

# 华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资 基金

## 2009 年半年度报告摘要

2009 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2009 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 8 月 20 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	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	4
2.4	信息披露方式	5
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	5
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§ 5	托管人报告	10
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	11
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1	资产负债表	11
6.2	利润表	12
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4	报表附注	14
§ 7	投资组合报告	18
7.1	期末基金资产组合情况	18
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	19
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名指数股票投资和积极股票投资明细	20
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	21
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	22
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	22
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	23
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	23
7.9	投资组合报告附注	23
§ 8	基金份额持有人信息	24
§ 9	开放式基金份额变动	24
§ 10	重大事件揭示	24

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安中国 A 股增强指数	
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	
报告期末基金份额总额	5,950,137,166.30 份	

### 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 <b>95%</b>。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 <b>MSCI 中国 A 股指数成分股构成及其权重</b>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	$95\% \times \text{MSCI 中国 A 股指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
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 (简称“华安基金”)	中国工商银行股份有限公司 (简称“中国工商银行”)
信息披露负责人	姓名	冯颖	蒋松云
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn

客户服务电话	40088-50099	95588
传真	021-68863414	010-66105798

## 2.4、信息披露方式

登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	<a href="http://www.huaan.com.cn">http://www.huaan.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	-143,738,131.62
本期利润	2,155,318,114.52
加权平均基金份额本期利润	0.3328
本期基金份额净值增长率	64.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期 (2009年1月1日-2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.1726
期末基金资产净值	5,051,229,405.14
期末基金份额净值	0.849

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	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
过去一个月	11.86%	1.04%	12.94%	1.09%	-1.08%	-0.05%
过去三个月	22.16%	1.38%	23.81%	1.42%	-1.65%	-0.04%
过去六个月	64.22%	1.78%	67.91%	1.83%	-3.69%	-0.05%
过去一年	10.55%	2.37%	12.85%	2.40%	-2.30%	-0.03%
过去三年	126.78%	2.25%	120.74%	2.29%	6.04%	-0.04%

自基金合同生效起至今	243.93%	1.70%	181.20%	1.73%	62.73%	-0.03%
------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

注：业绩比较基准收益率 = 95% × MSCI 中国 A 股指数收益率 + 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。

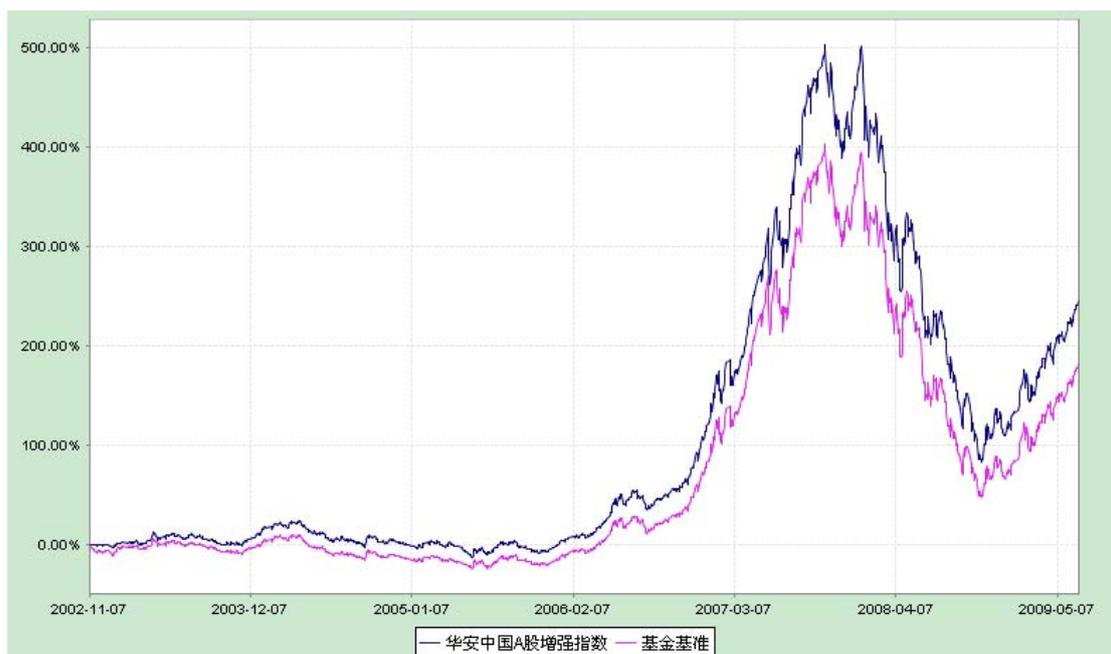
根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95% 投资于股票，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。截至 2009 年 6 月 30 日，本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 94.84%。其中权证投资比例为 0。投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金净资产为 5.37%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

### 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的历史走势对比图

(2002 年 11 月 8 日至 2009 年 6 月 30 日)



根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金合同》规定，本基金已经自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分基金的投资中三、投资范围；四、投资组合原则及选择标准（三）指数化增强性投资管理的限度和控制；六、投资限制的有关规定。

## § 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上海沸点投资发展有限公司。

截至 2009 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新股票、华安中国 A 股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证 180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安国际配置(QDII)等 12 只开放式基金，管理资产规模达到 790.62 亿人民币、0.972 亿美元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理、金融工程部负责人	2008-4-25	-	6 年	理学博士，6 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。
刘瓔	本基金的基金经理	2008-4-25	-	8 年	管理学硕士，8 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 月起担任上证 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基金合同承诺的情形。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易，公司《交易端基金间公平交易管理办法-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”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，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《交易端基金间公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内华安中国 A 股增强指数基金净值上涨 64.22%，本基金比较基准上涨 67.91%，基金净值表现落后比较基准 3.69%，截至 2009 年 6 月 30 日，华安中国 A 股增强指数基金的跟踪偏离度为 0.12%。

自 07 年底，全球经济经历了百年不遇的金融危机，主要经济体采取了强有力的刺激经济政策，有效遏制了经济进一步恶化甚至出现大萧条的局面。09 年，政策累积效果逐步体现，全球经济开始出现复苏迹象。年初，市场对国内宏观经济仍存疑虑，但随着银行新增贷款增加持续超预期、产业振兴计划陆续实施、出口退税政策调整等，工业增加值、采购经理人指数等经济数据不断改善，汽车、房地产两个产业链较长的大行业出现加速增长，市场的预期也发生了根本性变化。

在坚持拟合 MSCI 中国 A 股指数的前提下，本基金前期增强部分的操作是沿着政策和产业复苏预期进行的，取得了较好的效果。考虑到政策受益的复苏型行业短期涨幅较大，增强策略调整到新能源和部分消费行业，增强效果不甚理想。市场波

动增加导致了基金申购和赎回有所加大,也对基金跟踪产生了一定影响。年初以来,本基金相对于基准有所落后。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

09 年下半年,国内宏观经济仍将保持较强的复苏态势。微观层面,工业企业例利润和上市公司利润增长将逐步走出低谷。在全球经济逐步复苏的背景下,国内进出口也将得以改善。国内货币政策将继续微调,商业银行新增贷款会有所减少,但是适度宽松的货币政策不会根本性改变,新增贷款绝对量已经较大,货币周转率也在加快,下半年流动性依然充沛。

从市场估值来看,目前市场估值逐步进入合理区域,甚至出现结构性估值偏高,市场短期出现一定波动在所难免。但在流动性充沛、宏观经济预期强化等因素下,市场估值有可能还会进一步提升。

本基金认为,下半年市场整体上仍存在一定的机会,对国内中长期经济发展和市场充满信心。下半年,本基金增强的行业将侧重在内需稳定且出口改善的家电、机械行业,稳定增长的医药行业,以及符合国家长期能源战略规划的新能源行业等。作为 MSCI 中国 A 股增强性指数基金的管理人,我们继续坚持被动投资的原则,在充分拟合市场的前提下,通过适度的增强策略,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化:

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响:

无。

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

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会,组成人员包括:首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部负责人、金融工程部负责人、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,曾任基金安信的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理,投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

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

黄勤，固定收益部负责人，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，现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。

许之彦，金融工程部负责人，理学博士，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 股基金经理，金融工程部负责人。

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

## (2) 托管银行

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

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

### 4、基金经理参与或决定估值的程度：

本基金的基金经理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。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期由于基金投资当期亏损，不进行收益分配。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009 年上半年，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金

托管人应尽的义务。

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

2009 年上半年，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2009 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金  
 报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	75,146,095.48	113,788,300.35
结算备付金	5,331,353.60	4,967,149.32
存出保证金	2,244,185.14	1,063,506.47
交易性金融资产	4,986,896,268.64	3,501,309,826.34
其中：股票投资	4,790,796,268.64	3,402,919,826.34
基金投资	-	-
债券投资	196,100,000.00	98,390,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	1,213,172.35
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	594,000.00	36,671,883.36
应收利息	3,708,299.82	795,943.79
应收股利	2,455,775.14	-
应收申购款	28,363,561.15	9,329,630.21

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,104,739,538.97	3,669,139,412.19
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2009年6月30日</b>	<b>2008年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	23,396,735.82
应付赎回款	44,215,759.52	10,119,093.43
应付管理人报酬	4,054,470.87	3,287,087.66
应付托管费	810,894.17	657,417.52
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,716,573.26	3,734,804.26
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	712,436.01	628,000.00
负债合计	53,510,133.83	41,823,138.69
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	1,813,033,846.64	2,139,499,094.43
未分配利润	3,238,195,558.50	1,487,817,179.07
所有者权益合计	5,051,229,405.14	3,627,316,273.50
<b>负债和所有者权益总计</b>	<b>5,104,739,538.97</b>	<b>3,669,139,412.19</b>

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.849 元，基金份额总额 5,950,137,166.30 份。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

## 6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年6月30日	2008年1月1日至2008年6月30日
<b>一、收入</b>	2,195,524,553.32	-3,218,171,603.43
1. 利息收入	3,017,968.14	4,974,310.18
其中：存款利息收入	963,590.71	1,266,811.76
债券利息收入	2,043,373.43	3,707,498.42

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	11,004.00	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-106,549,660.96	-124,328,035.82
其中：股票投资收益	-135,999,102.44	-155,905,330.15
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-497,600.00	777,451.66
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	1,731,312.55	405,696.14
股利收益	28,215,728.93	30,394,146.53
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,299,056,246.14	-3,098,817,877.79
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
<b>二、费用（以“-”号填列）</b>	<b>-40,206,438.80</b>	<b>-55,110,827.52</b>
1、管理人报酬	-21,999,846.72	-29,321,030.27
2、托管费	-4,399,969.36	-5,864,206.07
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	-13,563,530.31	-18,777,280.53
5、利息支出	-19,896.73	-921,438.10
其中：卖出回购金融资产支出	-19,896.73	-921,438.10
6、其他费用	-223,195.68	-226,872.55
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>2,155,318,114.52</b>	<b>-3,273,282,430.95</b>
所得税费用（以“-”号填列）	-	-
<b>四、净利润（净亏损“-”号填列）</b>	<b>2,155,318,114.52</b>	<b>-3,273,282,430.95</b>

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,139,499,094.43	1,487,817,179.07	3,627,316,273.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,155,318,114.52	2,155,318,114.52

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-326,465,247.79	-404,939,735.09	-731,404,982.88
其中：1、基金申购款	1,698,963,524.23	2,221,361,001.93	3,920,324,526.16
2、基金赎回款（以“-”号填列）	-2,025,428,772.02	-2,626,300,737.02	-4,651,729,509.04
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,813,033,846.64	3,238,195,558.50	5,051,229,405.14
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日</b>		
	<b>实收基金</b>	<b>未分配利润</b>	<b>所有者权益合计</b>
一、期初所有者权益（基金净值）	1,413,053,092.04	4,973,043,748.93	6,386,096,840.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,273,282,430.95	-3,273,282,430.95
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）	397,300,613.61	1,051,162,258.26	1,448,462,871.87
其中：1、基金申购款	1,437,348,286.38	3,795,782,150.73	5,233,130,437.11
2、基金赎回款（以“-”号填列）	-1,040,047,672.77	-2,744,619,892.47	-3,784,667,565.24
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）	1,810,353,705.65	2,750,923,576.24	4,561,277,281.89

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增强型证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字 2002 第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》)发起，并于 2002 年 11 月 8 日募集成

立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,094,001,258.61 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2002)第 126 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；此外，本基金可参与股票一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股，在成份股之外的股票投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成分股的其他个股。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 $\times$ 95%+金融同业存款利率 $\times$ 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 2009 年 8 月 27 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日止期间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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (d) 基金卖出股票按 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。
- (e) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

### 6.4.6 关联方关系

**6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其它重大利害关系的关联方发生变化的情况**  
 无。

**6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.7.1.1 股票交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无应支付关联方的佣金。

#### 6.4.7.2 关联方报酬

##### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	21,999,846.72	29,321,030.27
其中：当期已支付	17,945,375.85	25,146,834.97
当期末支付	4,054,470.87	4,174,195.30

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 × 1.0% / 当年天数。

##### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	4,399,969.36	5,864,206.07
其中：当期已支付	3,589,075.19	5,029,366.97
当期末支付	810,894.17	834,839.10

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

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

#### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

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

基金管理人本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无运用固有资金投资本基金的情况。

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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期末（2008 年 6 月 30 日）均无投资本基金的情况。

#### 6.4.7.5 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	75,146,095.48	828,046.32	90,832,092.88	967,708.44

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.8 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

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
600161	天坛生物	2009-6-27	公告重大事项	22.60	2009-7-2	24.86	396,650	10,153,132.50	8,964,290.00
600607	上实医药	2009-6-18	公告重大事项	19.33	未知	未知	346,000	5,141,487.00	6,688,180.00
600849	上海医药	2009-6-18	公告重大事项	12.18	未知	未知	450,730	5,460,417.24	5,489,891.40
000400	许继电气	2009-6-5	公告重大事项	18.28	2009-7-6	20.11	152,300	2,221,753.45	2,784,044.00
000792	盐湖钾肥	2009-6-26	公告重大事项	55.14	2009-7-27	60.65	556,991	30,998,813.26	30,712,483.74

##### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无债券正回购，因此无债券作为抵押。

#### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,790,796,268.64	93.85
	其中：股票	4,790,796,268.64	93.85
2	固定收益投资	196,100,000.00	3.84
	其中：债券	196,100,000.00	3.84
	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	80,477,449.08	1.58
6	其他资产	37,365,821.25	0.73
7	合计	5,104,739,538.97	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产的净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	9,496,949.17	0.19
B	采掘业	361,626,293.16	7.16
C	制造业	1,594,825,428.43	31.57
C0	食品、饮料	195,983,693.57	3.88
C1	纺织、服装、皮毛	39,780,574.08	0.79
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	17,353,204.80	0.34
C4	石油、化学、塑胶、塑料	148,757,535.65	2.94
C5	电子	15,029,136.33	0.30
C6	金属、非金属	375,562,949.36	7.44
C7	机械、设备、仪表	566,920,124.71	11.22
C8	医药、生物制品	224,002,013.40	4.43
C99	其他制造业	11,436,196.53	0.23
D	电力、煤气及水的生产和供应业	166,325,433.64	3.29
E	建筑业	149,646,207.46	2.96
F	交通运输、仓储业	220,370,718.77	4.36
G	信息技术业	207,948,226.42	4.12
H	批发和零售贸易	211,882,978.58	4.19
I	金融、保险业	1,213,673,873.87	24.03
J	房地产业	356,220,903.98	7.05
K	社会服务业	58,627,186.46	1.16
L	传播与文化产业	22,486,466.96	0.45

M	综合类	161,906,403.54	3.21
	合计	4,735,037,070.44	93.74

### 7.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产的净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	55,759,198.20	1.10
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	55,759,198.20	1.10
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	55,759,198.20	1.10

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名指数股票投资和积极股票投资明细

#### 7.3.1 指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600036	DR 招商银	9,052,398	202,864,239.18	4.02
2	600000	浦发银行	6,498,410	149,593,398.20	2.96
3	600030	中信证券	5,275,378	149,082,182.28	2.95
4	000002	万 科 A	10,197,270	130,015,192.50	2.57
5	601318	中国平安	2,615,342	129,354,815.32	2.56

 注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 网站

的半年度报告正文。

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	002202	金风科技	1,851,235	55,759,198.20	1.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于[www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn)网站的半年度报告正文。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	179,822,976.65	4.96
2	601318	中国平安	173,064,229.51	4.77
3	600036	招商银行	157,437,953.42	4.34
4	600016	民生银行	135,828,006.67	3.74
5	600000	浦发银行	119,054,757.55	3.28
6	002202	金风科技	115,522,637.12	3.18
7	002024	苏宁电器	95,837,265.78	2.64
8	601166	兴业银行	93,301,238.05	2.57
9	000002	万科 A	88,027,174.42	2.43
10	000792	盐湖钾肥	85,578,998.04	2.36
11	601088	中国神华	84,340,490.94	2.33
12	600089	特变电工	75,224,233.44	2.07
13	601766	中国南车	69,658,657.31	1.92
14	000001	深发展 A	68,369,468.67	1.88
15	600005	武钢股份	61,652,790.57	1.70
16	600383	金地集团	61,101,195.02	1.68
17	600050	中国联通	61,057,362.34	1.68
18	600028	中国石化	59,163,419.87	1.63
19	601988	中国银行	57,864,506.99	1.60
20	600550	天威保变	57,862,594.91	1.60

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	268,032,724.95	7.39
2	600036	招商银行	213,906,782.48	5.90
3	601318	中国平安	183,082,511.20	5.05

4	600000	浦发银行	179,576,825.59	4.95
5	601088	中国神华	173,686,031.00	4.79
6	601166	兴业银行	151,285,457.14	4.17
7	000002	万科A	149,822,145.88	4.13
8	600005	武钢股份	123,029,565.32	3.39
9	600028	中国石化	116,763,819.76	3.22
10	601328	交通银行	102,020,641.42	2.81
11	000792	盐湖钾肥	101,451,699.81	2.80
12	002024	苏宁电器	98,256,663.82	2.71
13	000983	西山煤电	96,286,384.15	2.65
14	600016	民生银行	92,603,999.39	2.55
15	601939	建设银行	90,947,324.11	2.51
16	600050	中国联通	85,962,987.29	2.37
17	002202	金风科技	78,792,010.45	2.17
18	600196	复星医药	62,306,700.20	1.72
19	600383	金地集团	62,074,799.31	1.71
20	601628	中国人寿	60,044,393.64	1.66

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额：	3,913,287,560.89
卖出股票的收入（成交）总额：	4,690,599,342.64

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	196,100,000.00	3.88
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	196,100,000.00	3.88

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	0901018	09 央票 18	1,000,000	99,740,000.00	1.97
2	0801092	08 央票 92	500,000	48,220,000.00	0.95
3	0801084	08 央票 84	500,000	48,140,000.00	0.95
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 投资组合报告附注

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

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

#### 7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	2,244,185.14
2	应收证券清算款	594,000.00
3	应收股利	2,455,775.14
4	应收利息	3,708,299.82
5	应收申购款	28,363,561.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	37,365,821.25

#### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.9.5 期末指数投资或积极投资前五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或积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
257,373	23,118.73	685,768,603.61	11.53%	5,264,368,562.69	88.47%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项 目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,417,528.62	0.041%

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2002 年 11 月 8 日) 基金份额总额	3,094,001,262.00
报告期期初基金份额总额	7,020,648,015.92
报告期期间基金总申购份额	5,575,319,170.63
报告期期间基金总赎回份额	6,645,830,020.25
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	5,950,137,166.30

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 2009 年 1 月 12 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(2). 2009 年 2 月 19 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

(3). 2009 年 7 月 3 日，本基金管理人发布增聘基金经理助理的公告，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（简称：华安中国 A 股增强指数）基金经理助理，协助该基金之基金经理许之彦先生、刘璎女士进行该基金

的投资运作。

(4). 2009 年 8 月 3 日, 本基金管理人发布基金经理暂停职务的公告, 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) 和华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 (简称: 华安上证 180ETF) 的基金经理刘璎女士因个人原因 (休产假) 无法正常履行职务, 本公司根据有关法规和公司制度批准刘璎女士于 2009 年 8 月 3 日开始休产假, 本次休假暂定持续至 2009 年 12 月 18 日。在此期间, 刘璎女士所任职的 华安中国 A 股增强指数基金由该基金的另一基金经理许之彦先生和基金经理助理牛勇先生继续管理, 华安上证 180ETF 基金由该基金的另一基金经理卢赤斌先生和基金经理助理熊志勇先生继续管理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下: 无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 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。

### 10.6 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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况:

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	1,664,202,300.90	19.34%	1,414,575.14	19.57%	-
招商证券股份有限公司	1	2,070,108,724.32	24.06%	1,681,971.34	23.27%	-
广发证券股份有限公司	1	184,664,773.00	2.15%	150,042.44	2.08%	-
中信建投证券有限责任公司	1	1,582,402,031.69	18.39%	1,345,032.95	18.61%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	1,484,715,357.24	17.26%	1,262,005.10	17.46%	-
中国银河证券股份有限公司	1	1,617,793,716.38	18.80%	1,375,125.50	19.02%	-

金额单位: 人民币元

券商名称	交易	回购交易	权证交易	备注
------	----	------	------	----

	单元数量	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
申银万国证券股份有限公司	1	100,000,000.00	49.98%	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	1,731,312.55	100.00%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	100,100,000.00	50.02%	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

退租宏源证券股份有限公司上海交易单元1个。

2、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

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

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元使用协议》，并通知基金托管人。

华安基金管理有限公司  
2009 年 8 月 28 日