

华安中小盘成长股票型证券投资基金

2007 年半年度报告

（原安瑞证券投资基金转型）

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
签发日期：二〇〇七年八月二十八日

一、	重要提示	4
二、	基金产品概况	4
	(一)、 基金概况	4
	(二)、 基金的投资	5
	(三)、 基金管理人	6
	(四)、 基金托管人	6
	(五)、 信息披露	6
	(六)、 其他有关资料	7
三、	主要财务指标和基金净值表现	7
	(一)、 主要财务指标（未经审计）	7
	(二)、 净值表现	7
四、	管理人报告	10
	(一)、 基金管理人及基金经理简介	10
	(二)、 基金运作合规性声明	10
	(三)、 基金经理工作报告	10
五、	托管人报告	12
六、	华安成长财务会计报告（未经审计）	13
	(一)、 资产负债表	13
	(二)、 经营业绩表	14
	(三)、 收益分配表	15
	(四)、 净值变动表	15
	(五)、 会计报表附注	15
七、	基金安瑞财务会计报告（未经审计）	25
	(一)、 资产负债表	25
	(二)、 经营业绩表	26
	(三)、 收益分配表	27
	(四)、 净值变动表	27
	(五)、 会计报表附注	27
八、	华安成长投资组合报告	32
	(一)、 基金资产组合	33
	(二)、 股票投资组合	33
	(三)、 股票明细	33
	(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动	36
	(五)、 债券投资组合	37
	(六)、 基金投资前五名债券明细	38
	(七)、 权证投资组合	38
	(八)、 资产支持证券投资组合	38
	(九)、 投资组合报告附注	38
九、	基金安瑞投资组合报告	39
	(一)、 基金资产组合	39
	(二)、 股票投资组合	39
	(三)、 股票明细	40
	(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动	41
	(五)、 债券投资组合	42
	(六)、 基金投资前五名债券明细	42

(七)、	权证投资组合	43
(八)、	资产支持证券投资组合	43
(九)、	投资组合报告附注	43
十、	基金份额持有人户数和持有人结构.....	44
(一)、	2007 年 6 月 30 日华安成长基金份额持有人户数和持有人结构	44
(二)、	2007 年 4 月 9 日基金安瑞基金份额持有人户数和持有人结构	44
(三)、	2007 年 4 月 9 日基金安瑞前十名持有人	45
十一、	开放式基金份额变动	45
十二、	重大事件	45
十三、	备查文件目录	50

一、重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本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 2007 年 8 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料未经审计。

2007 年 3 月 1 日,华安中小盘成长股票型证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过,并于 2007 年 3 月 23 日获中国证监会《关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》(证监基金字[2007]81 号)核准。自 2007 年 4 月 10 日起,安瑞证券投资基金在上海证券交易所终止上市,由《安瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。

本报告会计期为 2007 年 1 月 1 日起至 2007 年 6 月 30 日止。自 2007 年 4 月 10 日安瑞证券投资基金终止上市之日起,原安瑞证券投资基金基金名称变更为华安中小盘成长股票型证券投资基金。原安瑞证券投资基金报告期自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止,华安中小盘成长股票型证券投资基金报告期自 2007 年 4 月 10 日起至 2007 年 6 月 30 日止。

二、基金产品概况

(一)、基金概况

1. 华安成长基金概况

基金名称:	华安中小盘成长股票型证券投资基金
基金简称:	华安成长
交易代码:	040007
深交所行情代码:	160407
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
期末基金份额总额:	17,798,067,264.76 份
基金存续期:	不定期

2. 基金安瑞基金概况

基金名称:	安瑞证券投资基金
基金简称:	基金安瑞
交易代码:	500013
基金运作方式:	契约型封闭式
基金合同生效日:	本基金由金龙基金、沈阳万利基金、沈阳富民基金清理规范后合并而成。 2000 年 7 月 18 日华安基金管理有限公司开始管理基金安瑞。
期末基金份额总额:	5 亿份
基金存续期:	15 年(1992 年 4 月 29 日至 2007 年 4 月 9 日)
基金上市地点:	上海证券交易所
基金上市日期:	2001 年 8 月 30 日

(二)、 基金的投资

1. 华安成长基金的投资

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:	$40\% \times \text{天相中盘成长指数} + 40\% \times \text{天相小盘成长指数} + 20\% \times \text{中债-国债总指数}$
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. 基金安瑞基金的投资

投资目标:	本基金投资于小型上市公司, 即公司市值低于市场平均市值的上市公司。投资目标是发掘小型上市公司中的投资机会, 通过积极的投资策略, 获取长期的资本增值。
投资策略:	本基金为小市值基金, 本基金的主要投资方向是小型上市公司, 指投资时上市公司的总市值或流通市值低于市场平均水平。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%, 其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的 20-50%, 股票资产的

比例控制在 40-80%，现金比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，70%投资于合同规定的小市值股票，30%投资于包括新股在内的其他上市公司股票，在此基础上各自上下浮动 10%。当投资的股票市值因价格上涨等因素高于市场平均水平的 50%时，将作为非小市值股票进行统计。

业绩比较基准：无
风险收益特征：无

(三)、 基金管理人

基金管理人：华安基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼
(邮政编码：200120)
办公地址：上海市浦东南路360号新上海国际大厦2楼、37楼、38楼
(邮政编码：200120)
法定代表人：王成明
总经理：俞妙根
信息披露负责人：冯颖
联系电话：021-38969999
传真：021-68863414
电子邮箱：fengying@huaan.com.cn
客户服务热线：40088-50099

(四)、 基金托管人

基金托管人：中国工商银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码：100032
法定代表人：姜建清
信息披露负责人：蒋松云
联系电话：010-66106720
传真：010-66106904
电子邮箱：songyun.jiang@icbc.com.cn

(五)、 信息披露

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

(六)、 其他有关资料

1. 华安成长其他有关资料

登记注册机构： 华安基金管理有限公司
办公地点： 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2. 基金安瑞其他有关资料

登记注册机构： 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司
办公地点： 上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

三、 主要财务指标和基金净值表现

(一)、 主要财务指标（未经审计）

财务指标	转型后（2007 年 4 月 10 日 至 2007 年 6 月 30 日止期间）	转型前（2007 年 1 月 1 日 至 2007 年 4 月 9 日止期间）
基金本期净收益	500,836,218.01	323,359,919.38
基金份额本期净收益	0.0428	0.6467
期末可供分配基金收益	5,824,417,411.24	325,228,312.58
期末可供分配基金份额收益	0.3272	0.6505
期末基金资产净值	20,413,976,527.24	1,060,436,162.37
期末基金份额净值	1.1470	2.1209
基金加权平均净值收益率	3.84%	32.83%
本期基金份额净值增长率	25.19%	43.64%
基金份额累计净值增长率	25.19%	194.85%

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

(二)、 净值表现

1. 华安成长净值表现

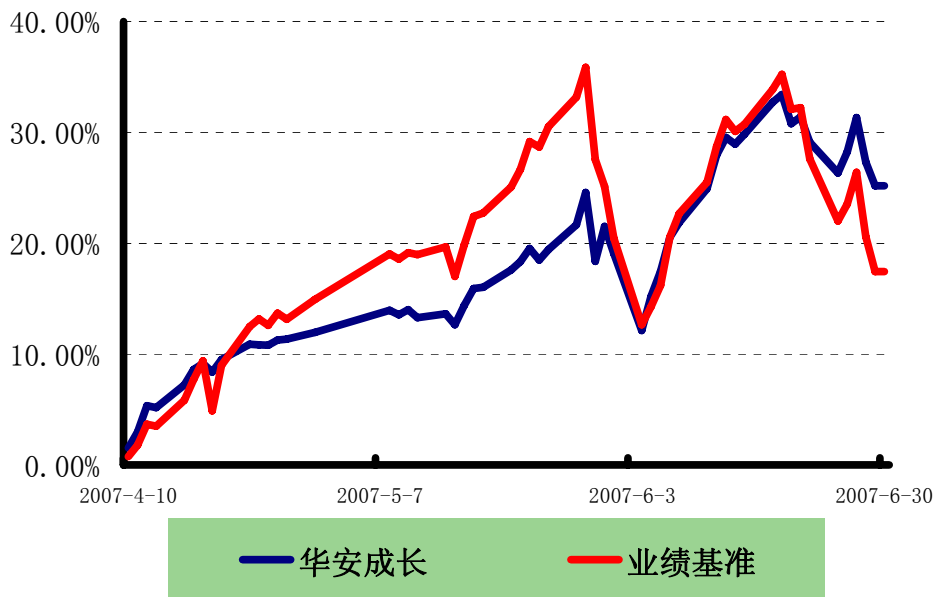
A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值 增长率①	净值增长	业绩比较	业绩比较基	①—③	②—④
		率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
自基金合同 生效起至今	25.19%	1.79%	17.44%	2.32%	7.75%	-0.53%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

华安成长份额累计净值增长率和业绩比较基准收益率历史走势对比图
2007/4/10---2007/6/30



1、根据中国证监会《关于实施基金份额拆分后调整基金建仓期有关问题的复函》中“因基金规模短期内快速增长而导致证券投资比例低于基金合同的约定时，证券投资比例的调整期从 10 个交易日延长至三个月”的规定，经与华安中小盘成长股票型证券投资基金的托管人中国工商银行协商同意，华安中小盘成长股票型证券投资基金自基金集中申购结束之日起 3 个月为投资比例调整期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同的规定。

2、2007 年 3 月 1 日，华安中小盘成长股票型证券投资基金转型获基金份额持有人大会决议通过，并于 2007 年 3 月 23 日获中国证监会《关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》（证监基金字[2007]81 号）核准。自 2007 年 4 月 10 日起，安瑞证券投资基金在上海证券交易所终止上市，由《安瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。

3、2007 年 4 月 18 日，华安基金管理有限公司对投资者持有的原安瑞证券投资基金进行了基金份额折算。经基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，基金份额折算基准日（2007 年 4 月 18 日）折算前基金份额净值为 2.3149 元，精确到小数点后第 9 位为 2.314909165 元（第 9 位以后舍去），华安基金管理有限公司按照 1: 2.314909165 的折算比例将原基金安瑞的基金份额进行了折算。折算后，基金份额净值转换为 1.0000 元，相应地，原基金安瑞每 1 份基金份额折算为 2.314909165 份，基金份额计算结果四舍五入保留小数点后两位。原基金安瑞的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各原基金安瑞份额持有人的基金份额进行了计算，并由注册登记机构进行投资者相应基金份额的登记确认。

2. 基金安瑞净值表现

A、历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

阶段	净值 增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
2007年4月1日至 2007年4月9日	5.89%	2.72%	-	-	-	-
2007年1月1日至 2007年4月9日	43.64%	3.77%	-	-	-	-
2006年7月1日至 2007年4月9日	81.08%	3.19%	-	-	-	-
2004年7月1日至 2007年4月9日	165.14%	2.86%	-	-	-	-
2002年7月1日至 2007年4月9日	136.43%	2.51%	-	-	-	-
自基金合同生效起 至2007年4月9日	194.85%	2.17%	-	-	-	-

备注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

基金安瑞份额累计净值增长率历史走势图
2000/7/18--2007/4/9



— 基金安瑞

四、 管理人报告

(一)、 基金管理人及基金经理简介

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托投资有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海广电（集团）有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至 2007 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺、基金安久 3 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、180ETF、华安成长、华安宏利、华安国际配置等 8 只开放式基金，管理人民币资产规模达到 604.36 亿元、美元资产 1.88 亿美元。

刘光华 先生：MBA，10 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、上证 180ETF 基金经理。现任华安中小盘成长基金经理、华安 MSCI 中国 A 股指数基金经理。

(二)、 基金运作合规性声明

本报告期间，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。

(三)、 基金经理工作报告

(1) 行情回顾

07 年上半年，A 股市场出现了较大幅度的上涨。其中沪深 300 指数的半年涨幅为 84.42%，同期天相中盘成长指数上涨 103.28%，天相小盘成长指数上涨 120.38%。

今年上半年，实体经济继续保持平稳快速增长。从已经公布的一、二季度 GDP 增长数据看，宏观经济仍处在上升通道。而且，经济总量的快速增长能较好地转化为企业盈利能力的上升。今年 1-5 月，全国规模以上工业实现利润 9026 亿元，增长 42.1%，同比加快 16.6 个百分点。

虽然上市公司的中报尚未披露完毕，根据已公布中报公司及业绩预告的信息，投资者普遍对中期净利润增长持乐观判断。我们认为，推动今年 A 股上涨的最根本因素是企业盈利超预期增长。当然，这也得到了其他方面的支撑，如人民币加速升值、流动性继续宽裕、自千点以来股市上涨的赚钱效应所引发的资金正

循环等。

(2) 操作回顾

本基金在今年上半年的运作分为两个阶段。自 1 月 1 日至 4 月 9 日，封转开之前的安瑞基金净值增长了 43.64%，期间实施了一次分红，每份额分配 0.39 元。这段期间，安瑞基金的净值涨幅，在全部封闭式基金中排第二名。

4 月 10 日，安瑞基金退市，华安中小盘成长基金成立。4 月 16 日，本基金实施集中申购。4 月 18 日，为原安瑞基金持有人的份额折算日，折算后基金的单位净值为 1 元。自 4 月 10 日至 4 月 18 日，华安成长的净值增长了 9.15%。4 月 19 日开始，集中申购的资金与原安瑞转型而来的资金合并运作。截止 6 月底，本基金的单位净值为 1.147 元。自 4 月 10 日至 6 月底，华安成长基金的净值增长率为 25.19%，同期比较基准增长了 17.44%。整个上半年，本基金两个阶段的复合净值增长率为 79.83%。

从安瑞基金到华安中小盘成长基金，是一次巨大的转变。在此，我们要特别感谢支持安瑞实施封转开的所有投资者。转变为华安成长基金后，我们面临的挑战是如何管理好过百亿元的基金。第二季度的建仓期间，基金经理在公司投研团队的支持下，采取了稳步加仓的策略。六月份市场的大幅波动，则给了我们难得的买入潜力品种的机会。

截止 6 月底，本基金的股票仓位为 72.01%，建仓工作基本完成。

(3) 展望

除 6 月份单月外，今年前 7 个月沪深 300 指数均是上涨的，且有 4 个月的涨幅超过了 10%。不可否认的是，市场在大幅上涨后，要找到估值合理、具有安全边际的品种越来越难。根据天相系统的统计，8 月初沪深 300 指数成份股的市盈率，以总股本加权约为 35 倍，以流通股加权则超过了 40 倍。

我们认为，在这样的估值水平下，只有业绩具有持续成长性的行业和个股才能获得超越指数的回报。展望下半年，我们将关注银行、钢铁、机械、运输等行业的投资机会。以成长性、持续性为选股的依据，争取通过自身的努力，实现华安成长基金业绩平稳增长，来回报广大的基金持有人对我们的信任和支持。

五、 托管人报告

2007 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、安瑞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。

2007 年上半年，华安中小盘成长股票型证券投资基金、安瑞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、安瑞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。

本托管人依法对华安基金管理有限公司在 2007 年上半年所编制和披露的华安中小盘成长股票型证券投资基金、安瑞证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007 年 8 月 24 日

六、华安成长财务会计报告（未经审计）

（一）、资产负债表

二零零七年六月三十日

单位：人民币元

项 目	附注	2007年6月30日
资产：		
银行存款		5,968,838,348.31
清算备付金		62,270,341.23
交易保证金		1,536,292.13
应收证券清算款		0.00
应收股利		887,038.50
应收利息	9(1)	1,696,091.56
应收申购款		0.00
其他应收款		0.00
股票投资市值		14,699,789,889.96
其中：股票投资成本		13,277,160,417.78
债券投资市值		0.00
其中：债券投资成本		0.00
权证投资市值		260,258,520.00
其中：权证投资成本		222,479,760.79
买入返售债券		0.00
待摊费用		0.00
其他资产		0.00
资产合计		20,995,276,521.69
负债：		
应付证券清算款		471,988,813.01
应付赎回款		69,281,505.76
应付赎回费		261,111.46
应付管理人报酬		21,456,220.70
应付托管费		3,576,036.78
应付佣金	9(3)	14,289,548.29
应付利息		0.00
应付收益		0.00
未交税金		0.00
其他应付款	9(4)	250,000.00
卖出回购证券款		0.00
短期借款		0.00

预提费用	9(5)	196,758.45
其他负债		0.00
负债合计		581,299,994.45

所有者权益：

实收基金	9(6)	7,688,424,031.56
未实现利得	9(7)	6,901,135,084.44
未分配收益		5,824,417,411.24
持有人权益合计		20,413,976,527.24
负债和所有者权益合计		20,995,276,521.69

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、 经营业绩表

自二零零七年四月十日至二零零七年六月三十日止期间
单位：人民币元

项 目	附注	2007年4月10日至 2007年6月30日止期间
收入：		
股票差价收入	9(8)	479,850,438.37
债券差价收入	9(9)	1,348,172.55
权证差价收入	9(10)	3,897,811.14
债券利息收入		72,018.58
存款利息收入		10,008,012.33
股利收入		54,390,593.04
买入返售证券收入		0.00
其他收入	9(11)	1,984,070.84
收入合计		551,551,116.85
费用：		
基金管理人报酬		43,386,906.48
基金托管费		7,231,151.09
卖出回购证券支出		13,278.00
利息支出		0.00
其他费用	9(12)	83,563.27
其中：信息披露费		53,918.28
上市年费		0.00
审计费用		27,744.70
费用合计		50,714,898.84
基金净收益		500,836,218.01
加：未实现估值增值变动数		1,225,200,381.60
基金经营业绩		1,726,036,599.61

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、 收益分配表

自二零零七年四月十日至二零零七年六月三十日止期间
单位：人民币元

项 目	附注	2007年4月10日至 2007年6月30日止期间
本期基金净收益		500,836,218.01
加：期初未分配收益		325,228,312.58
加：本期损益平准金		4,998,352,880.65
可供分配基金净收益		5,824,417,411.24
减：本期已分配基金净收益		0.00
期末基金未分配净收益		5,824,417,411.24

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、 净值变动表

自二零零七年四月十日至二零零七年六月三十日止期间
单位：人民币元

项 目	附注	2007年4月10日至 2007年6月30日止期间
一、期初基金净值		1,060,436,162.37
二、本期经营活动：		
基金净收益		500,836,218.01
未实现估值增值变动数		1,225,200,381.60
经营活动产生的基金净值变动数		1,726,036,599.61
三、本期基金单位交易：		
基金申购款		19,214,751,195.72
基金赎回款		-1,587,247,430.46
基金单位交易产生的基金净值变动数		17,627,503,765.26
四、本期向持有人分配收益		0.00
五、期末基金净值		20,413,976,527.24

所附附注为本会计报表的组成部分

(五)、 会计报表附注

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制，会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会于2005年7月1日起颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半

年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第 4 号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

3. 基金的基本情况

募集申请的核准机构：中国证券监督管理委员会

核准文号：证监基金字[2007]81 号

核准文件名称：《关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》

基金运作方式：契约型开放式

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

基金合同生效日：2007 年 4 月 10 日

基金合同生效日的基金份额：500,000,000.00 份

基金集中申购期间：2007 年 4 月 16 日

基金集中申购募集资金总额：9,883,484,414.21 元

基金集中申购募集资金的银行存款利息（折算为投资者的基金份额）：0.00 份

基金份额拆分的情况：2007 年 4 月 18 日，华安基金管理有限公司对投资者持有的原安瑞证券投资基金进行了基金份额折算。经基金托管人中国工商银行股份有限公司确认，基金份额折算基准日（2007 年 4 月 18 日）折算前基金份额净值为 2.3149 元，精确到小数点后第 9 位为 2.314909165 元（第 9 位以后舍去），华安基金管理有限公司按照 1：2.314909165 的折算比例将原基金安瑞的基金份额进行了折算。折算后，基金份额净值转换为 1.0000 元，相应地，原基金安瑞每 1 份基金份额折算为 2.314909165 份，基金份额计算结果四舍五入保留小数点后两位。原基金安瑞的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例，对各原基金安瑞份额持有人的基金份额进行了计算，并由注册登记机构进行投资者相应基金份额的登记确认。

验资机构名称：上海立信长江会计师事务所

4. 基本会计假设

本半年度会计报表的编制遵守基本会计假设。

5. 主要会计政策、会计估计及其变更

(1) 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按照企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、《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会计报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

(2) 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。

(3) 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

(4) 记账基础和计价原则

本基金的记账基础为权责发生制。除股票投资、债券投资和权证投资按市值计价外，所有报表项目均以历史成本计价。

(5) 基金资产的估值原则

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票，按成本估值；由于配股和非定向增发形成的暂时流通受限制的股票，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值。

证券交易所市场实行净价交易的国债按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价估值。证券交易所市场未实行净价交易的企业债券及可转换债券按估值日市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值；估值日无交易的，以最近交易日的市场交易收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价估值。银行间同业市场交易的债券和未上市流通的债券按成本估值。

从获赠确认日或买入成交日起到卖出成交日或行权日止，上市交易的权证投资按估值日在证券交易所挂牌的该权证投资的市场交易收盘价估值；未上市交易的权证投资(包括配股权证)按公允价值估值。

实际投资成本与估值的差异计入“未实现利得/(损失)”科目。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

(6) 证券投资基金成本计价方法

① 股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。收到股权分置改革过程中由非流通股股东支付的现金对价，于股权分置方案实施复牌日冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入/(损失)。出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

② 债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资；买入银行间同业市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账，其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本。

买入贴息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入/(损失)；卖出银行间同业市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入/(损失)。出售债券的成本按移动加权平均法结转。

③ 权证投资

获赠权证(包括配股权证)在确认日，按持有的股数及获赠比例计算并记录增

加的权证数量；买入权证于成交日确认为权证投资，相应成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出权证于成交日确认权证差价收入/(损失)，出售权证的成本按移动加权平均法于成交日结转。

(7) 待摊费用、预付费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用核算已经发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应分摊计入本期和以后各期的费用，如信息披露费、审计费用和律师费用等，待摊费用在实际发生时入账，在受益期内平均摊销。

预提费用核算预计将发生的、影响基金份额净值小数点后第五位，应预提计入本期的费用，如信息披露费、审计费用和律师费用等，预提费用在预计发生时入账。

(8) 收入/(损失)的确认和计量

股票差价收入/(损失)于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

证券交易所交易的债券差价收入/(损失)于卖出成交日确认；银行间同业市场交易的债券差价收入/(损失)于实际收到全部价款时确认。债券差价收入/(损失)按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

权证差价收入/(损失)于卖出权证成交日按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认。债券利息收入在债券实际持有期内逐日计提。

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

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

买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在证券持有期内采用直线法逐日计提。

(9) 费用的确认和计量

本基金的管理费按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率逐日计提。

本基金的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

(10) 实收基金

实收基金的数量为对外发行的基金份额总额。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。

基金份额拆分于拆分日按拆分前的基金份额数及拆分比例，计算增加的基金份额数，在实收基金科目的数量栏记录。

(11) 未实现利得/(损失)

未实现利得/(损失)包括因投资估值而产生的未实现估值增值/(减值)和未实

现利得/(损失)平准金。

未实现利得/(损失)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未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现利得/(损失)平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

(12) 损益平准金

损益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未分配基金净收益/(累计基金净损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配基金净收益/(累计基金净损失)。

(13) 基金的收益分配原则

1、在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最多为四次,每次基金收益分配比例不低于可分配收益的 50%,若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

2、本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者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;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

3、基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;

4、基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配;

5、基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

6、每一基金份额享有同等分配权;

7、法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

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

(15)会计政策、会计估计变更的内容、理由、影响数或影响数不能合理确定的理由:无。

(16)重大会计差错的内容和更正金额:无。

6. 税项

根据财政部、国家税务总局财税字(2002)128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字(2004)78文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税(2005)11号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》、财税(2005)102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税(2005)103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

1、以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

2、基金买卖股票、债券的差价收入,自 2004 年 1 月 1 日起继续免征营业税。

3、基金买卖股票、债券的差价收入,自 2004 年 1 月 1 日起继续免征企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入以及企业债券的利息收入,由上市公司和发行债券的企业在向基金派发股息、红利、利息时代扣代缴 20%的个人所

得税，暂不征收企业所得税。自 2005 年 6 月 13 日，对个人投资者从上市公司取得的股息红利所得，暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定计征个人所得税，基金投资者参照前述规定。

4、根据财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》，自 2007 年 5 月 30 日起，证券交易印花税率由 1% 调整为 3%。

5、基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到的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。

7. 资产负债表日后事项

无。

8. 关联方关系和关联方交易

(1). 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

关联人	关系	交易性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金管理人	提取管理费	基金合同
	注册登记机构	持有本基金	
	基金销售机构		
中国工商银行股份有限公司	基金托管人	提取托管费	基金合同
	基金代销机构		
上海国际信托投资有限公司	基金管理人股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人股东		
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人股东		

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(2). 通过关联方席位进行的交易

①本报告期(2007 年 4 月 10 日至 2007 年 6 月 30 日止期间)本基金没有通过上述关联方席位进行股票、债券、回购和权证交易。

②本报告期(2007 年 4 月 10 日至 2007 年 6 月 30 日止期间)与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况：无。

(3). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

本基金在本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 6 月 30 日止期间）需支付基金管理费 43,386,906.48 元。

② 基金托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 2.5‰ 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

本基金在本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 6 月 30 日止期间）需支付基金托管费 7,231,151.09 元。

③ 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计算。基金托管人于 2007 年 6 月 30 日保管的银行存款余额为 5,968,838,348.31 元。本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 6 月 30 日止期间）由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 9,306,143.96 元。

(4). 基金各关联方投资本基金的情况

1、基金管理公司投资本基金的情况：

本报告期间（2007 年 4 月 10 日至 2007 年 6 月 30 日止期间）基金管理公司投资本基金的情况：

关联人	2007 年 4 月 9 日		买入	卖出	基金拆分 增加份额	2007 年 6 月 30 日		适用 费率
	持有份额	持有比例				持有份额	持有比例	
华安基金管理 有限公司	6,318,119	1.26%	—	—	8,307,751.68	14,625,870.68	0.08%	—

2、基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况：无。

9. 基金会计报表重要项目的说明

(1). 应收利息明细：

2007 年 6 月 30 日

明细项目

银行存款利息	1,603,246.99
清算备付金利息	25,259.49
申购款利息	67,585.08

合计	1,696,091.56
(2). 投资估值增值明细:	2007年6月30日
明细项目	
股票估值增值余额	1,422,629,472.18
债券估值增值余额	0.00
权证估值增值余额	37,778,759.21
合计	1,460,408,231.39
(3). 应付佣金明细:	2007年6月30日
明细项目	
长城证券有限责任公司	773,284.68
中银国际证券有限责任公司	769,547.15
国泰君安证券股份有限公司	3,762,078.05
上海证券有限责任公司	2,232,263.09
兴业证券股份有限公司	487,470.81
中国银河证券有限责任公司	2,691,432.71
招商证券股份有限公司	497,189.79
西部证券股份有限公司	3,076,282.01
合计	14,289,548.29
(4). 其他应付款明细:	2007年6月30日
券商代垫交易保证金	250,000.00
(5). 预提费用明细:	2007年6月30日
明细项目	
信息披露费	119,013.75
审计费用	77,744.70
合计	196,758.45
(6). 实收基金变动明细:	2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
期初基金份额总额	500,000,000.00
加: 本期申购基金份额总额	18,730,534,741.51
其中: 基金拆分折算份额总额	657,454,582.58
申购份额总额	18,073,080,158.93
减: 本期赎回基金份额总额	1,432,467,476.75
期末基金份额总额	17,798,067,264.76

(7). 未实现利得明细:	2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
期初未实现利得	235,207,849.79
其中: 投资估值增值数	235,207,849.79
未实现利得平准金	0.00
本期投资估值增值发生数	1,225,200,381.60
本期申购的未实现利得平准金	5,956,931,121.82
本期赎回的未实现利得平准金	516,204,268.77
期末未实现利得	6,901,135,084.44
其中: 投资估值增值数	1,460,408,231.39
未实现利得平准金	5,440,726,853.05
 (8). 卖出股票:	 2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
卖出股票成交总额	2,050,404,406.61
减: 佣金	1,715,450.75
成本总额	1,568,838,517.49
股票差价收入	479,850,438.37
 (9). 卖出债券:	 2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
卖出债券成交总额	216,810,883.82
减: 成本总额	211,716,698.66
应收利息总额	3,746,012.61
债券差价收入	1,348,172.55
 (10). 卖出权证:	 2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
卖出权证成交总额	11,276,366.20
减: 佣金	0.00
成本总额	7,378,555.06
权证差价收入	3,897,811.14

(11). 其他收入:	2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
赎回费收入	1,984,070.84
合计	1,984,070.84

(12). 其他费用:	2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
信息披露费	53,918.28
审计费用	27,744.70
交易所费用	92.50
划款费用	1,707.79
其他费用	100.00
合计	83,563.27

(13). 基金收益分配: 无。

(14). 因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价情况	2007年4月10日至 2007年6月30日
明细项目	
股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额	0.00

10. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票如下:

本基金截至2007年6月30日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	数量	总成本	总市值	期末估值单价	转让受限原因	停牌日	复牌日	复牌日开盘价格
000728	S京化二	100,000	571,050.09	1,336,000.00	13.36	股权分置改革停牌	2007-3-27	未知	未知
合计			571,050.09	1,336,000.00					

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

股票名称	数量	总成本	总市值	期末估值单价	转让受限原因	受限期限
交通银行	11,803,000	93,243,700.00	129,714,970.00	10.99	网下新股未上市	至2007年8月15日
中国远洋	2,997,000	25,414,560.00	54,725,220.00	18.26	网下新股未上市	至2007年9月25日
中信银行	9,518,000	55,204,400.00	87,565,600.00	9.20	网下新股未上市	至2007年7月27日
安纳达	14,784	119,454.72	337,223.04	22.81	网下新股未上市	至2007年8月29日
实益达	25,390	261,517.00	1,198,154.10	47.19	网下新股未上市	至2007年9月12日
顺络电子	19,675	267,580.00	675,049.25	34.31	网下新股未上市	至2007年9月12日
拓邦电子	17,838	186,942.24	1,070,280.00	60.00	网下新股未上市	至2007年9月28日
合计		174,698,153.96	275,286,496.39			

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

七、基金安瑞财务会计报告（未经审计）

（一）、资产负债表

二零零七年四月九日

单位：人民币元

项 目	附注	2007年4月9日	2006年12月31日
资产：			
银行存款		98,124,045.19	63,229,737.13
清算备付金		5,789,255.31	4,091,842.11
交易保证金		1,536,292.13	598,780.49
应收证券清算款		0.00	9,996,265.73
应收股利		0.00	0.00
应收利息	4(1)	3,743,391.16	1,786,538.52
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		819,410,344.29	657,864,561.29
其中：股票投资成本		589,237,368.32	474,710,601.27
债券投资市值		208,710,577.56	180,249,649.30
其中：债券投资成本		208,667,698.66	179,719,601.13
权证投资市值		26,110,489.61	397,761.00
其中：权证投资成本		21,118,494.69	198,728.15
买入返售债券		0.00	0.00
待摊费用		0.00	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		1,163,424,395.25	918,215,135.57

负债：

应付证券清算款		0.00	34,719,025.43
应付管理人报酬		404,552.72	1,042,079.26
应付托管费		67,425.46	173,679.90
应付佣金	4(3)	2,042,939.23	1,228,916.74
应付利息		38,220.00	0.00

应付收益		0.00	0.00
未交税金		0.00	0.00
其他应付款	4(4)	250,000.00	250,000.00
卖出回购证券款		100,000,000.00	0.00
短期借款		0.00	0.00
预提费用	4(5)	185,095.47	50,000.00
其他负债		0.00	0.00
负债合计		102,988,232.88	37,463,701.33

所有者权益：

实收基金	4(6)	500,000,000.00	500,000,000.00
未实现利得	4(7)	235,207,849.79	183,883,041.04
未分配收益		325,228,312.58	196,868,393.20
持有人权益合计		1,060,436,162.37	880,751,434.24
负债和所有者权益合计		1,163,424,395.25	918,215,135.57

所附附注为本会计报表的组成部分

(二)、 经营业绩表

自二零零七年一月一日至二零零七年四月九日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月1日至 2007年4月9日止期间	2006年1月1日至 2006年6月30日止期间
收入：			
股票差价收入	4(8)	326,182,868.18	110,550,500.84
债券差价收入	4(9)	125,357.26	-291,833.53
权证差价收入	4(10)	1,646,249.22	2,030,506.48
债券利息收入		1,744,628.84	1,642,823.95
存款利息收入		224,050.69	72,537.93
股利收入		179,299.93	5,526,693.33
买入返售证券收入		0.00	0.00
其他收入		0.00	0.00
收入合计		330,102,454.12	119,531,229.00
费用：			
基金管理人报酬		4,378,236.53	4,110,731.66
基金托管费		729,706.11	685,121.89
卖出回购证券支出		878,417.86	59,904.37
利息支出		0.00	0.00
其他费用	4(11)	756,174.24	184,257.65
其中：上市年费		20,000.00	29,752.78
信息披露费		65,095.47	119,012.93
审计费用		50,000.00	24,795.19
费用合计		6,742,534.74	5,040,015.57

基金净收益	323,359,919.38	114,491,213.43
加：未实现估值增值变动数	51,324,808.75	120,658,754.42
基金经营业绩	374,684,728.13	235,149,967.85

所附附注为本会计报表的组成部分

(三)、 收益分配表

自二零零七年一月一日至二零零七年四月九日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月1日至	2006年1月1日至
		2007年4月9日止期间	2006年6月30日止期间
本期基金净收益		323,359,919.38	114,491,213.43
加：期初未分配收益		196,868,393.20	-54,288,471.12
可供分配基金净收益		520,228,312.58	60,202,742.31
减：本期已分配基金净收益	4(12)	195,000,000.00	0.00
期末基金未分配净收益		325,228,312.58	60,202,742.31

所附附注为本会计报表的组成部分

(四)、 净值变动表

自二零零七年一月一日至二零零七年四月九日止期间

单位：人民币元

项 目	附注	2007年1月1日至	2006年1月1日至
		2007年4月9日止期间	2006年6月30日止期间
一、期初基金净值		880,751,434.24	463,476,899.59
二、本期经营活动：			
基金净收益		323,359,919.38	114,491,213.43
未实现估值增值变动数		51,324,808.75	120,658,754.42
经营活动产生的基金净值变动数		374,684,728.13	235,149,967.85
三、本期向持有人分配收益		195,000,000.00	0.00
四、期末基金净值		1,060,436,162.37	698,626,867.44

所附附注为本会计报表的组成部分

(五)、 会计报表附注

本基金的会计报表按《证券投资基金会计核算办法》编制，会计报表披露的方式则是根据中国证券监督管理委员会于2005年7月1日起颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、证券投资基金信息披露内容与格式准则第3号《半年度报告的内容与格式》、证券投资基金信息披露编报规则第3号《会计报表附注的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第4号《基金投资组合报告的编制及披露》进行编制及披露。

1. 主要会计政策、会计估计及其变更

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一致。

2. 重大会计差错的内容和更正金额

无。

3. 关联方关系和关联方交易

(4). 关联人、关系、交易性质及法律依据列示

关联人	关系	交易性质	法律依据
华安基金管理有限公司	基金管理人 基金发起人	提取管理费、 持有本基金	基金合同
中国工商银行股份有限公司	基金托管人	提取托管费	基金合同
上海国际信托投资有限公司	基金管理人股东		
上海电气(集团)总公司	基金管理人股东		
上海广电(集团)有限公司	基金管理人股东		
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人股东		
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人股东		

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

(5). 通过关联方席位进行的交易

①本报告期(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)本基金通过关联人席位的股票、债券、回购和权证成交量:无。

上年度的上半年本基金通过关联人席位的股票、债券、回购和权证成交量:无。

②本报告期(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)本基金没有与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易。

上年度的上半年本基金没有与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(6). 关联方报酬

① 基金管理人的报酬

本基金应支付基金管理人管理费,按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,本基金成立三个月后,若持有现金比例超过本基金资产净值的20%,超过部分不计提基金管理费。计算方法如下:

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H为每日应支付的管理费

E为前一日的基金资产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

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

本基金在本报告期间(2007年1月1日至2007年4月9日止期间)需支付

基金管理费 4,378,236.53 元。(上年度的上半年: 4,110,731.66 元)

② 基金托管费

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

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

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

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

本基金在本报告期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间)需支付基金托管费 729,706.11 元。(上年度的上半年: 685,121.89 元)

③ 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管,按银行同业利率计息。基金托管人于 2007 年 4 月 9 日保管的银行存款余额为 98,124,045.19 元,2006 年 6 月 30 日为 14,156,672.26 元。本基金在本报告期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间)由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为 193,387.17 元,(上年度的上半年: 60,315.62 元)。

(4). 基金各关联方投资本基金的情况

1、基金管理公司投资本基金的情况:

本报告期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间)基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	期初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例 (%)			持有份额	持有比例 (%)	
华安基金管理有限公司	6,318,119	1.26%	—	—	6,318,119	1.26%	—

2006 年上半年基金管理公司投资本基金的情况:

关联人	期初数		买入	卖出	期末数		适用费率
	持有份额	持有比例			持有份额	持有比例	
华安基金管理有限公司	6,318,119	1.26%	0.00	0.00	6,318,119	1.26%	—

2、基金管理公司主要股东及其控制的机构投资本基金的情况: 无。

4. 基金会计报表重要项目的说明

(1). 应收利息明细:

2007 年 4 月 9 日

明细项目

银行存款利息	62,599.63
清算备付金利息	6,797.50

债券利息	3,673,994.03
合计	3,743,391.16
(2). 投资估值增值明细:	2007 年 4 月 9 日
明细项目	
股票估值增值余额	230,172,975.97
债券估值增值余额	42,878.90
权证估值增值余额	4,991,994.92
合计	235,207,849.79
(3). 应付佣金明细:	2007 年 4 月 9 日
明细项目	
长城证券有限责任公司	128,262.73
国泰君安证券股份有限公司	997,731.96
上海证券有限责任公司	247,386.38
兴业证券股份有限公司	131,050.35
中国银河证券有限责任公司	256,849.34
招商证券股份有限公司	281,658.47
合计	2,042,939.23
(4). 其他应付款明细:	2007 年 4 月 9 日
券商代垫交易保证金	250,000.00
(5). 预提费用明细:	2007 年 4 月 9 日
明细项目	
信息披露费	65,095.47
上市年费	20,000.00
审计费用	100,000.00
合计	185,095.47
(6). 实收基金变动明细:	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间
明细项目	
期初数	500,000,000.00
期末数	500,000,000.00
(7). 未实现利得明细:	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止期间

明细项目	
期初未实现利得:	183,883,041.04
其中: 投资估值增值数:	183,883,041.04
本期投资估值增值发生数:	51,324,808.75
期末未实现利得:	235,207,849.79
其中: 投资估值增值数:	235,207,849.79
(8). 卖出股票:	2007年1月1日至2007年4月9日止期间
明细项目	
卖出股票成交总额	1,014,069,438.96
减: 佣金	842,762.31
成本总额	687,043,808.47
股票差价收入	326,182,868.18
(9). 卖出债券:	2007年1月1日至2007年4月9日止期间
明细项目	
卖出债券成交总额	77,640,746.26
减: 成本总额	76,531,500.02
应收利息总额	983,888.98
债券差价收入	125,357.26
(10). 卖出权证:	2007年1月1日至2007年4月9日止期间
明细项目	
卖出权证成交总额	8,021,610.91
减: 佣金	0.00
成本总额	6,375,361.69
权证差价收入	1,646,249.22
(11). 其他费用:	2007年1月1日至2007年4月9日止期间
明细项目	
上市年费	20,000.00
信息披露费	65,095.47
审计费用	50,000.00

账户维护费	9,810.00
持有人大会费用	17,400.00
分红手续费	585,000.00
交易所费用	6,678.40
银行间费用	1,190.37
其他费用	1,000.00
合计	756,174.24

(12). 基金收益分配:

分红公告日	权益登记日	除息日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配金额	
本期第1次分红	2007-3-28	2007-4-2	2007-4-3	3.90元	195,000,000.00

(13). 因股权分置改革而获得非流通股股东 2007年1月1日至2007年4月9日
支付的现金对价情况 日止期间

明细项目

股权分置现金对价对股票投资成本的累计影响金额	0.00
------------------------	------

5. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票如下:

本基金截至2007年4月9日止持有以下因股权分置改革而暂时停牌的股票,这些股票将在上市公司完成与流通股股东的沟通协商程序后或在股权分置改革规定的程序结束后复牌。

股票代码	股票名称	数量	总成本	总市值	期末估值单价	转让受限原因	停牌日	复牌日	复牌日开盘价格
000728	S京化二	100,000	571,050.09	1,336,000.00	13.36	股权分置改革停牌	2007-3-27	未知	未知
合 计			571,050.09	1,336,000.00					

(2)、本基金截止本报告期末流通受限债券如下:

债券名称	数量(张)	总成本	总市值	期末估值单价	转让受限原因	受限期限
07武钢债	20,660	1,601,606.44	1,698,369.76	82.2057	新债未上市	至2007年4月16日

八、华安成长投资组合报告

报告期自 2007年4月10日起至6月30日止

(一)、 基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	14,699,789,889.96	70.01%
2	债券	0.00	0.00%
3	权证	260,258,520.00	1.24%
4	银行存款和清算备付金合计	6,031,108,689.54	28.73%
5	其他资产	4,119,422.19	0.02%
	合计	20,995,276,521.69	100.00%

(二)、 股票投资组合

	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	98,348,533.96	0.48%
B	采掘业	703,880,970.47	3.45%
C	制造业	7,403,696,495.51	36.27%
	C0 食品、饮料	253,311,699.16	1.24%
	C3 造纸、印刷	184,597,228.36	0.90%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	1,087,292,310.06	5.33%
	C5 电子	323,410,350.56	1.58%
	C6 金属、非金属	2,814,161,413.04	13.79%
	C7 机械、设备、仪表	2,161,196,730.27	10.59%
	C8 医药、生物制品	522,419,283.26	2.56%
	C99 其他制造业	57,307,480.80	0.28%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	219,741,873.00	1.08%
E	建筑业	166,103,152.40	0.81%
F	交通运输、仓储业	1,907,641,779.42	9.34%
G	信息技术业	414,401,555.27	2.03%
H	批发和零售贸易	381,477,649.84	1.87%
I	金融、保险业	2,170,693,767.55	10.63%
J	房地产业	959,665,669.76	4.70%
K	社会服务业	274,138,442.78	1.34%
	合计	14,699,789,889.96	72.01%

(三)、 股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	市值(元)	占资产净值比例
1	601166	兴业银行	28,977,000	1,016,802,930.00	4.98%
2	000157	中联重科	13,472,147	518,677,659.50	2.54%
3	600383	金地集团	15,131,089	517,785,865.58	2.54%
4	600660	福耀玻璃	16,502,549	503,657,795.48	2.47%
5	600786	东方锅炉	7,569,137	476,704,248.26	2.34%
6	600026	中海发展	18,604,537	427,532,260.26	2.09%

7	600219	南山铝业	18,033,300	409,175,577.00	2.00%
8	000039	中集集团	13,650,000	400,218,000.00	1.96%
9	600849	上海医药	21,771,002	377,726,884.70	1.85%
10	000422	湖北宜化	26,866,600	372,371,076.00	1.82%
11	601006	大秦铁路	22,722,221	344,014,425.94	1.69%
12	600019	宝钢股份	27,500,000	302,500,000.00	1.48%
13	000983	西山煤电	10,491,671	296,179,872.33	1.45%
14	600036	招商银行	11,725,041	288,201,507.78	1.41%
15	600009	上海机场	7,000,000	266,070,000.00	1.30%
16	600428	中远航运	12,033,197	263,406,682.33	1.29%
17	000088	盐田港	15,277,092	256,502,374.68	1.26%
18	600066	宇通客车	9,384,949	255,646,010.76	1.25%
19	600309	烟台万华	4,224,704	226,275,146.24	1.11%
20	601628	中国人寿	5,500,000	226,105,000.00	1.11%
21	000651	格力电器	6,209,500	216,711,550.00	1.06%
22	600016	民生银行	18,780,000	214,655,400.00	1.05%
23	600282	南钢股份	15,571,928	207,729,519.52	1.02%
24	600000	浦发银行	5,675,003	207,648,359.77	1.02%
25	600997	开滦股份	9,053,185	199,170,070.00	0.98%
26	600308	华泰股份	7,507,004	184,597,228.36	0.90%
27	000402	金融街	6,256,046	181,425,334.00	0.89%
28	600519	贵州茅台	1,508,056	180,484,142.08	0.88%
29	000612	焦作万方	6,438,550	173,647,693.50	0.85%
30	600123	兰花科创	5,636,667	168,649,076.64	0.83%
31	000731	四川美丰	10,070,697	168,382,053.84	0.82%
32	000878	云南铜业	4,800,000	165,600,000.00	0.81%
33	000401	冀东水泥	10,500,860	144,491,833.60	0.71%
34	000898	鞍钢股份	8,100,000	143,289,000.00	0.70%
35	000060	中金岭南	4,817,873	141,163,678.90	0.69%
36	600271	航天信息	3,097,293	137,302,998.69	0.67%
37	600331	宏达股份	2,782,566	134,815,322.70	0.66%
38	600350	山东高速	17,420,674	133,442,362.84	0.65%
39	601328	交通银行	11,803,000	129,714,970.00	0.64%
40	600631	百联股份	7,284,388	122,304,874.52	0.60%
41	000667	名流置业	10,656,796	118,397,003.56	0.58%
42	600406	国电南瑞	3,909,033	117,857,344.95	0.58%
43	600741	巴士股份	12,084,028	117,577,592.44	0.58%
44	600725	云维股份	5,219,450	114,984,483.50	0.56%
45	000823	超声电子	12,983,387	112,046,629.81	0.55%
46	000002	万科A	5,800,000	110,896,000.00	0.54%
47	000022	深赤湾A	4,136,961	109,422,618.45	0.54%
48	002021	中捷股份	8,828,532	105,059,530.80	0.51%

49	600491	龙元建设	10,072,330	103,543,552.40	0.51%
50	000338	潍柴动力	1,305,221	102,459,848.50	0.50%
51	600327	大厦股份	9,007,336	99,080,696.00	0.49%
52	600598	北大荒	11,100,286	98,348,533.96	0.48%
53	600557	康缘药业	6,377,012	97,950,904.32	0.48%
54	000063	中兴通讯	1,800,000	97,920,000.00	0.48%
55	600269	赣粤高速	7,009,933	97,227,770.71	0.48%
56	600808	马钢股份	14,386,786	96,679,201.92	0.47%
57	600900	长江电力	6,000,000	90,720,000.00	0.44%
58	601998	中信银行	9,518,000	87,565,600.00	0.43%
59	600280	南京中商	4,655,663	82,684,574.88	0.41%
60	000625	长安汽车	4,906,331	80,856,334.88	0.40%
61	600580	卧龙电气	8,087,608	79,986,443.12	0.39%
62	600887	伊利股份	2,337,213	72,827,557.08	0.36%
63	600060	海信电器	6,963,697	71,099,346.37	0.35%
64	600261	浙江阳光	4,203,676	69,024,359.92	0.34%
65	600761	安徽合力	2,391,136	68,147,376.00	0.33%
66	601919	中国远洋	3,428,000	62,595,280.00	0.31%
67	600561	江西长运	6,021,185	59,790,367.05	0.29%
68	002094	青岛金王	2,837,004	57,307,480.80	0.28%
69	600795	国电电力	4,000,000	52,480,000.00	0.26%
70	000825	太钢不锈	2,600,000	52,156,000.00	0.26%
71	600379	S宝光	3,298,109	50,527,029.88	0.25%
72	000661	长春高新	3,628,998	46,741,494.24	0.23%
73	600546	中油化建	3,308,000	44,988,800.00	0.22%
74	600410	华胜天成	2,197,233	43,065,766.80	0.21%
75	002088	鲁阳股份	1,204,150	40,146,361.00	0.20%
76	000528	柳工	1,490,426	36,515,437.00	0.18%
77	600290	华仪电气	773,913	35,654,171.91	0.17%
78	600655	豫园商城	1,349,474	35,113,313.48	0.17%
79	600642	申能股份	2,500,000	34,975,000.00	0.17%
80	600131	岷江水电	4,923,839	34,466,873.00	0.17%
81	002092	中泰化学	1,650,000	33,132,000.00	0.16%
82	000680	山推股份	2,082,640	32,864,059.20	0.16%
83	600325	华发股份	1,027,414	31,161,466.62	0.15%
84	600550	天威保变	1,091,118	29,798,432.58	0.15%
85	600563	法拉电子	1,450,481	27,138,499.51	0.13%
86	000978	桂林旅游	1,302,450	23,118,487.50	0.11%
87	000759	武汉中百	1,696,582	23,073,515.20	0.11%
88	601699	潞安环能	550,000	22,478,500.00	0.11%
89	600787	中储股份	2,000,000	21,080,000.00	0.10%
90	002054	德美化工	1,175,583	20,960,644.89	0.10%

91	000709	唐钢股份	1,552,954	19,846,752.12	0.10%
92	600824	益民百货	1,764,984	19,220,675.76	0.09%
93	600089	特变电工	600,000	18,450,000.00	0.09%
94	600266	北京城建	620,000	17,570,800.00	0.09%
95	600489	中金黄金	370,050	17,403,451.50	0.09%
96	002049	晶源电子	1,435,690	16,711,431.60	0.08%
97	002025	航天电器	600,000	15,954,000.00	0.08%
98	600973	宝胜股份	575,593	15,719,444.83	0.08%
99	000617	石油济柴	500,000	15,500,000.00	0.08%
100	600150	中国船舶	106,692	14,749,102.08	0.07%
101	600581	八一钢铁	2,000,000	13,860,000.00	0.07%
102	600596	新安股份	319,370	13,793,590.30	0.07%
103	600875	东方电机	214,535	13,704,495.80	0.07%
104	002106	莱宝高科	260,000	7,802,600.00	0.04%
105	002039	黔源电力	500,000	7,100,000.00	0.03%
106	000837	秦川发展	350,000	4,907,000.00	0.02%
107	600072	江南重工	300,000	4,278,000.00	0.02%
108	600845	宝信软件	100,000	2,536,000.00	0.01%
109	002139	拓邦电子	29,338	1,760,280.00	0.01%
110	000728	S 京化二	100,000	1,336,000.00	0.01%
111	002137	实益达	25,390	1,198,154.10	0.01%
112	000619	海螺型材	76,095	904,769.55	0.00%
113	002138	顺络电子	19,675	675,049.25	0.00%
114	002136	安纳达	14,784	337,223.04	0.00%

(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

1、 累计买入、 累计卖出价值超出期末基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值的比例
1	601166	兴业银行	931,468,119.71	4.56%
2	600383	金地集团	509,926,782.32	2.50%
3	000157	中联重科	469,634,895.98	2.30%
4	600019	宝钢股份	427,737,411.38	2.10%
5	000422	湖北宜化	407,141,626.52	1.99%
6	600660	福耀玻璃	393,575,356.90	1.93%
7	600026	中海发展	389,277,912.02	1.91%
8	600849	上海医药	365,844,935.03	1.79%
9	600786	东方锅炉	358,825,757.87	1.76%
10	601006	大秦铁路	345,923,574.82	1.69%
11	600219	南山铝业	318,948,210.08	1.56%

12	000039	中集集团	318,397,726.01	1.56%
13	000088	盐田港	285,327,210.60	1.40%
14	600036	招商银行	247,967,854.19	1.21%
15	600428	中远航运	242,293,428.87	1.19%
16	000612	焦作万方	237,656,490.03	1.16%
17	000651	格力电器	234,907,667.61	1.15%
18	000983	西山煤电	228,425,972.66	1.12%
19	600282	南钢股份	228,171,227.41	1.12%
20	600009	上海机场	219,609,585.17	1.08%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值的比例
1	600383	金地集团	164,717,204.60	0.81%
2	000612	焦作万方	145,322,201.29	0.71%
3	600900	长江电力	124,488,062.33	0.61%
4	000157	中联重科	112,862,438.25	0.55%
5	600019	宝钢股份	106,330,926.58	0.52%
6	600642	申能股份	100,367,114.07	0.49%
7	600312	平高电气	90,383,410.16	0.44%
8	000829	天音控股	84,810,447.07	0.42%
9	000651	格力电器	84,245,570.93	0.41%
10	600331	宏达股份	76,762,027.47	0.38%
11	600649	原水股份	72,031,808.59	0.35%
12	000878	云南铜业	61,705,581.81	0.30%
13	601166	兴业银行	58,213,100.18	0.29%
14	600028	中国石化	39,156,153.33	0.19%
15	000422	湖北宜化	37,242,750.72	0.18%
16	601998	中信银行	36,699,208.68	0.18%
17	600009	上海机场	36,398,504.88	0.18%
18	600266	北京城建	29,675,955.57	0.15%
19	000709	唐钢股份	26,947,961.01	0.13%
20	002094	青岛金王	26,754,144.84	0.13%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本总额：	14,256,761,566.95
卖出股票的收入总额：	2,050,404,406.61

(五)、 债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资。

(六)、 基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末无债券投资。

(七)、 权证投资组合

1、 基金投资前五名权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	市值(元)	占资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	5,573,550	178,353,600.00	0.87%
2	580009	伊利 CWB1	3,560,000	81,904,920.00	0.40%

(八)、 资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、 投资组合报告附注

1、 本基金的估值方法

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

2、 本报告期内需说明的证券投资决策程序

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

本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、 其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	1,437,511.64
2	上海权证担保金	50,000.00
3	深圳权证担保金	48,780.49
4	应收股利	887,038.50
5	应收利息	1,696,091.56
	合计	4,119,422.19

4、 处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	成本总额(元)	获得途径
1	580009	伊利 CWB1	3,260,000	75,272,491.95	主动投资
2	030002	五粮 YGC1	5,073,550	133,467,329.21	主动投资
3	038010	赤湾 NSP1	2,239,870	0	深赤湾免费派发

6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下：

	基金份额
2007年4月9日	6,318,119.00 份
基金拆分增加份额	8,307,751.68 份
本期买入	—
本期卖出	—
2007年6月30日	14,625,870.68 份

九、基金安瑞投资组合报告

报告期自 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 4 月 9 日止

(一)、基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占总资产比例
1	股票	819,410,344.29	70.43%
2	债券	208,710,577.56	17.94%
3	权证	26,110,489.61	2.24%
4	银行存款和清算备付金合计	103,913,300.50	8.93%
5	其他资产	5,279,683.29	0.45%
	合计	1,163,424,395.25	100.00%

(二)、股票投资组合

	行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	50,547,603.34	4.77%
B	采掘业	53,928,110.50	5.09%
C	制造业	534,445,674.25	50.40%
	C0 食品、饮料	12,404,206.12	1.17%
	C4 石油、化学、塑胶、塑料	118,917,153.10	11.21%
	C5 电子	81,539,495.00	7.69%
	C6 金属、非金属	112,967,894.62	10.65%
	C7 机械、设备、仪表	172,980,473.01	16.31%
	C8 医药、生物制品	7,626,022.40	0.72%
	C99 其他制造业	28,010,430.00	2.64%

D	电力、煤气及水的生产和供应业	21,806,500.00	2.06%
E	建筑业	5,526,927.34	0.52%
F	交通运输、仓储业	73,749,539.16	6.95%
H	批发和零售贸易	5,246,500.00	0.49%
I	金融、保险业	43,525,500.00	4.10%
J	房地产业	15,885,738.70	1.50%
K	社会服务业	14,748,251.00	1.39%
	合计	819,410,344.29	77.27%

(三)、股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	市值(元)	占资产净值比例
1	002021	中捷股份	5,400,000	77,382,000.00	7.30%
2	000829	天音控股	2,609,582	50,547,603.34	4.77%
3	600309	烟台万华	1,300,000	45,812,000.00	4.32%
4	600786	东方锅炉	766,413	34,205,012.19	3.23%
5	600428	中远航运	1,600,000	30,560,000.00	2.88%
6	600123	兰花科创	1,210,000	29,705,500.00	2.80%
7	002049	晶源电子	1,885,690	29,586,476.10	2.79%
8	002094	青岛金王	1,619,100	28,010,430.00	2.64%
9	000401	冀东水泥	3,082,032	27,892,389.60	2.63%
10	600009	上海机场	900,000	25,524,000.00	2.41%
11	002025	航天电器	900,000	25,236,000.00	2.38%
12	002092	中泰化学	1,550,000	23,482,500.00	2.21%
13	600016	民生银行	1,800,000	22,068,000.00	2.08%
14	600028	中国石化	2,100,000	21,546,000.00	2.03%
15	600000	浦发银行	750,000	21,457,500.00	2.02%
16	000731	四川美丰	1,350,000	20,790,000.00	1.96%
17	600005	武钢股份	2,089,900	20,648,212.00	1.95%
18	000878	云南铜业	1,050,000	20,590,500.00	1.94%
19	000060	中金岭南	700,000	19,572,000.00	1.85%
20	000410	沈阳机床	800,000	15,560,000.00	1.47%
21	600725	云维股份	1,057,735	14,850,599.40	1.40%
22	000548	湖南投资	1,360,300	14,378,371.00	1.36%
23	000612	焦作万方	853,707	13,539,793.02	1.28%
24	600323	南海发展	950,000	13,518,500.00	1.27%
25	600495	晋西车轴	548,056	13,482,177.60	1.27%
26	600379	S宝光	870,407	12,586,085.22	1.19%
27	600600	青岛啤酒	662,972	12,404,206.12	1.17%
28	600261	浙江阳光	600,000	12,096,000.00	1.14%
29	600089	特变电工	600,000	11,904,000.00	1.12%
30	600219	南山铝业	650,000	10,725,000.00	1.01%

31	601006	大秦铁路	700,000	9,751,000.00	0.92%
32	000667	名流置业	854,094	9,437,738.70	0.89%
33	600131	岷江水电	800,000	8,288,000.00	0.78%
34	600561	江西长运	834,867	7,914,539.16	0.75%
35	002106	莱宝高科	200,000	7,772,000.00	0.73%
36	600557	康缘药业	501,712	7,626,022.40	0.72%
37	600563	法拉电子	413,838	6,849,018.90	0.65%
38	600596	新安股份	222,470	6,832,053.70	0.64%
39	600748	上实发展	400,000	6,448,000.00	0.61%
40	600331	宏达股份	200,000	5,814,000.00	0.55%
41	600491	龙元建设	503,822	5,526,927.34	0.52%
42	600153	建发股份	350,000	5,246,500.00	0.49%
43	000837	秦川发展	350,000	4,812,500.00	0.45%
44	600550	天威保变	59,330	2,705,448.00	0.26%
45	600489	中金黄金	70,050	2,676,610.50	0.25%
46	000728	S 京化二	100,000	1,336,000.00	0.13%
47	601007	金陵饭店	28,000	369,880.00	0.03%
48	002122	天马股份	5,000	343,250.00	0.03%

(四)、 报告期内股票投资组合的重大变动

1、 累计买入、 累计卖出价值超出期初基金资产净值 2%或前二十名的股票明细

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值的比例
1	600309	烟台万华	51,131,962.46	5.81%
2	600059	古越龙山	42,033,687.80	4.77%
3	600016	民生银行	33,332,008.34	3.78%
4	000800	一汽轿车	32,136,263.71	3.65%
5	600786	东方锅炉	32,111,342.11	3.65%
6	000401	冀东水泥	26,722,647.05	3.03%
7	000768	西飞国际	25,715,888.18	2.92%
8	002092	中泰化学	23,851,376.61	2.71%
9	002094	青岛金王	23,723,242.50	2.69%
10	000690	宝新能源	21,833,425.78	2.48%
11	600005	武钢股份	21,644,978.36	2.46%
12	000731	四川美丰	19,672,169.22	2.23%
13	600000	浦发银行	19,199,370.49	2.18%
14	000060	中金岭南	18,975,749.50	2.15%
15	600428	中远航运	17,559,330.01	1.99%
16	600600	青岛啤酒	17,239,214.25	1.96%
17	601166	兴业银行	15,066,629.08	1.71%

18	002106	莱宝高科	14,852,432.81	1.69%
19	600596	新安股份	14,483,238.08	1.64%
20	000548	湖南投资	13,934,579.87	1.58%

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值的比例
1	000933	神火股份	67,080,304.27	7.62%
2	000157	中联重科	54,164,135.61	6.15%
3	600059	古越龙山	46,281,060.43	5.25%
4	600875	东方电机	45,810,431.61	5.20%
5	600428	中远航运	39,981,229.11	4.54%
6	000690	宝新能源	39,192,309.73	4.45%
7	002028	思源电气	37,816,087.90	4.29%
8	000800	一汽轿车	36,439,276.92	4.14%
9	002021	中捷股份	34,145,862.21	3.88%
10	600019	宝钢股份	32,742,241.66	3.72%
11	000625	长安汽车	29,282,270.88	3.32%
12	002025	航天电器	29,209,232.31	3.32%
13	600009	上海机场	29,079,586.03	3.30%
14	000768	西飞国际	28,862,019.72	3.28%
15	600153	建发股份	24,889,019.65	2.83%
16	000858	五粮液	24,662,560.92	2.80%
17	600219	南山铝业	22,474,690.19	2.55%
18	000410	沈阳机床	20,720,793.11	2.35%
19	601166	兴业银行	18,548,818.94	2.11%
20	600519	贵州茅台	14,256,589.12	1.62%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

买入股票的成本总额:	801,570,575.52
卖出股票的收入总额:	1,014,069,438.96

(五)、 债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占资产净值比例
1	国家债券	171,902,207.80	16.21%
2	金融债券	35,110,000.00	3.31%
3	企业债券	1,698,369.76	0.16%
	合计	208,710,577.56	19.68%

(六)、 基金投资前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
----	------	------	---------	-------	---------

1	010214	02 国债(14)	596,460	59,771,256.60	5.64%
2	010103	21 国债(3)	437,490	44,120,866.50	4.16%
3	010115	21 国债(15)	377,600	37,922,368.00	3.58%
4	010010	20 国债(10)	257,090	25,829,832.30	2.44%
5	050404	05 农发 04	250,000	24,990,000.00	2.36%

(七)、权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	市值(元)	占资产净值比例
1	030002	五粮 YGC1	500,000	10,966,500.00	1.03%
2	580005	万华 HXB1	230,000	8,944,470.00	0.84%
3	580009	伊利 CWB1	300,000	5,701,200.00	0.54%
4	580013	武钢 CWB1	200,402	498,319.61	0.05%

(八)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期内未投资资产支持证券。

(九)、投资组合报告附注

1、本基金的估值方法

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

2、本报告期内需说明的证券投资决策程序

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

本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

3、其他资产的构成

序号	其他资产	金额(元)
1	深圳结算保证金	1,437,511.64
2	上海权证担保金	50,000.00
3	深圳权证担保金	48,780.49
4	应收利息	3,743,391.16
	合计	5,279,683.29

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例(%)
-	-	-	-	-	-

5、整个报告期内获得的权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量	成本总额(元)	获得途径
1	580005	万华 HXB1	320,000	9,619,702.96	主动投资
2	580009	伊利 CWB1	300,000	5,475,434.67	主动投资
3	030002	五粮 YGC1	710,000	11,735,597.04	主动投资
4	580013	武钢 CWB1	200,402	464,393.56	投资 07 武钢债获赠

6、基金管理公司运用固有资金投资基金情况

华安基金管理有限公司在本报告期内投资本基金的持有份额和变化情况如下：

	基金份额
2006年12月31日	6,318,119.00 份
本期买入	-
本期卖出	-
2007年4月9日	6,318,119.00 份

十、基金份额持有人户数和持有人结构

(一)、2007年6月30日华安成长基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	1,007,809 户	
平均每户持有基金份额	17,660.16 份	
项目	份额(份)	占总份额的比例
机构投资者持有的基金份额	553,496,691.23	3.11%
个人投资者持有的基金份额	17,244,570,573.53	96.89%
其中：		
本公司员工持有的基金份额	41,310.53	0.00%

(二)、2007年4月9日基金安瑞基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数	20,369 户	
平均每户持有基金份额	24,547 份	
项目	份额(份)	占总份额的比例
机构投资者持有的基金份额	320,146,031.00	64.03%
个人投资者持有的基金份额	179,853,969.00	35.97%

(三)、 2007 年 4 月 9 日基金安瑞前十名持有人

序号	项目	份额(份)	占总份额的比例
1	中国人寿保险(集团)公司	49,042,797.00	9.81%
2	中国人寿保险股份有限公司	45,453,575.00	9.09%
3	新华人寿保险股份有限公司	44,049,784.00	8.81%
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司	24,263,617.00	4.85%
5	宋伟铭	17,770,000.00	3.55%
6	泰康人寿保险股份有限公司	15,758,131.00	3.15%
7	国际金融一建行一中金股票策略集合资产管理计划	14,982,889.00	3.00%
8	中信信托投资有限责任公司一财富二号信托产品	14,728,771.00	2.95%
9	中国太平洋保险公司	13,689,178.00	2.74%
10	招商证券股份有限公司一招商银行股份有限公司一招商证券基金宝集合资产管理计划	12,900,000.00	2.58%

十一、开放式基金份额变动

序号	项目	份额(份)
1	基金合同生效日的基金份额总额	500,000,000.00
2	期初基金份额总额	500,000,000.00
3	加:本期申购基金份额总额	18,730,534,741.51
4	其中:基金拆分折算份额总额	657,454,582.58
5	申购份额总额	18,073,080,158.93
6	减:本期赎回基金份额总额	1,432,467,476.75
7	期末基金份额总额	17,798,067,264.76

十二、重大事件

(一)、基金份额持有人大会决议:

本基金管理人于 2007 年 1 月 25 日,发布安瑞证券投资基金召开基金份额持有人大会公告,提请审议《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》。

本基金管理人于 2007 年 3 月 2 日,发布关于安瑞证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告,《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》获全票通过。

本基金管理人于 2007 年 3 月 28 日,发布关于安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告,中国证券监督管理委员会于 2007 年 3 月 23 日下发了《关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》(证监基金字【2007】81 号),同意安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议生效。

(二)、基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

1、本基金管理人重大人事变动如下:

本基金管理人于 2007 年 3 月 14 日,发布由于林义将先生因个人原因提出辞职,经华安基金管理公司董事会审议批准,由刘光华先生担任安瑞证券投资基金的基金经理,林义将先生不再担任安瑞证券投资基金的基金经理。

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

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

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

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:无。

(三)、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼:无。

(四)、基金投资策略的改变:无。

(五)、基金收益分配事项:

1、安瑞基金本报告期基金收益分配事项:

分红公告日	权益登记日	除息日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配金额	
本期第1次分红	2007-3-28	2007-4-2	2007-4-3	3.90 元	195,000,000.00

2、华安成长本报告期基金收益分配事项:无。

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况:

本基金管理人于 2007 年 6 月 5 日,发布关于更换旗下部分基金会计师事务所的公告,经华安基金管理有限公司董事会审议通过,本基金的会计师事务所由立信会计师事务所有限公司(原上海立信长江会计师事务所有限公司)更换为普华永道中天会计师事务所有限公司。上述事项已经基金托管人中国工商银行股份有限公司同意,并报中国证监会备案。

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

(八)、基金租用证券公司专用交易席位的有关情况:

1. 报告期内租用证券公司席位的变更情况:

新增席位:

券商名称	上交所席位数	深交所席位数
西部证券股份有限公司	1	-
中银国际证券有限责任公司	-	1
联合证券有限责任公司	-	1

退租席位:无

2. 交易成交量及佣金情况:

(1). 华安成长股票交易情况:

券商名称	席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
长城证券有限责任公司	1	898,086,664.36	5.59%	734,607.54	5.66%
国泰君安证券股份有限公司	1	3,532,686,372.09	21.99%	2,764,346.09	21.30%
上海证券有限责任公司	1	2,712,121,899.04	16.89%	2,223,927.87	17.14%
西部证券股份有限公司	1	3,751,578,789.53	23.36%	3,076,282.01	23.71%
兴业证券股份有限公司	1	594,478,315.39	3.70%	487,470.81	3.76%
中国银河证券有限责任公司	1	2,969,014,190.42	18.49%	2,434,583.37	18.76%
招商证券股份有限公司	1	620,047,482.10	3.86%	485,189.79	3.74%
中银国际证券有限责任公司	1	983,441,700.42	6.12%	769,547.15	5.93%
合计	8	16,061,455,413.35	100.00%	12,975,954.63	100.00%

(2). 华安成长债券、回购及权证交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例	权证成交量	占总成交总量比例
长城证券有限责任公司	173,568,747.30	97.50%	14,800,000.00	100.00%	7,443,175.95	3.38%
国泰君安证券股份有限公司	2,751,165.00	1.55%	0.00	0.00%	94,308,977.21	42.87%
上海证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	26,256,617.05	11.93%
西部证券股份有限公司	1,691,111.00	0.95%	0.00	0.00%	42,779,778.45	19.45%
兴业证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中国银河证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	10,064,327.15	4.57%
招商证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	23,000,132.00	10.45%
中银国际证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	16,144,874.20	7.34%
合计	178,011,023.30	100.00%	14,800,000.00	100.00%	219,997,882.01	100.00%

(3). 基金安瑞股票交易情况:

券商名称	席位数量	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
长城证券有限责任公司	1	158,638,714.58	8.76%	128,262.73	8.87%
国泰君安证券股份有限公司	1	511,543,588.59	28.25%	400,286.85	27.69%
上海证券有限责任公司	1	303,356,151.63	16.75%	247,386.38	17.11%
兴业证券股份有限公司	1	160,714,528.89	8.88%	131,050.35	9.07%
中国银河证券有限责任公司	1	316,510,987.98	17.48%	256,849.34	17.77%
招商证券股份有限公司	1	359,944,180.40	19.88%	281,658.47	19.49%
合计	6	1,810,708,152.07	100.00%	1,445,494.12	100.00%

(4). 基金安瑞债券、回购及权证交易情况:

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例	权证成交量	占总成交总量比例
长城证券有限责任公司	35,406,085.50	27.12%	371,500,000.00	32.39%	8,606,666.11	24.70%
国泰君安证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	15,477,942.35	44.41%
上海证券有限责任公司	66,269,470.80	50.76%	140,000,000.00	12.21%	5,123,193.19	14.70%

兴业证券股份有限公司	0.00	0.00%	156,000,000.00	13.60%	0.00	0.00%
中国银河证券有限责任公司	28,881,840.70	22.12%	479,400,000.00	41.80%	5,475,010.40	15.71%
招商证券股份有限公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%	167,900.00	0.48%
合计	130,557,397.00	100.00%	1,146,900,000.00	100.00%	34,850,712.05	100.00%

(九)、其他重要事项:

1. 修改基金合同:

- | | 公告重要事项 | 披露日期 |
|----|---|------------|
| 1) | 发布安瑞证券投资基金终止上市公告, 本基金于 2007 年 4 月 10 日终止上市, 自基金安瑞终止上市之日起, 基金名称变更为华安中小盘成长股票型证券投资基金, 由《安瑞证券投资基金基金合同》修订而成的《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效, 基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利义务关系以《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》为准。 | 2007-04-04 |
| 2) | 发布华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书、华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购期基金份额发售公告。 | 2007-04-11 |
| 3) | 发布关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告, 经本基金托管人中国工商银行股份有限公司确认, 基金份额折算基准日(2007 年 4 月 18 日)折算前基金份额净值为 2.3149 元, 精确到小数点后第 9 位为 2.314909165 元(第 9 位以后舍去), 本基金管理人按照 1: 2.314909165 的折算比例将原基金安瑞的基金份额进行了折算。折算后, 基金份额净值转换为 1.0000 元, 相应地, 原基金安瑞每 1 份基金份额折算为 2.314909165 份, 基金份额计算结果四舍五入保留小数点后两位。原基金安瑞的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份。 | 2007-04-20 |
| 4) | 发布华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购确认比例和集中申购结果的公告, 经上海立信长江会计师事务所验资, 本次华安中小盘成长股票型证券投资基金集中申购的有效申购申请金额为 29,635,516,017.90 元人民币, 按照本基金在集中申购期内的最终有效申购确认金额折合基金份额拟不超过 100 亿份规模上限的规定, 本基金集中申购的确认比例为 33.7432963%, 本基金的最终有效申购确认金额为 10,000,000,066.56 元人民币, 扣除集中申购费后, 本基金的最终净有效集中申购确认金额为 9,883,484,414.21 元人民币, 折合基金份额 9,883,484,414.21 份。截至 2007 年 4 月 18 日止, 原安瑞证券投资基金的基金总份额由 500,000,000.00 份折算为 1,157,454,582.58 份, 原安瑞证券投资基金基金份额持有人因暂未指定交易等原因产生的未领取现金红利 1,376,246.47 元人民币确认为基金份额 1,376,246.47 份。 | 2007-04-20 |

华安中小盘成长股票型证券投资基金基金总份额由 500,000,000 份变更为 11,042,315,243.26 份。

2. 其他重要事项:

- 1) 关于国信证券有限责任公司和渤海证券有限公司开通华安中小盘成长股票型证券投资基金代销和确权业务的公告 2007-04-26
- 2) 华安中小盘成长股票型证券投资基金开放日常申购赎回业务公告,于 2007 年 5 月 16 日开始办理日常申购、赎回业务。 2007-05-14
- 3) 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购业务的公告,自 2007 年 5 月 17 日起暂停华安成长基金的日常申购业务。 2007-05-17
- 4) 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金重新开放申购的公告,从 2007 年 6 月 8 日起(含)重新开放华安中小盘成长股票型证券投资基金的申购业务。 2007-06-06
- 5) 关于增加中国农业银行金穗卡持有人办理基金网上交易业务的公告 2007-06-08
- 6) 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金开通基金转换业务的公告 2007-06-08
- 7) 关于旗下华安创新证券投资基金、华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金在中国工商银行开展个人网上银行基金申购费率活动的公告 2007-06-19
- 8) 关于华安中小盘成长股票型证券投资基金暂停申购和转入业务的公告,自公告发布之日起暂停华安中小盘成长股票型证券投资基金(简称“本基金”)的申购和转入业务。 2007-06-21
- 9) 关于证券投资基金实施新的会计准则的公告,根据中国证监会的相关规定,我公司管理的所有基金于 2007 年 7 月 1 日起实施新会计准则。实施新会计准则后,基金将全面采用公允价值进行会计计量,请投资者关注相关法规的规定。实施新会计准则后,基金估值方法及个别会计政策方面的变更不会对投资者利益造成实质性影响。 2007-07-02
- 10) 关于旗下基金投资金地集团(600383)非公开发行股票的公告 2007-07-11

前款所涉重大事件已作为临时报告在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》或基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn> 上披露。

十三、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、《安瑞证券投资基金基金合同》
- 5、《安瑞证券投资基金扩募说明书》
- 6、《安瑞证券投资基金托管协议》
- 7、中国证监会批准安瑞证券投资基金设立的文件；
- 8、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；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 10、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 11、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
2007 年 8 月 28 日