

华安中小盘成长股票型证券投资基金 2009 年半年度报告

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 25 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 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.....	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.....	6
§ 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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
§ 5 托管人报告.....	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§ 7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	31
7.3 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.....	32
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	37
7.7 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.....	37
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.....	37
7.9 投资组合报告附注.....	37
§ 8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38

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	38
§ 9 开放式基金份额变动.....	38
§ 10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	40
10.8 其他重大事件.....	42
§ 11 备查文件目录.....	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中小盘成长股票型证券投资基金	
基金简称	华安中小盘成长股票	
交易代码	040007（前端）	041007（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 4 月 10 日	
报告期末基金份额总额	11, 159, 038, 130. 30 份	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。
投资策略	主要依靠基金管理人的研究优势，将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中，在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上，积极把握备选股票的投资机会，为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。
业绩比较基准	40%×天相中盘成长指数+40%×天相小盘成长指数+20%×中债-国债总指数
风险收益特征	本基金是积极成长型股票基金，属于证券投资基金中的较高风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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	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
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		俞妙根	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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huaan.com.cn
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

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	华安基金管理有限公司
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

§ 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

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	-2,259,921,464.42
本期利润	4,446,871,757.06
加权平均基金份额本期利润	0.3814
本期加权平均净值利润率	43.63%
本期基金份额净值增长率	56.75%
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)
期末可供分配利润	2,832,323,587.10

期末可供分配基金份额利润	0.2538
期末基金资产净值	11,737,118,714.04
期末基金份额净值	1.0518
3.1.3 累计期末指标	报告期(2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.80%

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
过去一个月	9.62%	0.97%	4.87%	0.85%	4.75%	0.12%
过去三个月	20.80%	1.31%	13.49%	1.30%	7.31%	0.01%
过去六个月	56.75%	1.55%	48.96%	1.70%	7.79%	-0.15%
过去一年	12.66%	2.12%	18.25%	2.14%	-5.59%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金转型起至今	14.80%	2.16%	7.49%	2.17%	7.31%	-0.01%

注：1、本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 **60-95%**，股票资产中的 **80%**以上投资于中国 **A** 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 **0-40%**；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 **5%**以上。

截至 2009 年 6 月 30 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 **85.38%**，债券的投资比例为基金资产净值的 **4.10%**，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 **10.42%**，投资于中国 **A** 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票占股票资产市值的 **80.60%**。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

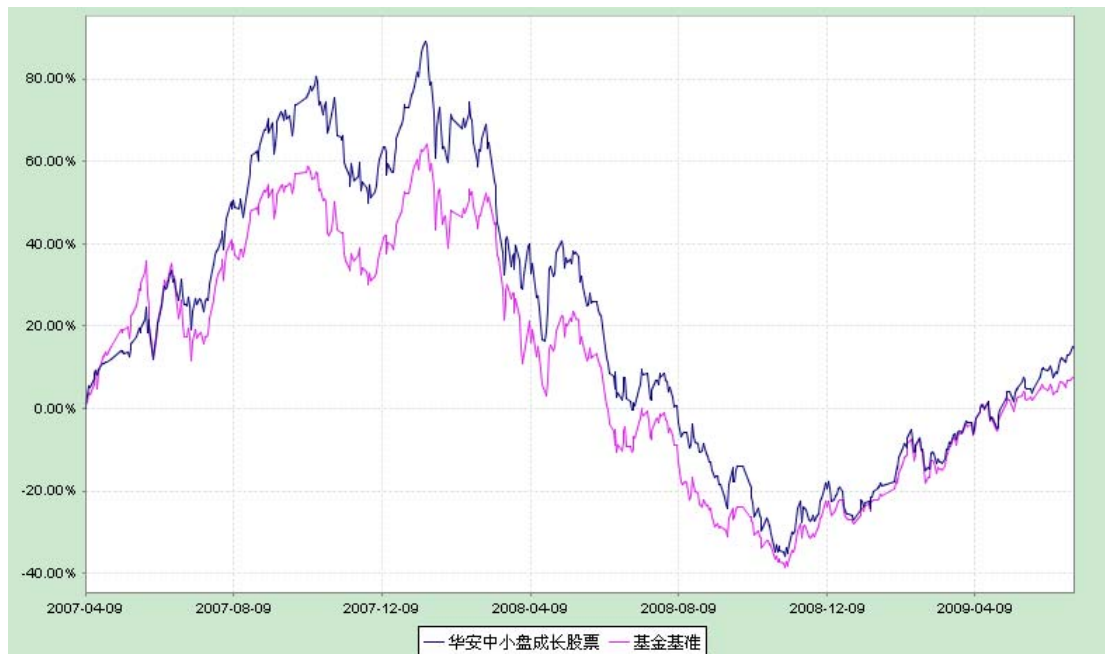
2、本基金于 2007 年 4 月 10 日从安瑞证券投资基金转型为华安中小盘成长股票型证券投资基金。

3.2.2 自基金转型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

华安中小盘成长股票型证券投资基金

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

(2007 年 4 月 10 日至 2009 年 6 月 30 日)



注：1、根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》规定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内已使基金的投资组合比例符合基金合同第十一部分基金的投资（五）投资限制的有关规定。

2、本基金于 2007 年 4 月 10 日从安瑞证券投资基金转型为华安中小盘成长股票型证券投资基金。

§ 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		
刘光华	本基金的基金经理	2007 年 3 月 14 日	2009 年 6 月 25 日	12 年	工商管理硕士，12 年银行、基金从业经历。曾在农业银行上海分行国际部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 年加入华安基金管理公司，曾任研究部高级研究员，2006 年 4 月至 2007 年 3 月担任华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2005 年 5 月至 2008 年 10 月 11 日担任华安 MSCI 中国 A 股指数基金经理，2007 年 3 月至 2009 年 6 月 25 日担任本基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理	2009 年 6 月 25 日	-	15 年	经济学硕士，15 年证券、基金行业从业经历。历任安徽省国际信托投资公司投资银行部业务主办、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、投研部副总监等职。2006 年 6 月 21 日至 2007 年 10 月 27 日任华富货币市场基金基金经理，2007 年 5 月 12 日至 2008 年 5 月 17 日同时任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。2008 年 6 月重新加入华安基金管理公司，并于 2008 年 10 月 11 日起担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理，2009 年 6 月 25 日起同时担任本基金的基金经理。

注：1、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。

2、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《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》、《华安中小盘成长股票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

华安旗下以成长为投资风格的有 3 个基金：华安中小盘成长股票、华安创新混合、基金安信封闭。09 年上半年，三基金净值增长率分别为：华安中小盘成长股票 56.75%、华安创新混合 30.51%、华安安信封闭 36.24%，华安中小盘成长股票的增长率高于华安创新混合和华安安信封闭。股票仓位的差异是三基金业绩差异较大的主要原因。上半年内，华安中小盘成长股票、华安创新混合和华安安信封闭的股票仓位的比例平均仓位为 77.68%、60.72%与 70.60%，华安中小盘成长股票的平均持仓比例明显要高于另外两个基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

上半年没有出现异常交易。

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

上半年，A 股连涨 6 个月，上证综指涨幅高达 60%。在年初全球经济仍笼罩在百年不遇金融危机的不利影响之下，中国政府采取不遗余力拉动经济的刺激政策，上半年新增信贷高达 7.3 万亿。全球主要经济体都采取了宽松的货币政策和财政政策，由此带来的充裕流动性加上 2008 年股市惨淡的跌幅，拉动了本轮股市的持续反弹。

本基金上半年取得相对较好的收益水平，在年初保持了 80%以上仓位，重点配置周期性板块，2 月曾显著减仓，短期规避了市场下跌的系统风险，其后随着市场的回升，仓位逐步回到较高水平。上半年对基金收益贡献较大的行业为银行、地产、汽车、能源、原材料、保险等，而对生物制药的超配效果一般。由于基金契约对本基金投资

大市值股票的比例限制，本基金在银行股的配置上低于平均水平，也不得不放弃了一些大市值股票的投资机会，一定程度上影响了基金获取更好的投资收益。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一季度中国 GDP 增速为 6.1%，二季度为 7.9%。房地产新开工面积 6 月单月达到 1.2 亿平米，超过历史峰值。房地产行业的复苏拉动整体经济增长的信心，经济数据 6、7 月份环比增长迅猛，显示中国经济 V 型复苏基本确立。展望下半年，宽裕的流动性和宏观经济复苏仍旧为股市的上涨提供良好的环境，随着经济状况的进一步好转，钢铁、化工、机械、航运等中游行业有望因需求的复苏出现行业拐点，上市公司业绩将进入向上修正阶段，企业盈利超预期将带来更多的投资机会。更长远看，全球性的流动性泛滥将极大程度的带来整体或局部的通胀预期，从而支撑上游原材料、资源、地产等行业的投资机会。宽松的货币政策在下半年可能会出现微调，但是只要不发生方向性改变，则很难改变市场运行的方向。下半年对美国经济复苏的预期正在加强，则对中国经济的信心和出口拉动起到积极作用，同时美国地产和消费的复苏还将拉动部分大宗商品的消费需求。但是，上半年累积的巨大涨幅随时会导致市场出现宽幅震荡，下半年仍要警惕市场风险。我们仍将以投资、消费、出口为主线，遵循经济复苏、行业复苏的脉络进行投资结构调整，关注上游、中游、下游行业的轮动，努力把握投资机会，以期投资者获取较好的投资回报。

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：

姓名	职务	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：

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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中小盘成长股票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

2009 年上半年，华安中小盘成长股票型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安中小盘成长股票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，华安中小盘成长股票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中小盘成长股票型证券投资基金 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：华安中小盘成长股票型证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	6.4.7.1	1,030,392,406.40	250,378,611.84
结算备付金		16,377,813.78	3,469,326.16
存出保证金		4,891,713.28	2,755,139.87
交易性金融资产	6.4.7.2	10,502,496,423.42	7,736,105,923.60
其中：股票投资		10,020,980,423.42	6,279,677,923.60
基金投资		-	-
债券投资		481,516,000.00	1,456,428,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	300,000,000.00	-
应收证券清算款		31,613,518.34	14,109,078.62
应收利息	6.4.7.5	13,878,087.92	37,044,951.48
应收股利		828,630.00	-
应收申购款		3,622,590.52	1,514,015.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		11,904,101,183.66	8,045,377,046.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		97,231,975.29	-
应付赎回款		41,884,658.74	3,504,849.37
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	14,116,102.65	10,851,029.58
应付托管费	6.4.10.2.2	2,352,683.76	1,808,504.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,390,103.44	2,873,438.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,006,945.74	912,191.85
负债合计		166,982,469.62	19,950,014.06
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,820,492,290.17	5,166,302,793.79
未分配利润	6.4.7.10	6,916,626,423.87	2,859,124,239.06
所有者权益合计		11,737,118,714.04	8,025,427,032.85
负债和所有者权益总计		11,904,101,183.66	8,045,377,046.91

注：1、报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0518 元，基金份额总额 11,159,038,130.30

份。

2、后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

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：华安中小盘成长股票型证券投资基金

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	附注号	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
一、收入		4,567,156,051.14	-8,612,076,471.75
1. 利息收入		19,742,995.71	20,561,696.94
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,485,313.95	6,940,376.00
债券利息收入		14,218,253.20	13,278,938.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		39,428.56	342,382.45
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-2,160,154,709.83	306,412,849.18
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,236,724,686.45	260,894,862.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	16,405,978.49	3,732,650.42
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-49,853,310.40
股利收益	6.4.7.15	60,163,998.13	91,638,646.65
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	6,706,793,221.48	-8,945,592,794.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	774,543.78	6,541,776.23
二、费用（以“-”号填列）		-120,284,294.08	-237,771,299.45
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	-75,288,359.07	-131,187,958.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	-12,548,059.74	-21,864,659.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-32,212,282.87	-81,134,330.30
5. 利息支出		-	-3,349,637.73
其中：卖出回购金融资产支出		-	-3,349,637.73
6. 其他费用	6.4.7.19	-235,592.40	-234,713.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,446,871,757.06	-8,849,847,771.20
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,446,871,757.06	-8,849,847,771.20

注：后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

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：华安中小盘成长股票型证券投资基金

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 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）	5,166,302,793.79	2,859,124,239.06	8,025,427,032.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,446,871,757.06	4,446,871,757.06
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）	-345,810,503.62	-389,369,572.25	-735,180,075.87
其中：1. 基金申购款	183,824,098.44	190,507,842.10	374,331,940.54
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-529,634,602.06	-579,877,414.35	-1,109,512,016.41
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）	4,820,492,290.17	6,916,626,423.87	11,737,118,714.04
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 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）	5,325,438,362.03	14,218,723,370.50	19,544,161,732.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,849,847,771.20	-8,849,847,771.20
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）	71,506,083.06	898,443,133.96	969,949,217.02

列)			
其中：1. 基金申购款	1, 833, 233, 584. 49	4, 529, 202, 188. 21	6, 362, 435, 772. 70
2. 基金赎回款 (以“-”号填列)	-1, 761, 727, 501. 43	-3, 630, 759, 054. 25	-5, 392, 486, 555. 68
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)	5, 396, 944, 445. 09	6, 267, 318, 733. 26	11, 664, 263, 178. 35

注：后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

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

华安中小盘成长股票型证券投资基金是根据原安瑞证券投资基金(以下简称“基金安瑞”)基金份额持有人大会 2007 年 3 月 1 日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并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[2007]81 号《于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安瑞转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金，于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 6 月 30 日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字[2007]21 号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》，原基金安瑞于 2007 年 4 月 9 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 4 月 10 日起，原基金安瑞终止上市，原基金安瑞更名为华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。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。

原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,060,436,162.37 元，已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 4 月 18 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1:2.314909165，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 4 月 16 日开放集中申购，共募集人民币 9,883,484,414.21 元，业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第 11233 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 4 月 18 日基金份额转换后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,883,484,414.21 份基金份额，并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投

资比例为基金资产的60-95%，股票资产中的80%以上投资于中国A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在5%以上。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

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》、《华安中小盘成长股票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。

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 年上半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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年上半年度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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(d) 基金卖出股票按 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	1,030,392,406.40
定期存款	—
其他存款	—
合计	1,030,392,406.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		9,485,058,740.18	10,020,980,423.42	535,921,683.24
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	479,482,720.00	481,516,000.00	2,033,280.00
	合计	479,482,720.00	481,516,000.00	2,033,280.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		9,964,541,460.18	10,502,496,423.42	537,954,963.24

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—	—

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
上交所七天买入返售	300,000,000.00	-
合计	300,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2009 年 6 月 30 日）无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	227,271.87
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	5,158.98
应收债券利息	13,605,347.95
应收买入返售证券利息	39,428.56
应收申购款利息	849.42
其他	31.14
合计	13,878,087.92

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	-

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	10,389,503.44

银行间市场应付交易费用	600.00
合计	10,390,103.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	32,802.58
预提费用	224,143.16
合计	1,006,945.74

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,959,558,350.79	5,166,302,793.79
本期申购	425,537,387.48	183,824,098.44
本期赎回	-1,226,057,607.97	-529,634,602.06
本期末	11,159,038,130.30	4,820,492,290.17

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	5,316,243,341.55	-2,457,119,102.49	2,859,124,239.06
本期利润	-2,259,921,464.42	6,706,793,221.48	4,446,871,757.06
本期基金份额交易产生的变动数	-223,998,290.03	-165,371,282.22	-389,369,572.25
其中：基金申购款	126,758,314.10	63,749,528.00	190,507,842.10
基金赎回款	-350,756,604.13	-229,120,810.22	-579,877,414.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,832,323,587.10	4,084,302,836.77	6,916,626,423.87

6.4.7.11 存款利息收入

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,388,690.14
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	88,391.18

其他	8,232.63
合计	5,485,313.95

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	10,808,188,221.39
卖出股票成本总额	-13,044,912,907.84
买卖股票差价收入	-2,236,724,686.45

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交金额	1,760,101,260.27
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-1,693,862,687.81
应收利息总额	-49,832,593.97
债券投资收益	16,405,978.49

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
卖出权证成交金额	-
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	60,163,998.13
基金投资产生的股利收益	-
合计	60,163,998.13

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	6,706,793,221.48
——股票投资	6,735,223,553.67

——债券投资	-28,430,332.19
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	6,706,793,221.48

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	756,774.22
印花税返还收入	10,150.47
立立电子退市还款利息	7,619.09
合计	774,543.78

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。
2、基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	32,206,182.87
银行间市场交易费用	6,100.00
合计	32,212,282.87

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
审计费用	75,375.64
信息披露费	148,767.52
银行汇划费用	2,449.24
账户维护费	9,000.00
合计	235,592.40

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本基金在本会计期内无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金在本会计期内无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.9.2 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	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

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 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	75,288,359.07	131,187,958.18
其中：当期已支付	61,172,256.42	115,045,064.46
期末未支付	14,116,102.65	16,142,893.72

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 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	12,548,059.74	21,864,659.64
其中：当期已支付	10,195,375.98	19,174,177.36
期末未支付	2,352,683.76	2,690,482.28

注：支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.25% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	84,909,537.53	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：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
期初持有的基金份额	35,419,025.29	24,740,487.76
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	1,809,802.29	9,077,292.18
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	2,349,041.47
期末持有的基金份额	37,228,827.58	31,468,738.47

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.33%	0.25%
-----------------------	-------	-------

注：1、申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

2、基金管理人华安基金管理有限公司在本年度运用自有资金 1,400,000.00 元经代销机构购入本基金 1,809,802.29 份基金份额，申购费合计 8,349.90 元，其申购费率为 0.6%。

3、期间赎回/卖出总份额均为本基金管理人对原安瑞基金份额持有人实施份额激励而减少的份额。

6.4.10.4.2 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内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间内（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5 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 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
中国工商银行股份有限公司	1,030,392,406.40	5,388,690.14	1,454,262,131.33	6,525,597.63

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
中国工商银行股份有限公司	-	-	-	-	-

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

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
-	-	-	-	-	-	-	-

合计	-	-	-	-	-	-	-	-	-
----	---	---	---	---	---	---	---	---	---

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

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600239	云南城投	2009-4-14	预计 2010-4-12	非公开发行	15.18	13.34	5,000,000	75,900,000.00	66,700,000.00
600239	云南城投	2009-6-16	预计 2010-4-12	非公开发行送股转增部分	-	13.34	2,500,000	-	33,350,000.00

6.4.12.2 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
600849	上海医药	2009-6-18	资产重组	12.18	未知	未知	5,500,000	71,977,476.05	66,990,000.00
000400	许继电气	2009-6-5	资产重组	18.28	2009-7-6	20.11	4,850,867	75,192,867.74	88,673,848.76

6.4.12.3 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是积极成长型股票基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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。

6.4.13.2 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同责任，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。

本公司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，因而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，因此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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,030,392,406.40	-	-	-	1,030,392,406.40
结算备付金	16,377,813.78	-	-	-	16,377,813.78
存出保证金	98,780.49	-	-	4,792,932.79	4,891,713.28
交易性金融资产	293,222,000.00	-	188,294,000.00	10,020,980,423.42	10,502,496,423.42
买入返售金融资产	300,000,000.00	-	-	-	300,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	31,613,518.34	31,613,518.34
应收利息	-	-	-	13,878,087.92	13,878,087.92
应收股利	-	-	-	828,630.00	828,630.00

应收申购款	2,332,703.13	-	-	1,289,887.39	3,622,590.52
资产总计	1,642,423,703.80	-	188,294,000.00	10,073,383,479.86	11,904,101,183.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	97,231,975.29	97,231,975.29
应付赎回款	-	-	-	41,884,658.74	41,884,658.74
应付管理人报酬	-	-	-	14,116,102.65	14,116,102.65
应付托管费	-	-	-	2,352,683.76	2,352,683.76
应付交易费用	-	-	-	10,390,103.44	10,390,103.44
其他负债	-	-	-	1,006,945.74	1,006,945.74
负债总计	-	-	-	166,982,469.62	166,982,469.62
利率敏感度缺口	1,642,423,703.80	-	188,294,000.00	9,906,401,010.24	11,737,118,714.04
上年度末 2008 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	250,378,611.84	-	-	-	250,378,611.84
结算备付金	3,469,326.16	-	-	-	3,469,326.16
存出保证金	98,780.49	-	-	2,656,359.38	2,755,139.87
交易性金融资产	532,455,000.00	550,898,000.00	373,075,000.00	6,279,677,923.60	7,736,105,923.60
应收证券清算款	-	-	-	14,109,078.62	14,109,078.62
应收利息	-	-	-	37,044,951.48	37,044,951.48
应收申购款	1,151,209.05	-	-	362,806.29	1,514,015.34
资产总计	787,552,927.54	550,898,000.00	373,075,000.00	6,333,851,119.37	8,045,377,046.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,504,849.37	3,504,849.37
应付管理人报酬	-	-	-	10,851,029.58	10,851,029.58
应付托管费	-	-	-	1,808,504.92	1,808,504.92
应付交易费用	-	-	-	2,873,438.34	2,873,438.34
其他负债	-	-	-	912,191.85	912,191.85
负债总计	-	-	-	19,950,014.06	19,950,014.06
利率敏感度缺口	787,552,927.54	550,898,000.00	373,075,000.00	6,313,901,105.31	8,025,427,032.85

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者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 6 月 30 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 4.10%（2008 年 12 月 31 日：18.15%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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。

本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5% 以上。于 2009 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 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	10,020,980,423.42	85.38	6,279,677,923.60	78.25
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	10,020,980,423.42	85.38	6,279,677,923.60	78.25

6.4.13.4.3.2 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他市场变量保持不变		
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 (2009 年 6 月 30 日)	上年末 (2008 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	增加约 5.96	增加约 3.98
	业绩比较基准下降 5%	下降约 5.95	下降约 3.98

6.4.14 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	10,020,980,423.42	84.18
	其中：股票	10,020,980,423.42	84.18
2	固定收益投资	481,516,000.00	4.04
	其中：债券	481,516,000.00	4.04
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	300,000,000.00	2.52
	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	1,046,770,220.18	8.79
6	其他资产	54,834,540.06	0.46
7	合计	11,904,101,183.66	100.00

7.2 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	8,820,000.00	0.08
B	采掘业	876,223,403.69	7.47
C	制造业	3,824,910,904.78	32.59
C0	食品、饮料	462,469,129.25	3.94
C1	纺织、服装、皮毛	136,430,234.57	1.16
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	35,985,691.80	0.31
C4	石油、化学、塑胶、塑料	390,555,713.12	3.33
C5	电子	25,775,000.00	0.22
C6	金属、非金属	1,100,860,121.09	9.38
C7	机械、设备、仪表	971,385,493.37	8.28
C8	医药、生物制品	701,449,521.58	5.98
C99	其他制造业	—	—

D	电力、煤气及水的生产和供应业	306,731,529.98	2.61
E	建筑业	505,545,968.07	4.31
F	交通运输、仓储业	257,184,236.56	2.19
G	信息技术业	86,263,032.20	0.73
H	批发和零售贸易	389,400,963.51	3.32
I	金融、保险业	1,864,341,251.11	15.88
J	房地产业	1,624,996,357.84	13.84
K	社会服务业	93,332,670.20	0.80
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	183,230,105.48	1.56
	合计	10,020,980,423.42	85.38

7.3 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

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	601166	兴业银行	15,000,000	556,650,000.00	4.74
2	601318	中国平安	7,000,000	346,220,000.00	2.95
3	600585	海螺水泥	7,728,570	325,681,939.80	2.77
4	000402	金融街	23,278,015	320,305,486.40	2.73
5	600383	金地集团	19,240,000	310,148,800.00	2.64
6	000983	西山煤电	9,861,429	294,856,727.10	2.51
7	601186	中国铁建	28,272,076	290,919,662.04	2.48
8	000538	云南白药	8,009,654	280,337,890.00	2.39
9	600325	华发股份	11,441,102	258,454,494.18	2.20
10	600016	民生银行	29,000,000	229,680,000.00	1.96
11	601628	中国人寿	8,222,800	226,538,140.00	1.93
12	000667	名流置业	31,317,901	212,961,726.80	1.81
13	000422	湖北宜化	17,000,000	194,650,000.00	1.66
14	600997	开滦股份	10,000,000	186,900,000.00	1.59
15	000423	东阿阿胶	10,032,076	179,975,443.44	1.53
16	600000	浦发银行	7,789,686	179,318,571.72	1.53
17	601088	中国神华	5,676,129	169,773,018.39	1.45
18	601899	紫金矿业	14,500,000	147,900,000.00	1.26
19	000060	中金岭南	6,840,744	147,007,588.56	1.25
20	601998	中信银行	24,270,837	144,896,896.89	1.23
21	600660	福耀玻璃	17,337,520	142,341,039.20	1.21
22	002202	金风科技	4,500,000	135,540,000.00	1.15
23	600690	青岛海尔	10,007,882	132,704,515.32	1.13
24	000027	深圳能源	10,599,619	118,291,748.04	1.01
25	600066	宇通客车	9,400,000	115,244,000.00	0.98

26	600068	葛洲坝	9,376,485	114,018,057.60	0.97
27	600276	恒瑞医药	3,084,630	107,684,433.30	0.92
28	600067	冠城大通	8,200,000	106,518,000.00	0.91
29	600048	保利地产	3,813,446	106,357,008.94	0.91
30	000651	格力电器	4,835,747	101,067,112.30	0.86
31	600239	云南城投	7,500,000	100,050,000.00	0.85
32	600529	山东药玻	8,170,382	98,779,918.38	0.84
33	600900	长江电力	7,064,548	97,349,471.44	0.83
34	600631	百联股份	7,378,666	96,365,377.96	0.82
35	600519	贵州茅台	649,513	96,134,419.13	0.82
36	000069	华侨城A	4,465,678	93,332,670.20	0.80
37	601390	中国中铁	13,522,717	91,819,248.43	0.78
38	000400	许继电气	4,850,867	88,673,848.76	0.76
39	000858	五粮液	4,334,510	85,519,882.30	0.73
40	600087	长航油运	13,759,079	85,168,699.01	0.73
41	000002	万科A	6,451,574	82,257,568.50	0.70
42	600832	东方明珠	7,500,000	81,975,000.00	0.70
43	600280	南京中商	5,135,513	81,757,366.96	0.70
44	600295	鄂尔多斯	6,623,491	81,270,234.57	0.69
45	600600	青岛啤酒	3,000,000	79,770,000.00	0.68
46	000024	招商地产	2,500,000	79,375,000.00	0.68
47	000709	唐钢股份	10,000,000	78,200,000.00	0.67
48	002052	同洲电子	6,907,870	76,401,042.20	0.65
49	000009	中国宝安	6,175,902	73,246,197.72	0.62
50	000338	潍柴动力	2,000,000	72,860,000.00	0.62
51	000568	泸州老窖	2,500,000	71,750,000.00	0.61
52	601601	中国太保	3,000,000	67,140,000.00	0.57
53	600849	上海医药	5,500,000	66,990,000.00	0.57
54	601939	建设银行	11,000,000	66,330,000.00	0.57
55	600098	广州控股	9,770,817	63,510,310.50	0.54
56	600639	浦东金桥	4,095,690	60,411,427.50	0.51
57	600378	天科股份	6,033,599	59,008,598.22	0.50
58	000950	建峰化工	3,916,018	58,309,508.02	0.50
59	600177	雅戈尔	4,000,000	55,160,000.00	0.47
60	000157	中联重科	2,351,789	52,515,448.37	0.45
61	000088	盐田港	7,000,000	51,590,000.00	0.44
62	600586	金晶科技	3,728,385	50,221,345.95	0.43
63	000895	双汇发展	1,353,850	48,738,600.00	0.42
64	600428	中远航运	4,656,487	48,287,770.19	0.41
65	600837	海通证券	2,891,650	47,567,642.50	0.41
66	000630	铜陵有色	2,104,100	44,165,059.00	0.38

67	000759	武汉中百	4,381,066	42,759,204.16	0.36
68	000528	柳 工	2,511,166	41,785,802.24	0.36
69	600219	南山铝业	4,000,000	41,000,000.00	0.35
70	600282	南钢股份	7,000,000	39,690,000.00	0.34
71	000987	广州友谊	2,000,000	38,960,000.00	0.33
72	600162	香江控股	4,307,192	37,084,923.12	0.32
73	600829	三精制药	2,030,730	36,918,671.40	0.31
74	002191	劲嘉股份	3,250,740	35,985,691.80	0.31
75	600418	江淮汽车	5,994,956	35,070,492.60	0.30
76	600327	大厦股份	3,941,987	35,044,264.43	0.30
77	601919	中国远洋	2,500,000	33,925,000.00	0.29
78	600825	新华传媒	1,842,250	32,792,050.00	0.28
79	600583	海油工程	2,769,540	32,763,658.20	0.28
80	601006	大秦铁路	3,000,000	31,770,000.00	0.27
81	000729	燕京啤酒	2,000,000	30,300,000.00	0.26
82	000959	首钢股份	5,000,000	30,100,000.00	0.26
83	000848	承德露露	1,843,962	29,706,227.82	0.25
84	002032	苏 泊 尔	1,987,512	29,216,426.40	0.25
85	600085	同仁堂	1,700,000	28,305,000.00	0.24
86	000006	深振业 A	2,103,782	27,769,922.40	0.24
87	000826	合加资源	2,500,000	27,600,000.00	0.24
88	600649	城投控股	2,000,000	27,580,000.00	0.23
89	601766	中国南车	5,105,038	27,005,651.02	0.23
90	601898	中煤能源	2,000,000	24,680,000.00	0.21
91	600405	动力源	3,000,000	24,060,000.00	0.20
92	000028	一致药业	1,250,000	23,625,000.00	0.20
93	600875	东方电气	606,408	23,589,271.20	0.20
94	600005	武钢股份	2,904,500	22,887,460.00	0.20
95	600655	豫园商城	1,320,000	22,809,600.00	0.19
96	600415	小商品城	511,884	21,058,907.76	0.18
97	600636	三爱富	2,721,624	20,820,423.60	0.18
98	600195	中牧股份	1,000,000	20,550,000.00	0.18
99	000937	金牛能源	500,000	19,350,000.00	0.16
100	600592	龙溪股份	2,000,000	18,120,000.00	0.15
101	600748	上实发展	1,000,000	17,280,000.00	0.15
102	000061	农 产 品	1,470,000	16,728,600.00	0.14
103	600739	辽宁成大	500,000	16,560,000.00	0.14
104	000755	山西三维	2,000,000	15,560,000.00	0.13
105	600117	西宁特钢	1,443,416	14,650,672.40	0.12
106	600309	烟台万华	926,264	14,607,183.28	0.12
107	600535	天士力	878,406	14,397,074.34	0.12

108	600736	苏州高新	2,000,000	12,540,000.00	0.11
109	600406	国电南瑞	291,000	9,861,990.00	0.08
110	600359	新农开发	1,000,000	8,820,000.00	0.08
111	000758	中色股份	550,000	8,789,000.00	0.07
112	000800	一汽轿车	500,000	7,720,000.00	0.07
113	000816	江淮动力	1,000,000	7,430,000.00	0.06
114	600770	综艺股份	500,000	6,950,000.00	0.06
115	600009	上海机场	419,451	6,442,767.36	0.05
116	002024	苏宁电器	350,000	5,624,500.00	0.05
117	002011	盾安环境	456,454	5,541,351.56	0.05
118	002214	大立科技	100,000	1,715,000.00	0.01
119	600479	千金药业	7,785	134,680.50	0.00

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	601088	中国神华	367,362,930.54	4.58
2	600585	海螺水泥	325,760,391.77	4.06
3	601186	中国铁建	313,685,146.24	3.91
4	601318	中国平安	248,093,767.32	3.09
5	000538	云南白药	245,763,881.04	3.06
6	000983	西山煤电	233,659,155.74	2.91
7	600000	浦发银行	233,560,033.65	2.91
8	600030	中信证券	216,211,401.40	2.69
9	000423	东阿阿胶	202,096,742.12	2.52
10	000402	金融街	201,977,106.27	2.52
11	600837	海通证券	201,215,296.37	2.51
12	000002	万科A	186,464,917.19	2.32
13	600036	招商银行	180,955,198.56	2.25
14	600519	贵州茅台	147,523,910.88	1.84
15	601998	中信银行	145,154,861.77	1.81
16	600016	民生银行	141,182,376.84	1.76
17	601939	建设银行	137,229,053.24	1.71
18	601899	紫金矿业	133,764,891.31	1.67
19	600550	天威保变	130,949,933.66	1.63
20	002007	华兰生物	129,729,174.18	1.62

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	600997	开滦股份	365,023,124.58	4.55
2	600036	招商银行	342,599,634.58	4.27
3	601088	中国神华	341,535,878.37	4.26
4	600015	华夏银行	331,768,780.32	4.13
5	601939	建设银行	296,701,076.85	3.70
6	601166	兴业银行	277,961,353.02	3.46
7	000898	鞍钢股份	275,212,212.46	3.43
8	002024	苏宁电器	258,437,456.01	3.22
9	600030	中信证券	250,237,655.28	3.12
10	600005	武钢股份	223,105,844.53	2.78
11	600900	长江电力	221,530,870.06	2.76
12	000651	格力电器	218,004,833.34	2.72
13	600026	中海发展	201,477,986.03	2.51
14	600383	金地集团	197,083,065.44	2.46
15	000157	中联重科	195,025,214.47	2.43
16	601601	中国太保	192,346,129.73	2.40
17	000001	深发展A	192,156,059.54	2.39
18	600269	赣粤高速	186,269,814.99	2.32
19	600550	天威保变	180,833,563.34	2.25
20	002007	华兰生物	173,764,032.22	2.17
21	600000	浦发银行	171,472,104.96	2.14
22	600837	海通证券	168,490,397.19	2.10

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

买入股票成本（成交）总额	10,050,991,853.99
卖出股票收入（成交）总额	10,808,188,221.39

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	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	381,416,000.00	3.25
3	金融债券	100,100,000.00	0.85
	其中：政策性金融债	100,100,000.00	0.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	481,516,000.00	4.10

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	占基金资产净值比例（%）
1	0801017	08 央票 17	1,000,000	104,590,000.00	0.89
2	040211	04 国开 11	1,000,000	100,100,000.00	0.85
3	0801108	08 央票 108	1,000,000	96,790,000.00	0.82
4	0801020	08 央票 20	800,000	83,704,000.00	0.71
5	0801084	08 央票 84	800,000	77,024,000.00	0.66

7.7 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。

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，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 本基金投资的前十名股票中，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
----	----	----

1	存出保证金	4,891,713.28
2	应收证券清算款	31,613,518.34
3	应收股利	828,630.00
4	应收利息	13,878,087.92
5	应收申购款	3,622,590.52
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	54,834,540.06

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

本基金本报告期末前十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
640,122	17,432.67	337,551,318.50	3.02%	10,821,486,811.80	96.98%

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	367,118.16	0.0033%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 4 月 10 日）基金份额总额	500,000,000.00
报告期期初基金份额总额	11,959,558,350.79
报告期期间基金总申购份额	425,537,387.48
报告期期间基金总赎回份额	1,226,057,607.97
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	11,159,038,130.30

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 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 6 月 25 日，本基金管理人发布关于基金经理调整的公告，聘任沈雪峰女士担任华安中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理，刘光华先生不再担任华安中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理职务。

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	
长城证券有限责任公司	1	603,980,751.23	2.91%	513,381.68	2.95%	
国泰君安证券股份有限公司	1	58,055,861.13	0.28%	47,170.71	0.27%	
上海证券有限责任公司	1	952,581,361.81	4.58%	809,694.86	4.65%	
兴业证券股份有限公司	1	842,371,958.07	4.05%	716,010.39	4.11%	
中国银河证券股份有限公司	1	1,945,659,408.09	9.36%	1,653,802.97	9.49%	
招商证券股份有限公司	1	1,128,934,798.62	5.43%	917,269.89	5.27%	
中银国际证券有限责任公司	1	136,453,712.05	0.66%	110,870.26	0.64%	
国信证券股份有限公司	1	2,917,855,669.20	14.04%	2,480,169.18	14.24%	
联合证券有限责任公司	1	2,026,614,139.23	9.75%	1,646,640.34	9.45%	
中国建银投资证券有限责任公司	2	3,244,865,002.03	15.61%	2,636,472.48	15.14%	
中信证券股份有限公司	1	—	—	—	—	

国金证券股份有限公司	1	1,389,483,849.09	6.69%	1,181,058.07	6.78%	
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	-	-	
中国国际金融有限公司	1	1,111,379,363.41	5.35%	944,652.85	5.42%	
国都证券有限责任公司	1	3,710,972,404.21	17.86%	3,154,309.71	18.11%	
东北证券股份有限公司	1	577,391,785.83	2.78%	490,782.46	2.82%	
齐鲁证券有限公司	1	137,268,881.38	0.66%	116,676.82	0.67%	

券商名称	交易单元数量	回购交易		备注
		成交金额	占当期回购成交总额的比例	
长城证券有限责任公司	1	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	
上海证券有限责任公司	1	-	-	
兴业证券股份有限公司	1	-	-	
中国银河证券股份有限公司	1	300,000,000.00	100%	
招商证券股份有限公司	1	-	-	
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	
国信证券股份有限公司	1	-	-	
联合证券有限责任公司	1	-	-	
中国建银投资证券有限责任公司	2	-	-	
中信证券股份有限公司	1	-	-	
国金证券股份有限公司	1	-	-	
北京高华证券有限责任公司	1	-	-	
中国国际金融有限公司	1	-	-	
国都证券有限责任公司	1	-	-	
东北证券股份有限公司	1	-	-	
齐鲁证券有限公司	1	-	-	

注：1、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。

2、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。

3、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

新增齐鲁证券有限公司上海交易单元1个。

10.8 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、公司网站	[2009-1-6]
2	关于恢复旗下基金持有的“盐湖钾肥”股	上海证券报、证券时报、	[2009-1-6]

	票进行市价估值的公告	中国证券报、公司网站	
3	关于参加深圳发展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、公司网站	[2009-1-9]
4	关于新增东海证券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、公司网站	[2009-1-9]
5	关于参加中国光大银行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、公司网站	[2009-1-20]
6	关于基金电子直销推出中国农业银行金穗卡持有人定期定额申购业务及相关交易费率调整的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-1-21]
7	关于新增江南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、公司网站	[2009-1-21]
8	关于新增上海农村商业银行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、公司网站	[2009-2-5]
9	关于提请投资者及时更新身份证明文件的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-2-14]
10	关于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、公司网站	[2009-2-25]
11	关于参加中国工商银行股份有限公司基智定投业务的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-2-26]
12	关于新增国金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、公司网站	[2009-3-26]
13	关于在山西证券股份有限公司开通旗下基金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、公司网站	[2009-3-26]
14	关于开通电子直销平台后端定期定额投资业务及调低旗下开放式基金定期定额投资申购金额下限的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-3-31]
15	关于参加中国工商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、公司网站	[2009-3-31]

16	关于旗下基金投资云南城投（600239）非公开发行股票的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-4-16]
17	关于新增天相投资顾问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、公司网站	[2009-5-7]
18	关于电子直销平台开通“华安-建行 e 付通”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、公司网站	[2009-5-15]
19	关于恢复旗下基金持有的“长江电力”股票进行市价估值的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-5-19]
20	关于在中国银行开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-5-20]
21	关于新增爱建证券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、公司网站	[2009-6-2]
22	关于新增临商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、公司网站	[2009-6-9]
23	关于参加兴业银行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、公司网站	[2009-6-10]
24	关于电子直销平台开通“定期不定额”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、公司网站	[2009-7-1]
25	关于新增华夏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、公司网站	[2009-7-8]
26	关于电子直销平台“华安—民生银基通”基金电子交易业务升级的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-7-20]
27	关于参加华夏银行网上银行基金申购费率优惠活动和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、公司网站	[2009-7-21]
28	关于在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-7-23]
29	关于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、公司网站	[2009-8-3]

30	关于在渤海证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-8-6]
31	关于在华夏银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-8-6]
32	关于运用自有资金进行开放式基金投资的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-8-20]
33	关于新增中国国际金融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、公司网站	[2009-8-22]

§ 11 备查文件目录

- 1、《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》
- 4、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；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、上述文件的存放地点和查阅方式如下：

存放地点：基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

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

华安基金管理有限公司
2009 年 8 月 28 日