.3 流动性风险

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

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

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

本基金所持有的全部金融负债的合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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余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。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	106,386,761.00	-	-	-	106,386,761.00
结算备付金	2,782,743.87	-	-	-	2,782,743.87
存出保证金	-	-	-	669,186.06	669,186.06
交易性金融资产	200,564,000.00	-	-	5,865,350,845.00	6,065,914,845.00
应收证券清算款	-	-	-	30,514,539.51	30,514,539.51
应收利息	-	-	-	6,990,732.86	6,990,732.86
应收申购款	4,674,414.36	-	-	17,260,923.12	21,935,337.48
资产总计	314,407,919.23	-	-	5,920,786,226.55	6,235,194,145.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,795,610.44	10,795,610.44
应付管理人报酬	-	-	-	5,359,357.62	5,359,357.62
应付托管费	-	-	-	1,071,871.51	1,071,871.51
应付交易费用	-	-	-	2,777,706.81	2,777,706.81
其他负债	-	-	-	914,156.23	914,156.23
负债总计	-	-	-	20,918,702.61	20,918,702.61
利率敏感度缺口	314,407,919.23	-	-	5,899,867,523.94	6,214,275,443.17
上年度末2009年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	215,981,984.63	-	-	-	215,981,984.63
结算备付金	6,464,790.97	-	-	-	6,464,790.97
存出保证金	-	-	-	1,274,503.49	1,274,503.49
交易性金融资产	98,340,000.00	-	-	5,423,216,952.13	5,521,556,952.13
应收证券清算款	-	-	-	12,125,887.19	12,125,887.19
应收利息	-	-	-	774,213.86	774,213.86
应收申购款	2,718,661.91	-	-	10,477,313.31	13,195,975.22
资产总计	323,505,437.51	-	-	5,447,868,869.98	5,771,374,307.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	27,872,037.31	27,872,037.31
应付管理人报酬	-	-	-	4,788,139.85	4,788,139.85
应付托管费	-	-	-	957,627.97	957,627.97
应付交易费用	-	-	-	3,159,033.26	3,159,033.26
其他负债	-	-	-	755,700.90	755,700.90
负债总计	-	-	-	37,532,539.29	37,532,539.29
利率敏感度缺口	323,505,437.51	-	-	5,410,336,330.69	5,733,841,768.20

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 3.23%(2009 年 12 月 31 日：1.72%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。同时，本基金根据股票市场的具体情况，对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整以达到相对 MSCI 中国 A 股指数有限的偏离。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,865,350,845.00	94.39	5,423,216,952.13	94.58
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,865,350,845.00	94.39	5,423,216,952.13	94.58

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其它市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币亿元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 3.09	增加约 2.79
	2. 业绩比较基准下降 5%	减少约 3.09	减少约 2.79

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 5,779,439,750.82 元，属于第二层级的余额为 286,475,094.18 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 5,336,614,936.78 元，第二层级 184,942,015.35 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,865,350,845.00	94.07
	其中：股票	5,865,350,845.00	94.07
2	固定收益投资	200,564,000.00	3.22
	其中：债券	200,564,000.00	3.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	109,169,504.87	1.75
6	其他各项资产	60,109,795.91	0.96
7	合计	6,235,194,145.78	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	48,459,484.83	0.78

B	采掘业	611,321,388.60	9.84
C	制造业	2,651,681,672.57	42.67
C0	食品、饮料	402,032,932.83	6.47
C1	纺织、服装、皮毛	42,461,544.74	0.68
C2	木材、家具	1,998,594.80	0.03
C3	造纸、印刷	16,583,071.51	0.27
C4	石油、化学、塑胶、塑料	205,311,261.11	3.30
C5	电子	91,633,201.79	1.47
C6	金属、非金属	511,883,806.46	8.24
C7	机械、设备、仪表	929,157,163.48	14.95
C8	医药、生物制品	415,046,988.52	6.68
C99	其他制造业	35,573,107.33	0.57
D	电力、煤气及水的生产和供应业	136,704,252.65	2.20
E	建筑业	142,185,563.92	2.29
F	交通运输、仓储业	236,696,563.96	3.81
G	信息技术业	273,591,825.31	4.40
H	批发和零售贸易	264,332,097.69	4.25
I	金融、保险业	1,030,682,159.43	16.59
J	房地产业	244,843,991.70	3.94
K	社会服务业	52,031,428.54	0.84
L	传播与文化产业	32,595,448.86	0.52
M	综合类	140,155,066.94	2.26
	合计	5,865,280,945.00	94.38

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	69,900.00	0.00
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	50,500.00	0.00
C8	医药、生物制品	19,400.00	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	69,900.00	0.00

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,132,607	175,927,209.12	2.83
2	600036	招商银行	10,295,249	131,882,139.69	2.12
3	600519	贵州茅台	462,688	85,097,576.96	1.37
4	600000	浦发银行	6,778,241	83,982,405.99	1.35
5	600016	民生银行	15,571,818	78,170,526.36	1.26
6	600030	中信证券	6,186,554	77,888,714.86	1.25
7	601601	中国太保	3,304,434	75,671,538.60	1.22

8	000002	万 科 A	8,968,280	73,719,261.60	1.19
9	601166	兴业银行	2,744,104	65,995,701.20	1.06
10	002024	苏宁电器	4,864,812	63,729,037.20	1.03
11	000858	五 粮 液	1,713,035	59,322,402.05	0.95
12	601328	交通银行	10,689,702	58,579,566.96	0.94
13	600276	恒瑞医药	831,725	49,537,541.00	0.80
14	600031	三一重工	2,250,639	48,681,321.57	0.78
15	600104	上海汽车	3,274,412	48,068,368.16	0.77
16	000983	西山煤电	1,799,288	48,022,996.72	0.77
17	000423	东阿阿胶	913,595	46,684,704.50	0.75
18	601939	建设银行	9,865,290	45,281,681.10	0.73
19	600050	中国联通	8,141,712	43,558,159.20	0.70
20	600111	包钢稀土	604,306	43,171,620.64	0.69
21	600123	兰花科创	880,782	41,467,216.56	0.67
22	002202	金风科技	1,794,303	40,012,956.90	0.64
23	600362	江西铜业	870,696	39,329,338.32	0.63
24	000063	中兴通讯	1,409,813	38,487,894.90	0.62
25	000157	中联重科	2,700,148	38,180,092.72	0.61
26	601169	北京银行	3,331,608	38,113,595.52	0.61
27	600900	长江电力	4,768,856	36,100,239.92	0.58
28	600348	国阳新能	1,253,304	35,944,758.72	0.58
29	601088	中国神华	1,449,838	35,825,496.98	0.58
30	000630	铜陵有色	1,017,777	35,673,083.85	0.57
31	600547	山东黄金	660,793	34,830,399.03	0.56
32	600837	海通证券	3,593,815	34,644,376.60	0.56
33	601111	中国国航	2,529,678	34,605,995.04	0.56
34	601857	中国石油	3,035,775	34,061,395.50	0.55
35	000568	泸州老窖	819,966	33,536,609.40	0.54
36	000338	潍柴动力	633,704	33,187,078.48	0.53
37	000528	柳 工	884,036	32,709,332.00	0.53
38	600887	伊利股份	849,972	32,519,928.72	0.52

39	600196	复星医药	2,167,342	29,194,096.74	0.47
40	000425	徐工机械	508,798	29,103,245.60	0.47
41	000651	格力电器	1,585,642	28,747,689.46	0.46
42	600489	中金黄金	695,179	28,043,520.86	0.45
43	601006	大秦铁路	3,582,652	28,016,338.64	0.45
44	600028	中国石化	3,454,906	27,846,542.36	0.45
45	000060	中金岭南	1,219,747	27,444,307.50	0.44
46	600089	特变电工	1,464,739	27,332,029.74	0.44
47	000527	美的电器	1,554,290	27,044,646.00	0.44
48	601766	中国南车	3,580,758	27,034,722.90	0.44
49	000538	云南白药	443,396	26,781,118.40	0.43
50	000001	深发展 A	1,683,492	26,582,338.68	0.43
51	000012	南 玻 A	1,330,132	26,270,107.00	0.42
52	000895	双汇发展	300,241	26,120,967.00	0.42
53	600690	青岛海尔	908,251	25,621,760.71	0.41
54	600068	葛洲坝	2,187,564	25,375,742.40	0.41
55	600518	康美药业	1,282,890	25,285,761.90	0.41
56	601628	中国人寿	1,179,250	25,118,025.00	0.40
57	600585	海螺水泥	837,745	24,864,271.60	0.40
58	000039	中集集团	1,079,619	24,820,440.81	0.40
59	000792	盐湖钾肥	371,809	24,628,628.16	0.40
60	601168	西部矿业	1,283,860	24,187,922.40	0.39
61	601958	金钼股份	965,455	23,402,629.20	0.38
62	600019	宝钢股份	3,568,645	22,803,641.55	0.37
63	600309	烟台万华	1,171,182	22,474,982.58	0.36
64	601390	中国中铁	5,177,632	22,419,146.56	0.36
65	601106	中国一重	3,772,782	22,410,325.08	0.36
66	600570	恒生电子	1,098,924	22,253,211.00	0.36
67	601009	南京银行	2,216,204	22,029,067.76	0.35
68	600875	东方电气	622,887	21,738,756.30	0.35
69	600256	广汇股份	513,710	21,539,860.30	0.35

70	600970	中材国际	523,354	21,305,741.34	0.34
71	000581	威孚高科	564,162	20,958,618.30	0.34
72	600100	同方股份	778,994	20,651,130.94	0.33
73	601699	潞安环能	339,888	20,270,920.32	0.33
74	600583	海油工程	2,488,727	20,158,688.70	0.32
75	000401	冀东水泥	845,604	19,981,622.52	0.32
76	600406	国电南瑞	276,326	19,912,051.56	0.32
77	600859	王府井	380,876	19,782,699.44	0.32
78	002007	华兰生物	406,009	19,646,775.51	0.32
79	600582	天地科技	752,384	19,554,460.16	0.31
80	601186	中国铁建	2,861,541	19,401,247.98	0.31
81	601607	上海医药	884,975	19,327,854.00	0.31
82	600739	辽宁成大	640,101	19,279,842.12	0.31
83	600352	浙江龙盛	1,632,949	19,154,491.77	0.31
84	000933	神火股份	763,180	19,117,659.00	0.31
85	002123	荣信股份	395,618	18,791,855.00	0.30
86	601989	中国重工	1,568,442	18,491,931.18	0.30
87	000623	吉林敖东	538,807	18,340,990.28	0.30
88	600383	金地集团	2,934,217	18,133,461.06	0.29
89	000402	金融街	2,734,311	18,073,795.71	0.29
90	600029	南方航空	1,853,097	18,049,164.78	0.29
91	000009	中国宝安	1,074,509	18,019,515.93	0.29
92	600866	星湖科技	1,268,322	17,934,073.08	0.29
93	601988	中国银行	5,517,185	17,820,507.55	0.29
94	000937	冀中能源	443,943	17,779,917.15	0.29
95	600546	山煤国际	510,931	17,678,212.60	0.28
96	000878	云南铜业	636,304	17,498,360.00	0.28
97	600132	重庆啤酒	308,569	17,103,979.67	0.28
98	600058	五矿发展	520,531	17,021,363.70	0.27
99	000541	佛山照明	1,020,723	16,933,794.57	0.27
100	601808	中海油服	653,754	16,696,877.16	0.27

101	600015	华夏银行	1,511,560	16,476,004.00	0.27
102	601666	平煤股份	780,473	16,460,175.57	0.26
103	600664	哈药股份	723,894	16,338,287.58	0.26
104	600415	小商品城	461,737	16,179,264.48	0.26
105	600499	科达机电	673,310	16,051,710.40	0.26
106	600166	福田汽车	661,072	16,050,828.16	0.26
107	601179	中国西电	2,031,488	16,048,755.20	0.26
108	600498	烽火通信	383,109	15,845,388.24	0.25
109	600879	航天电子	1,175,518	15,798,961.92	0.25
110	600535	天士力	387,156	15,780,478.56	0.25
111	601898	中煤能源	1,429,966	15,529,430.76	0.25
112	600497	驰宏锌锗	592,796	15,228,929.24	0.25
113	000768	西飞国际	1,235,544	14,999,504.16	0.24
114	601299	中国北车	2,104,559	14,921,323.31	0.24
115	601717	郑煤机	351,512	14,911,139.04	0.24
116	002106	莱宝高科	224,294	14,859,477.50	0.24
117	000069	华侨城 A	1,195,761	14,528,496.15	0.23
118	000758	中色股份	455,377	14,362,590.58	0.23
119	000839	中信国安	1,197,450	14,345,451.00	0.23
120	600177	雅戈尔	1,308,807	14,292,172.44	0.23
121	000422	湖北宜化	752,594	14,186,396.90	0.23
122	600487	亨通光电	348,224	14,137,894.40	0.23
123	600009	上海机场	1,136,143	14,076,811.77	0.23
124	000917	电广传媒	572,828	13,977,003.20	0.22
125	000969	安泰科技	602,448	13,964,744.64	0.22
126	600458	时代新材	218,263	13,929,544.66	0.22
127	600741	华域汽车	1,363,417	13,920,487.57	0.22
128	600208	新湖中宝	2,317,719	13,906,314.00	0.22
129	600298	安琪酵母	310,772	13,760,984.16	0.22
130	000876	新希望	649,465	13,606,291.75	0.22
131	600549	厦门钨业	284,838	13,555,440.42	0.22

132	000778	新兴铸管	1,514,697	13,526,244.21	0.22
133	600550	天威保变	579,456	13,379,639.04	0.22
134	000612	焦作万方	605,889	13,208,380.20	0.21
135	600395	盘江股份	404,648	13,171,292.40	0.21
136	600997	开滦股份	654,307	13,171,199.91	0.21
137	600660	福耀玻璃	1,280,165	13,134,492.90	0.21
138	600525	长园集团	575,447	13,125,946.07	0.21
139	600418	江淮汽车	1,232,935	13,106,099.05	0.21
140	600655	豫园商城	966,210	12,995,524.50	0.21
141	600809	山西汾酒	188,937	12,947,852.61	0.21
142	600598	北大荒	976,491	12,918,975.93	0.21
143	600881	亚泰集团	1,917,213	12,845,327.10	0.21
144	600642	申能股份	1,675,860	12,786,811.80	0.21
145	000061	农产品	724,729	12,762,477.69	0.21
146	601866	中海集运	2,845,734	12,748,888.32	0.21
147	600079	人福医药	496,508	12,651,023.84	0.20
148	601919	中国远洋	1,335,542	12,554,094.80	0.20
149	600884	杉杉股份	502,670	12,551,669.90	0.20
150	000898	鞍钢股份	1,619,771	12,520,829.83	0.20
151	601668	中国建筑	3,653,107	12,493,625.94	0.20
152	600720	祁连山	702,618	12,049,898.70	0.19
153	000400	许继电气	360,639	12,002,065.92	0.19
154	002152	广电运通	220,497	11,990,626.86	0.19
155	000800	一汽轿车	738,611	11,854,706.55	0.19
156	600315	上海家化	318,402	11,822,266.26	0.19
157	600537	海通集团	291,419	11,709,215.42	0.19
158	600143	金发科技	725,663	11,690,430.93	0.19
159	600795	国电电力	3,818,151	11,683,542.06	0.19
160	600456	宝钛股份	419,004	11,355,008.40	0.18
161	600631	百联股份	739,282	11,274,050.50	0.18
162	600062	双鹤药业	389,979	11,110,501.71	0.18

163	002155	辰州矿业	307,967	11,062,174.64	0.18
164	601333	广深铁路	3,188,310	10,999,669.50	0.18
165	000729	燕京啤酒	578,939	10,994,051.61	0.18
166	600703	三安光电	237,343	10,884,549.98	0.18
167	600811	东方集团	1,382,292	10,837,169.28	0.17
168	002038	双鹭药业	182,552	10,770,568.00	0.17
169	600588	用友软件	462,858	10,766,077.08	0.17
170	000550	江铃汽车	385,225	10,609,096.50	0.17
171	000024	招商地产	664,409	10,597,323.55	0.17
172	000680	山推股份	582,347	10,592,891.93	0.17
173	600770	综艺股份	486,518	10,557,440.60	0.17
174	600718	东软集团	651,095	10,443,563.80	0.17
175	600820	隧道股份	949,196	10,412,680.12	0.17
176	600026	中海发展	1,074,938	10,319,404.80	0.17
177	600635	大众公用	1,544,748	10,303,469.16	0.17
178	600812	华北制药	648,068	10,181,148.28	0.16
179	600388	龙净环保	300,869	10,178,398.27	0.16
180	600037	歌华有线	807,417	10,092,712.50	0.16
181	600832	东方明珠	1,177,732	10,022,499.32	0.16
182	601899	紫金矿业	1,211,982	9,950,372.22	0.16
183	600432	吉恩镍业	387,095	9,901,890.10	0.16
184	601001	大同煤业	468,850	9,850,538.50	0.16
185	002001	新 和 成	388,341	9,805,610.25	0.16
186	600500	中化国际	826,190	9,790,351.50	0.16
187	000759	武汉中百	776,088	9,716,621.76	0.16
188	002008	大族激光	432,658	9,691,539.20	0.16
189	600694	大商股份	203,328	9,635,713.92	0.16
190	000652	泰达股份	1,236,754	9,621,946.12	0.15
191	000825	太钢不锈	1,768,577	9,444,201.18	0.15
192	000783	长江证券	830,073	9,379,824.90	0.15
193	600316	洪都航空	346,584	9,274,587.84	0.15

194	600271	航天信息	334,380	9,198,793.80	0.15
195	600511	国药股份	370,400	9,185,920.00	0.15
196	000999	华润三九	355,635	9,086,474.25	0.15
197	000027	深圳能源	897,791	9,058,711.19	0.15
198	600066	宇通客车	430,184	9,046,769.52	0.15
199	600409	三友化工	1,085,852	8,969,137.52	0.14
200	000960	锡业股份	269,705	8,819,353.50	0.14
201	600085	同仁堂	255,486	8,758,060.08	0.14
202	600118	中国卫星	351,921	8,734,679.22	0.14
203	000559	万向钱潮	626,656	8,679,185.60	0.14
204	600188	兖州煤业	304,098	8,633,342.22	0.14
205	600018	上港集团	2,254,597	8,590,014.57	0.14
206	600261	浙江阳光	201,600	8,529,696.00	0.14
207	000762	西藏矿业	226,837	8,483,703.80	0.14
208	601101	昊华能源	180,000	8,470,800.00	0.14
209	600479	千金药业	458,921	8,430,378.77	0.14
210	600717	天津港	1,004,033	8,373,635.22	0.13
211	600008	首创股份	1,232,388	8,293,971.24	0.13
212	000963	华东医药	251,044	8,251,816.28	0.13
213	600895	张江高科	923,777	8,110,762.06	0.13
214	000625	长安汽车	851,431	8,097,108.81	0.13
215	601618	中国中冶	2,059,146	8,051,260.86	0.13
216	600198	大唐电信	409,441	8,037,326.83	0.13
217	600010	包钢股份	2,117,814	8,026,515.06	0.13
218	600312	平高电气	585,477	7,980,051.51	0.13
219	601998	中信银行	1,516,089	7,959,467.25	0.13
220	600600	青岛啤酒	229,078	7,944,425.04	0.13
221	601688	华泰证券	572,666	7,856,977.52	0.13
222	600584	长电科技	707,840	7,842,867.20	0.13
223	600153	建发股份	1,191,565	7,804,750.75	0.13
224	000807	云铝股份	649,391	7,753,728.54	0.12

225	002422	科伦药业	48,824	7,690,756.48	0.12
226	600649	城投控股	962,291	7,650,213.45	0.12
227	000826	桑德环境	225,491	7,524,634.67	0.12
228	600308	华泰股份	783,786	7,485,156.30	0.12
229	000869	张裕 A	77,575	7,444,097.00	0.12
230	600737	中粮屯河	469,408	7,440,116.80	0.12
231	000709	河北钢铁	1,992,441	7,431,804.93	0.12
232	600216	浙江医药	227,777	7,418,696.89	0.12
233	000562	宏源证券	440,242	7,369,651.08	0.12
234	002022	科华生物	409,038	7,354,503.24	0.12
235	600150	中国船舶	108,003	7,317,203.25	0.12
236	000962	东方钨业	282,827	7,212,088.50	0.12
237	600750	江中药业	198,496	7,151,810.88	0.12
238	600331	宏达股份	456,531	7,080,795.81	0.11
239	600467	好当家	483,977	6,993,467.65	0.11
240	600108	亚盛集团	1,057,009	6,955,119.22	0.11
241	600528	中铁二局	763,017	6,928,194.36	0.11
242	600220	江苏阳光	1,335,568	6,918,242.24	0.11
243	600596	新安股份	454,096	6,911,341.12	0.11
244	600815	厦工股份	489,018	6,909,824.34	0.11
245	600269	赣粤高速	1,222,990	6,812,054.30	0.11
246	000970	中科三环	239,736	6,707,813.28	0.11
247	600971	恒源煤电	128,637	6,683,978.52	0.11
248	000501	鄂武商 A	363,429	6,683,459.31	0.11
249	000488	晨鸣纸业	945,322	6,673,973.32	0.11
250	600872	中炬高新	901,748	6,654,900.24	0.11
251	600880	博瑞传播	338,702	6,631,785.16	0.11
252	600267	海正药业	170,957	6,578,425.36	0.11
253	600581	八一钢铁	574,375	6,513,412.50	0.10
254	600628	新世界	545,490	6,502,240.80	0.10
255	600169	太原重工	303,097	6,462,028.04	0.10

256	600839	四川长虹	1,736,729	6,425,897.30	0.10
257	600428	中远航运	762,436	6,358,716.24	0.10
258	600320	振华重工	972,459	6,350,157.27	0.10
259	000951	中国重汽	228,723	6,326,478.18	0.10
260	600516	方大炭素	451,510	6,325,655.10	0.10
261	600096	云天化	236,301	6,311,599.71	0.10
262	002065	东华软件	204,656	6,297,265.12	0.10
263	600161	天坛生物	274,908	6,295,393.20	0.10
264	000897	津滨发展	1,206,506	6,285,896.26	0.10
265	600125	铁龙物流	427,123	6,159,113.66	0.10
266	600602	广电电子	797,353	6,139,618.10	0.10
267	600115	东方航空	931,268	6,127,743.44	0.10
268	000021	长城开发	515,528	6,052,298.72	0.10
269	002028	思源电气	229,901	6,039,499.27	0.10
270	000900	现代投资	290,696	5,973,802.80	0.10
271	000930	丰原生化	722,504	5,967,883.04	0.10
272	000848	承德露露	231,577	5,963,107.75	0.10
273	600481	双良节能	358,573	5,952,311.80	0.10
274	600460	士兰微	259,022	5,929,013.58	0.10
275	600311	荣华实业	312,984	5,815,242.72	0.09
276	002249	大洋电机	190,149	5,805,248.97	0.09
277	600674	川投能源	392,805	5,789,945.70	0.09
278	000735	罗牛山	715,970	5,785,037.60	0.09
279	600886	国投电力	800,774	5,741,549.58	0.09
280	000968	煤气化	220,602	5,729,033.94	0.09
281	601288	农业银行	2,126,784	5,699,781.12	0.09
282	001696	宗申动力	558,733	5,671,139.95	0.09
283	600425	青松建化	279,544	5,660,766.00	0.09
284	600219	南山铝业	582,380	5,649,086.00	0.09
285	600416	湘电股份	189,410	5,633,053.40	0.09
286	002063	远光软件	180,000	5,598,000.00	0.09

287	600160	巨化股份	245,073	5,558,255.64	0.09
288	000031	中粮地产	874,796	5,449,979.08	0.09
289	600117	西宁特钢	616,666	5,432,827.46	0.09
290	000959	首钢股份	1,212,508	5,359,285.36	0.09
291	600195	中牧股份	224,698	5,359,047.30	0.09
292	601918	国投新集	379,936	5,338,100.80	0.09
293	600060	海信电器	460,756	5,321,731.80	0.09
294	600033	福建高速	1,497,207	5,315,084.85	0.09
295	600595	中孚实业	377,754	5,213,005.20	0.08
296	000997	新大陆	263,951	5,205,113.72	0.08
297	000417	合肥百货	266,194	5,164,163.60	0.08
298	600266	北京城建	420,773	5,137,638.33	0.08
299	600557	康缘药业	274,883	5,134,814.44	0.08
300	600597	光明乳业	498,107	5,110,577.82	0.08
301	600858	银座股份	201,678	5,100,436.62	0.08
302	600183	生益科技	445,542	5,074,723.38	0.08
303	600197	伊力特	324,148	5,037,259.92	0.08
304	000786	北新建材	336,484	4,986,692.88	0.08
305	600675	中华企业	720,013	4,982,489.96	0.08
306	000718	苏宁环球	530,679	4,961,848.65	0.08
307	600797	浙大网新	693,703	4,932,228.33	0.08
308	600351	亚宝药业	493,873	4,889,342.70	0.08
309	000860	顺鑫农业	214,586	4,881,831.50	0.08
310	000690	宝新能源	881,934	4,877,095.02	0.08
311	000539	粤电力 A	827,391	4,865,059.08	0.08
312	600210	紫江企业	841,265	4,862,511.70	0.08
313	000726	鲁泰 A	518,985	4,842,130.05	0.08
314	600508	上海能源	170,974	4,836,854.46	0.08
315	600893	航空动力	154,484	4,832,259.52	0.08
316	600580	卧龙电气	286,381	4,808,336.99	0.08
317	601991	大唐发电	785,454	4,783,414.86	0.08

318	000088	盐田港	776,818	4,761,894.34	0.08
319	002230	科大讯飞	59,821	4,725,859.00	0.08
320	601117	中国化学	804,442	4,649,674.76	0.07
321	600517	置信电气	278,235	4,613,136.30	0.07
322	600064	南京高科	313,701	4,592,582.64	0.07
323	600616	金枫酒业	352,949	4,588,337.00	0.07
324	600611	大众交通	599,739	4,576,008.57	0.07
325	000667	名流置业	1,512,993	4,554,108.93	0.07
326	000926	福星股份	337,698	4,552,169.04	0.07
327	600804	鹏博士	521,271	4,519,419.57	0.07
328	600098	广州控股	539,101	4,506,884.36	0.07
329	600067	冠城大通	513,951	4,471,373.70	0.07
330	600004	白云机场	506,321	4,465,751.22	0.07
331	600170	上海建工	304,679	4,445,266.61	0.07
332	600575	芜湖港	210,418	4,431,403.08	0.07
333	600251	冠农股份	155,446	4,419,329.78	0.07
334	601788	光大证券	294,541	4,403,387.95	0.07
335	000816	江淮动力	564,699	4,387,711.23	0.07
336	600435	中兵光电	273,578	4,352,625.98	0.07
337	600138	中青旅	298,070	4,274,323.80	0.07
338	000961	中南建设	367,180	4,196,867.40	0.07
339	002069	獐子岛	97,623	4,183,145.55	0.07
340	000089	深圳机场	743,769	4,113,042.57	0.07
341	600835	上海机电	388,169	4,110,709.71	0.07
342	000046	泛海建设	457,411	4,107,550.78	0.07
343	601872	招商轮船	999,378	4,107,443.58	0.07
344	601888	中国国旅	131,799	4,081,815.03	0.07
345	600823	世茂股份	296,695	4,008,349.45	0.06
346	000988	华工科技	207,893	3,999,861.32	0.06
347	000685	中山公用	225,269	3,933,196.74	0.06
348	600867	通化东宝	267,280	3,886,251.20	0.06

349	600325	华发股份	383,216	3,885,810.24	0.06
350	000886	海南高速	617,655	3,878,873.40	0.06
351	000973	佛塑股份	254,661	3,873,393.81	0.06
352	600236	桂冠电力	865,851	3,809,744.40	0.06
353	601588	北辰实业	1,081,549	3,785,421.50	0.06
354	601268	二重重装	300,000	3,753,000.00	0.06
355	000776	广发证券	70,000	3,719,800.00	0.06
356	600006	东风汽车	765,810	3,706,520.40	0.06
357	000597	东北制药	215,557	3,694,646.98	0.06
358	600755	厦门国贸	473,755	3,690,551.45	0.06
359	000877	天山股份	116,662	3,683,019.34	0.06
360	600688	S 上石化	430,432	3,650,063.36	0.06
361	600436	片仔癀	50,000	3,640,000.00	0.06
362	600408	安泰集团	633,997	3,601,102.96	0.06
363	002385	大北农	88,180	3,563,353.80	0.06
364	002122	天马股份	267,604	3,548,429.04	0.06
365	600748	上实发展	439,157	3,543,996.99	0.06
366	000028	一致药业	107,344	3,542,352.00	0.06
367	600410	华胜天成	198,131	3,532,675.73	0.06
368	002237	恒邦股份	64,955	3,532,252.90	0.06
369	600366	宁波韵升	135,099	3,513,924.99	0.06
370	002104	恒宝股份	207,267	3,511,102.98	0.06
371	600704	中大股份	216,495	3,492,064.35	0.06
372	600199	金种子酒	166,838	3,481,909.06	0.06
373	600783	鲁信高新	100,000	3,472,000.00	0.06
374	600663	陆家嘴	206,020	3,461,136.00	0.06
375	600779	水井坊	155,592	3,454,142.40	0.06
376	600825	新华传媒	444,465	3,449,048.40	0.06
377	600787	中储股份	432,758	3,418,788.20	0.06
378	600601	方正科技	834,098	3,411,460.82	0.05
379	000823	超声电子	208,890	3,402,818.10	0.05

380	000677	山东海龙	651,288	3,393,210.48	0.05
381	600729	重庆百货	76,052	3,346,288.00	0.05
382	600643	爱建股份	348,487	3,317,596.24	0.05
383	002092	中泰化学	228,711	3,300,299.73	0.05
384	600231	凌钢股份	375,529	3,270,857.59	0.05
385	600322	天房发展	714,659	3,237,405.27	0.05
386	000616	亿城股份	619,996	3,174,379.52	0.05
387	600808	马钢股份	930,483	3,172,947.03	0.05
388	600005	武钢股份	717,221	3,069,705.88	0.05
389	002091	江苏国泰	112,080	3,048,576.00	0.05
390	600202	哈空调	248,515	3,016,972.10	0.05
391	600380	健康元	271,457	3,005,028.99	0.05
392	600307	酒钢宏兴	316,847	2,994,204.15	0.05
393	000683	远兴能源	326,682	2,976,073.02	0.05
394	000418	小天鹅 A	150,111	2,964,692.25	0.05
395	600638	新黄浦	327,246	2,951,758.92	0.05
396	600350	山东高速	616,248	2,877,878.16	0.05
397	600864	哈投股份	331,587	2,848,332.33	0.05
398	600993	马应龙	62,255	2,840,695.65	0.05
399	000725	京东方 A	894,898	2,827,877.68	0.05
400	002146	荣盛发展	207,585	2,821,080.15	0.05
401	600072	中船股份	154,175	2,816,777.25	0.05
402	600523	贵航股份	117,755	2,816,699.60	0.05
403	000912	泸天化	387,026	2,802,068.24	0.05
404	000655	金岭矿业	116,911	2,736,886.51	0.04
405	600221	海南航空	305,051	2,736,307.47	0.04
406	000513	丽珠集团	62,272	2,728,759.04	0.04
407	600653	申华控股	802,292	2,727,792.80	0.04
408	600816	安信信托	200,000	2,720,000.00	0.04
409	000016	深康佳 A	570,537	2,715,756.12	0.04
410	600533	栖霞建设	538,029	2,695,525.29	0.04

411	600639	浦东金桥	291,566	2,659,081.92	0.04
412	600087	长航油运	546,861	2,657,744.46	0.04
413	002194	武汉凡谷	186,440	2,591,516.00	0.04
414	000570	苏常柴A	257,344	2,586,307.20	0.04
415	000987	广州友谊	98,030	2,571,326.90	0.04
416	002242	九阳股份	169,826	2,559,277.82	0.04
417	600176	中国玻纤	98,984	2,514,193.60	0.04
418	600317	营口港	433,477	2,501,162.29	0.04
419	002073	软控股份	92,309	2,463,727.21	0.04
420	600863	内蒙华电	255,703	2,424,064.44	0.04
421	600888	新疆众和	100,052	2,406,250.60	0.04
422	000932	华菱钢铁	652,442	2,394,462.14	0.04
423	600586	金晶科技	175,794	2,390,798.40	0.04
424	000686	东北证券	104,718	2,334,164.22	0.04
425	600359	新农开发	145,228	2,319,291.16	0.04
426	002191	劲嘉股份	198,673	2,260,898.74	0.04
427	600685	广船国际	85,072	2,203,364.80	0.04
428	600641	万业企业	295,299	2,152,729.71	0.03
429	600052	浙江广厦	424,789	2,068,722.43	0.03
430	000100	TCL 集团	602,762	2,067,473.66	0.03
431	000650	仁和药业	90,000	2,061,000.00	0.03
432	000503	海虹控股	164,731	2,049,253.64	0.03
433	600162	香江控股	412,610	2,042,419.50	0.03
434	600978	宜华木业	322,354	1,998,594.80	0.03
435	000078	海王生物	166,898	1,991,093.14	0.03
436	600810	神马股份	200,786	1,989,789.26	0.03
437	002083	孚日股份	199,868	1,946,714.32	0.03
438	000793	华闻传媒	322,100	1,893,948.00	0.03
439	600983	合肥三洋	152,884	1,885,059.72	0.03
440	002375	亚厦股份	20,000	1,839,600.00	0.03
441	600011	华能国际	318,153	1,832,561.28	0.03

442	002029	七匹狼	55,379	1,829,722.16	0.03
443	600022	济南钢铁	500,209	1,775,741.95	0.03
444	600109	国金证券	114,659	1,676,314.58	0.03
445	000829	天音控股	141,513	1,664,192.88	0.03
446	000608	阳光股份	230,817	1,654,957.89	0.03
447	600020	中原高速	453,166	1,604,207.64	0.03
448	600522	中天科技	51,736	1,596,055.60	0.03
449	600747	大连控股	273,147	1,559,669.37	0.03
450	600246	万通地产	268,350	1,553,746.50	0.03
451	000822	山东海化	226,588	1,549,861.92	0.02
452	600742	一汽富维	50,000	1,510,500.00	0.02
453	000636	风华高科	120,710	1,502,839.50	0.02
454	600270	外运发展	163,353	1,447,307.58	0.02
455	002353	杰瑞股份	10,000	1,428,800.00	0.02
456	601107	四川成渝	210,793	1,397,557.59	0.02
457	600122	宏图高科	100,043	1,392,598.56	0.02
458	000717	韶钢松山	362,213	1,361,920.88	0.02
459	600569	安阳钢铁	398,670	1,347,504.60	0.02
460	000006	深振业 A	181,623	1,265,912.31	0.02
461	600048	保利地产	99,279	1,260,843.30	0.02
462	002465	海格通信	30,000	1,222,800.00	0.02
463	600178	东安动力	99,769	1,165,301.92	0.02
464	600282	南钢股份	324,238	1,112,136.34	0.02
465	000927	一汽夏利	132,344	1,078,603.60	0.02
466	000533	万家乐	102,257	1,045,066.54	0.02
467	600426	华鲁恒升	67,023	926,928.09	0.01
468	601600	中国铝业	83,540	847,095.60	0.01
469	000537	广宇发展	98,527	813,833.02	0.01
470	000059	辽通化工	67,864	786,543.76	0.01
471	600151	航天机电	57,318	753,731.70	0.01
472	600662	强生控股	75,936	546,739.20	0.01

473	600300	维维股份	71,554	422,168.60	0.01
474	600054	黄山旅游	18,256	320,210.24	0.01
475	000661	长春高新	4,853	295,062.40	0.00
476	600158	中体产业	38,076	284,427.72	0.00
477	000066	长城电脑	28,554	275,546.10	0.00
478	000522	白云山 A	13,495	231,034.40	0.00
479	600239	云南城投	11,271	209,302.47	0.00
480	600059	古越龙山	14,192	193,720.80	0.00
481	000159	国际实业	12,670	191,823.80	0.00
482	600139	西部资源	5,309	190,858.55	0.00
483	002304	洋河股份	784	175,616.00	0.00
484	600707	彩虹股份	8,510	162,711.20	0.00
485	000682	东方电子	30,454	162,319.82	0.00
486	000627	天茂集团	32,240	161,522.40	0.00
487	600785	新华百货	5,336	154,957.44	0.00
488	002294	信立泰	2,117	152,826.23	0.00
489	000540	中天城投	9,360	128,512.80	0.00
490	002048	宁波华翔	9,323	126,699.57	0.00
491	600961	株冶集团	6,322	113,290.24	0.00
492	600110	中科英华	13,499	108,801.94	0.00
493	002081	金螳螂	1,574	108,259.72	0.00
494	002078	太阳纸业	9,589	107,396.80	0.00
495	000571	新大洲 A	16,255	103,056.70	0.00
496	600521	华海药业	6,553	99,343.48	0.00
497	000830	鲁西化工	15,547	95,458.58	0.00
498	000511	银基发展	27,378	89,526.06	0.00
499	000712	锦龙股份	5,118	89,309.10	0.00
500	000939	凯迪电力	5,582	87,302.48	0.00
501	000828	东莞控股	12,957	85,645.77	0.00
502	000601	韶能股份	15,982	83,106.40	0.00
503	600590	泰豪科技	6,229	74,000.52	0.00

504	600141	兴发集团	3,663	73,479.78	0.00
505	000428	华天酒店	7,203	67,780.23	0.00
506	002056	横店东磁	1,566	61,481.16	0.00
507	600622	嘉宝集团	5,818	59,285.42	0.00
508	600120	浙江东方	6,663	57,568.32	0.00
509	000158	常山股份	8,508	56,748.36	0.00
510	000572	海马股份	9,558	56,583.36	0.00
511	600963	岳阳纸业	5,515	55,646.35	0.00
512	600877	中国嘉陵	4,916	47,537.72	0.00
513	600491	龙元建设	3,810	47,091.60	0.00
514	600657	信达地产	7,669	46,934.28	0.00
515	600824	益民集团	5,173	35,745.43	0.00
516	002142	宁波银行	2,881	35,724.40	0.00
517	600736	苏州高新	5,310	27,824.40	0.00
518	000410	沈阳机床	2,253	27,261.30	0.00
519	000728	国元证券	1,944	23,833.44	0.00
520	002310	东方园林	154	21,250.46	0.00
521	600157	永泰能源	885	20,549.70	0.00
522	600676	交运股份	2,759	19,450.95	0.00
523	002005	德豪润达	1,018	17,489.24	0.00
524	600724	宁波富达	2,954	17,428.60	0.00
525	600826	兰生股份	541	10,619.83	0.00
526	600295	鄂尔多斯	519	10,089.36	0.00
527	601818	光大银行	2,532	10,026.72	0.00
528	600439	瑞贝卡	754	9,869.86	0.00
529	600999	招商证券	506	9,593.76	0.00
530	600252	中恒集团	255	9,039.75	0.00
531	600651	飞乐音响	676	8,051.16	0.00
532	600509	天富热电	687	7,550.13	0.00
533	600017	日照港	1,704	6,952.32	0.00
534	600790	轻纺城	682	6,806.36	0.00

535	600038	哈飞股份	213	6,066.24	0.00
536	000780	平庄能源	344	5,273.52	0.00
537	600844	丹化科技	335	5,081.95	0.00
538	000301	东方市场	979	4,992.90	0.00
539	600754	锦江股份	207	4,808.61	0.00
540	600725	云维股份	476	4,498.20	0.00
541	600851	海欣股份	645	4,186.05	0.00
542	600021	上海电力	988	3,932.24	0.00
543	600240	华业地产	486	3,620.70	0.00
544	600289	亿阳信通	283	3,562.97	0.00
545	600186	莲花味精	731	3,545.35	0.00
546	600438	通威股份	358	3,286.44	0.00
547	600339	天利高新	302	2,814.64	0.00
548	600121	郑州煤电	226	2,802.40	0.00
549	601099	太平洋	241	2,617.26	0.00
550	002254	烟台氨纶	76	2,590.84	0.00
551	002244	滨江集团	225	2,538.00	0.00
552	002064	华峰氨纶	212	2,376.52	0.00
553	600726	华电能源	671	2,241.14	0.00
554	601003	柳钢股份	449	2,218.06	0.00
555	600545	新疆城建	204	1,950.24	0.00
556	002097	山河智能	116	1,943.00	0.00
557	000996	中国中期	72	1,884.96	0.00
558	002004	华邦制药	33	1,740.42	0.00
559	600702	沱牌曲酒	75	1,594.50	0.00
560	000911	南宁糖业	50	1,192.50	0.00
561	600510	黑牡丹	88	801.68	0.00
562	000598	兴蓉投资	32	660.16	0.00
563	600482	风帆股份	9	139.23	0.00
564	600805	悦达投资	5	73.15	0.00
565	600326	西藏天路	4	64.76	0.00

566	600078	澄星股份	7	54.88	0.00
-----	--------	------	---	-------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002537	海立美达	500	20,000.00	0.00
2	300158	振东制药	500	19,400.00	0.00
3	002536	西泵股份	500	18,000.00	0.00
4	002535	林州重机	500	12,500.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	118,817,659.65	2.07
2	601601	中国太保	96,110,047.44	1.68
3	601939	建设银行	93,776,486.90	1.64
4	002024	苏宁电器	86,459,252.88	1.51
5	601318	中国平安	81,745,203.29	1.43
6	000858	五粮液	72,668,107.97	1.27
7	600000	浦发银行	63,291,256.33	1.10
8	600030	中信证券	62,198,417.18	1.08
9	601166	兴业银行	60,323,007.55	1.05
10	002202	金风科技	54,046,533.69	0.94
11	601088	中国神华	54,036,028.28	0.94
12	600837	海通证券	52,182,724.75	0.91
13	000001	深发展 A	48,478,861.59	0.85
14	600887	伊利股份	44,728,407.77	0.78
15	000002	万科 A	43,614,623.07	0.76
16	000983	西山煤电	42,463,127.69	0.74
17	600028	中国石化	41,866,813.82	0.73

18	000651	格力电器	41,148,552.07	0.72
19	600511	国药股份	39,836,063.40	0.69
20	600519	贵州茅台	39,506,473.10	0.69

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	127,025,627.61	2.22
2	601939	建设银行	94,010,452.10	1.64
3	601318	中国平安	92,167,777.79	1.61
4	002024	苏宁电器	85,517,015.35	1.49
5	600519	贵州茅台	81,320,857.63	1.42
6	600000	浦发银行	77,280,759.22	1.35
7	601088	中国神华	69,953,423.46	1.22
8	600030	中信证券	69,464,761.71	1.21
9	000651	格力电器	66,262,813.31	1.16
10	600048	保利地产	61,676,022.58	1.08
11	600550	天威保变	58,573,920.92	1.02
12	600875	东方电气	57,352,538.08	1.00
13	601166	兴业银行	56,829,156.70	0.99
14	601601	中国太保	54,615,942.89	0.95
15	000983	西山煤电	39,125,615.88	0.68
16	600028	中国石化	38,846,054.15	0.68
17	601328	交通银行	38,331,118.98	0.67
18	600511	国药股份	37,811,091.23	0.66
19	600031	三一重工	37,608,514.07	0.66
20	000002	万科A	37,547,306.77	0.65

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,008,797,449.12
卖出股票的收入（成交）总额	3,439,705,891.74

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	200,564,000.00	3.23
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	200,564,000.00	3.23

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801047	08 央票 47	1,200,000	120,468,000.00	1.94
2	0801017	08 央票 17	800,000	80,096,000.00	1.29

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

8.9.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	669,186.06
2	应收证券清算款	30,514,539.51
3	应收股利	-
4	应收利息	6,990,732.86
5	应收申购款	21,935,337.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	60,109,795.91

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002535	林州重机	12,500.00	0.00	新股网上认购
2	002536	西泵股份	18,000.00	0.00	新股网上认购
3	300158	振东制药	19,400.00	0.00	新股网上认购
4	002537	海立美达	20,000.00	0.00	新股网上认购

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
237,453	29,950.88	2,185,071,103.65	30.72%	4,926,854,600.28	69.28%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,538,353.84	0.0357%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2002年11月8日)基金份额总额	3,094,001,262.00
本报告期期初基金份额总额	5,991,712,872.20
本报告期基金总申购份额	6,531,546,469.54
减：本报告期基金总赎回份额	5,411,333,637.81
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,111,925,703.93

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2010年1月16日，关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

(2) 2010年5月13日，关于总经理任职的公告，经本公司董事会会议审议通过，聘任李劼先生任本公司总经理。董事长俞妙根先生不再兼任总经理职务。

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

(4) 2010年9月2日，关于增聘基金经理的公告，因工作需要，经华安基金管理有限公司董事会审议批准，决定增聘牛勇先生担任华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金的基金经理职务，与许之彦先生共同管理华安中国A股增强指数基金。

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：

经证监会审批，晏秋生任资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 114,000.00 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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券有限责任公司	1	2,017,233,120.50	27.36%	1,714,648.57	27.70%	-
招商证券股份有限公司	1	1,854,199,666.79	25.15%	1,506,550.91	24.34%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	1,321,415,834.84	17.92%	1,123,199.62	18.15%	-
申银万国证券股份有限公司	1	1,100,946,835.26	14.93%	935,803.13	15.12%	-
中国银河证券股份	1	840,557,324.76	11.40%	714,472.65	11.54%	-

有限公司						
广发证券股份有限公司	1	239,353,515.32	3.25%	194,476.11	3.14%	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信建投证券有限责任公司	278,043.00	1.39%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	2,363,545.24	11.79%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	17,405,851.00	86.82%	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金无交易单元变更情况。

2、券商专用交易单元选择标准：

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

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

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务

需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或基金投资部/市场部提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下部分基金参加中国邮储银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-04
2	关于旗下部分基金参加中国工商银行“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-04
3	关于新增广发华福证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-14
4	关于参加广发华福证券有限责任公司网上交易费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-14
5	关于旗下部分基金参加深圳发展银行	《上海证券报》、	2010-01-18

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

	基金代销机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
16	关于旗下基金持有的“中信证券”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-04-27
17	关于新增东莞银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-04-28
18	关于旗下基金持有的“中信证券”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-05-06
19	关于新增西南证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-05-12
20	关于旗下基金持有的“双汇发展”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-05-18
21	关于华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安策略优选股票型证券投资基金参加中国农业银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-05-26
22	关于新增中国农业银行股份有限公司为华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安策略优选股票型证券投资基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-05-26
23	关于旗下基金参加中信银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-01
24	关于新增大通证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-02

25	关于旗下基金在申银万国证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-04
26	关于北京分公司办公地址变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-18
27	关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-29
28	关于旗下部分基金参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-30
29	关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-30
30	关于旗下基金持有的“中国平安”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-07-02
31	关于新增英大证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-07-07
32	关于新增华泰联合证券有限责任公司为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金代销机构及定期定额、网上申购费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-07-15
33	关于旗下基金在信达证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-07-19
34	关于参加信达证券股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-07-19

35	关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-08-18
36	关于旗下基金参加中信建投证券定投申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-08-25
37	关于旗下基金参加中信建投证券有限责任公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-08-25
38	关于新增东吴证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-08-26
39	关于新增温州银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-06
40	关于旗下基金持有的“中国平安”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-06
41	关于旗下基金参加华泰证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-17
42	关于电子直销平台开通“趋势定投”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-18
43	关于电子直销平台开通“自动停损”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-18
44	关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-10-08

45	关于新增天风证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-10-22
46	关于新增日信证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-01
47	关于旗下基金持有的“威孚高科”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-16
48	关于旗下基金持有的“威孚高科”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-17
49	关于新增新时代证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-26
50	关于电子直销平台开通“天天盈账户”第三方支付业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-29
51	关于设立华安资产管理（香港）有限公司的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-03
52	关于旗下基金持有的“双汇发展”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-03
53	关于广州分公司办公地址变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-17
54	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-31

55	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-31
56	关于参加深圳发展银行股份有限公司基金定期定额投资、网上银行及电话银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-01-04
57	关于参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-01-04
58	关于参加温州银行股份有限公司个人网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-01-31
59	关于新增浙商证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-01-31
60	关于新增财达证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-02-14
61	关于旗下基金持有的“上海汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-02-19
62	关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定投业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-03-10

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

12.2 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>。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一一年三月二十六日