

2011 第一季度报告

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	32,122,700.00	1.40
C	制造业	1,206,647,381.19	52.61
CO	食品、饮料	59,617,739.95	2.60

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	139,772,448.75	6.09
C5	电子	58,218,509.40	2.54
C6	金属、非金属	272,310,996.80	11.87
C7	机械、设备、仪表	454,600,274.13	19.82

C8	医药、生物制品	178,349,612.16	1.78
C9	其他制造业	43,777,800.00	0.71
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	114,489,192.04	4.99
F	交通运输、仓储业	18,848,400.00	0.82
G	信息技术业	287,079,805.48	12.52
H	批发和零售贸易	83,956,983.00	3.66
I	金融、保险业	32,422,000.00	1.41
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	9,810,000.00	0.43

L	内销文化用品	-		
M	综合类	-		
	合计	1,785,376,462.11		77.84

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	2,580,000	104,541,600.00	4.56
2	600570	恒生电子	6,370,000	101,091,990.00	4.41
3	600104	上汽汽车	4,550,800	84,144,292.00	3.67
4	600316	洪都航空	2,330,000	77,029,890.00	3.36
5	002007	华宝生物	1,638,558	67,121,599.00	2.93

6	002250	长飞科技	1,576,259	55,578,892.34	2.42
7	600741	华城汽车	4,233,550	54,231,775.50	2.36
8	002038	双鹭药业	1,070,000	53,414,400.00	2.33
9	000039	中集集团	1,980,000	47,520,000.00	2.07
10	002024	苏宁电器	3,690,000	47,342,700.00	2.06
5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合					

序号	债券品种	公允价值(元)	公允价值占净资产比例(%)
1	国家债券	152,652,475.00	6.66
2	央行票据	70,049,000.00	3.05
3	金融债券	252,816,000.00	11.02
	其中:政策性金融债	252,816,000.00	11.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-

7	其他			-	
8	合计			475,517,475.00	20.73

5.5 报告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

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	080216	08国开16	600,000	61,464,000.00	2.68
2	080702	08国开02	500,000	51,105,000.00	2.23

3	070219	07国开19	500,000	50,660,000.00	2.21
4	0801050	08央票050	500,000	50,090,000.00	2.18
5	070220	07国开20	500,000	49,620,000.00	2.16

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
截止本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

5 报告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
截止本报告期末,本基金未持有权证。

5.8.2 本基金报告期内,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。

5.8.3 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,781,889.44
2	应收证券清算款	10,920,000.00

3	应收股利	
4	应收利息	8,424,402.41
5	应收申购款	
6	其他应收款	
7	待摊费用	709,677.40
8	其他	

9	合计		29,787,884.65		
5.8.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细				
截止本报告期末, 本基金未持有处于转股期的可转换债券。					
5.8.5	报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明				
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600104	上汽汽车	84,144,707.00	3.67	公告重大

2	600741	华城汽车	54,231,775.50	2.36	重大事项 停牌
§ 6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况					
					单位:份
报告期初管理人持有的封闭式基金份额					28,538,470
报告期期间买入总份额					

报告期期末卖出总份额	
报告期末未管理人持有的封闭式基金份额	28,538,470
报告期末未持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	1.43

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《安信证券投资证券投资基金合同》

3、《安信证券投资基金托管协议》

7.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站<http://www.juanan.com.cn>。

7.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一一年四月二十二日

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
5.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细				
5.3.1	期末指数型投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细				

2	601318	中国平安	2,103,815	104,054,689.90	1.80
3	600000	浦发银行	6,692,021	91,145,326.02	1.57
4	600016	民生银行	15,636,444	87,407,721.96	1.51
5	600030	中信证券	6,218,778	86,876,328.66	1.50
6	000002	万科A	8,701,793	75,618,581.17	1.31
7	601166	兴业银行	2,621,142	75,252,986.82	1.30

8	601601	中国太保	3,183,547	70,420,059.64	1.22
9	601939	建设银行	11,865,290	58,970,491.30	1.02
10	600585	海螺水泥	1,416,105	57,380,574.60	0.99

5.3.2 期末按投资公允价值占基金资产净值比例大小排序的前10名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300185	通裕重工	1,500	33,225.00	0.00

2	300195	长安股份	500	18,250.00	0.00
3	002566	益盛药业	500	18,205.00	0.00
4	300198	纳川股份	500	15,500.00	0.00
5.4 报告期末按投资品种分类的债券投资组合					
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	120,192,000.00	2.08
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	1,025,222.40	0.02
7	其他	-	-

8	合计		121,217,222.40	2.09	
5.5 截至期末按公允价值计量且公允价值变动计入所有者权益的金融资产公允价值					
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	0801047	08东票47	1,200,000	120,192,000.00	2.08
2	110016	川股转债	8,640	1,025,222.40	0.02
5.6 截至期末按公允价值计量且公允价值变动计入当期损益的金融资产公允价值					

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8.2 本基金本报告期末未持有资产净值比例大小排名前 five 名权证投资明细

5.9 投资组合报告期末持有权证

5.9.1 投资组合明细

5.9.1.1 截至本报告期末，本基金投资的前 ten 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不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.1.2 截至本报告期末，本基金投资的前 ten 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。

5.9.2 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	银行存款和结算备付金合计	1,141,324.16

2	应收证券清算款	37,184,343.49
3	应收股利	625,910.85
4	应收利息	5,165,037.75
5	应收申购款	6,532,390.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他		-
9	合计		51,152,216.92
5.8.4	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。		
5.8.5.1	期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末指数投资前十名股票未出现流通受限情况。		
5.8.5.2	期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明		
	流通受限部分的公允价值	占基金资	流通受限情况

		值	例(%)	说明
1	300198	纳川股份	15,500.00	0.00 新股网上认购
§ 6 开放式基金份额变动				
				单位:份
报告期期初基金份额总额				7,111,925,703.93
报告期基金总申购份额				563,107,084.16
本报告末期基金份额总额				1,031,927,321.33

报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	6,643,105,466.76

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、《平安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》
- 2、《平安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 3、《平安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、存查地点

基金合同、基金招募说明书、基金托管协议等基金法律文件均在基金管理人互联网网站 (www.hkex.com.hk) 及基金管理人办公场所披露，投资者可于办公时间内至基金管理人处查阅。

7.3 查阅方式
投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。
华安基金管理有限公司
二〇一一年四月二十二日