# 华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008年 12 月 31 日

基金管理人:华安基金管理有限公司 基金托管人:中国建设银行股份有限公司 送出日期:2009 年 3 月 26 日

## §1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 3 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录
1.1 重要提示
1.2 目录
§2 基金简介
2.1 基金基本情况
2.2 基金产品说明
2.3 基金管理人和基金托管人
2.4 信息披露方式
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况
3.1 主要会计数据和财务指标
3.2 基金净值表现
3.3 过去三年基金的利润分配情况
§4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明
§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
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
5.3 托管人对本年度报告 / 半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见
§6 审计报告
§7 年度财务报表
7.1 资产负债表
7.2 利润表
7.3 所有者权益(基金净值)变动表
7.4 报表附注
§8 投资组合报告
8.1 期末基金资产组合情况
8.2 期末按行业分类的股票投资组合
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资、指数投资前五名股票投资明细
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合
8.6 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
8.7 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
8.8 投资组合报告附注
§9 基金份额持有人信息
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构
9.2 期末上市基金前十名持有人
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况
§10 开放式基金份额变动
§11 重大事件揭示
11.1 基金份额持有人大会决议
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼
11.4 基金投资策略的改变
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况
§12 影响投资者决策的其他重要信息

## §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 180ETF |
| 交易代码 | 510180 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式(ETF) |
| 基金合同生效日 | 2006年 4 月 13 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 197,022,674.00 份 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2006年 5 月 18 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但因特殊情况(例如因受相关法规限制而无法买入标的指数成份股等情况)导致无法获得或无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合,追求尽可能贴近目标指数的表现。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为标的指数–"上证 180 指数"。 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票基金,风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,采用完全复制策略,跟踪上证 180 指数,是股票基金中风险中等、收益中等的产品。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|---|
| 名称 | | 华安基金管理有限公司 | 中国建设银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 冯颖 | 尹东 |
| | 联系电话 | 021–38969999 | 010–67595003 |
| | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn | yindong@ccb.cn |
| 客户服务电话 | | 40088–50099 | 010–67595096 |
| 传真 | | 021–68863414 | 010–66275833 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.huaan.com.cn |
| 基金年度报告备置地点 | 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼 |

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2008年 | 2007年 | 2006年 4 月 13 日 –2006 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| 本期已实现收益 | –555,993,757.32 | 474,843,317.22 | 164,970,904.01 |
| 本期利润 | –1,210,037,899.73 | 616,638,203.86 | 312,986,078.21 |
| 加权平均基金份额本期利润 | –6.8765 | 6.5376 | 2.1205 |
| 本期基金份额净值增长率 | –64.55% | 146.39% | 81.63% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | **2008年** | **2007年** | **2006年 4 月 13 日 –2006 年 12 月 31 日** |
| 期末可供分配基金份额利润 | 1.5231 | 6.2433 | 0.9741 |
| 期末基金资产净值 | 828,737,582.44 | 1,522,737,921.57 | 399,827,256.44 |
| 期末基金份额净值 | 4.206 | 11.866 | 4.816 |

注:

1、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

2、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字

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)

4、本基金基金合同生效日为 2006 年 4 月 13 日,合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算

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

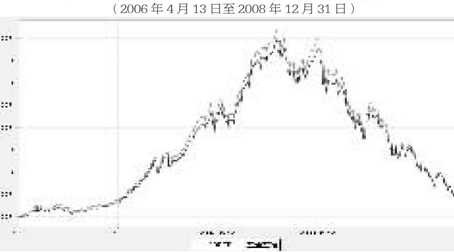
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①–③ | ②–④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | –19.55% | 3.00% | –20.18% | 3.12% | 0.63% | –0.12% |
| 过去六个月 | –33.44% | 2.93% | –35.39% | 3.07% | 1.95% | –0.14% |
| 过去一年 | –64.55% | 2.96% | –66.34% | 3.07% | 1.79% | –0.11% |
| 自基金合同生效起至今 | 58.63% | 2.40% | 58.63% | 2.47% | 0.00% | –0.07% |

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

华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

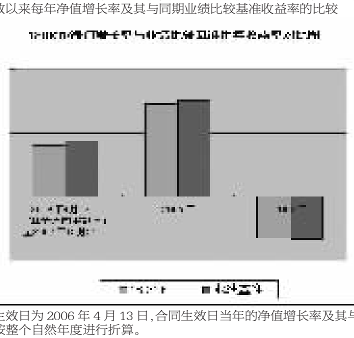
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006 年 4 月 13 日至 2008 年 12 月 31 日)



注:1、根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》规定,本基金已自基金合同生效日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十六部分(二)投资范围、(六)投资限制的有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效日为 2006 年 4 月 13 日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

| 年度 | 每 10 份基金份额分红数 | 现金形式发放总额 | 再投资形式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|
| 2008年 | – | – | – | – | – |
| 2007年 | – | – | – | – | – |
| 2006年 | 0.450 | 3,790,022.28 | – | 3,790,022.28 | – |
| 合计 | 0.450 | 3,790,022.28 | – | 3,790,022.28 | – |

## §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 2008 年 12 月 31 日,公司旗下共管理了基金安信、基金安顺 2 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、上证 180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等 11 只开放式基金,管理资产规模达到 694.94 亿人民币、0.97 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 | | |
| 卢赤斌 | 本基金的基金经理 | 2006年 4 月 13 日 | – | 11年 | 硕士学位,11 年证券从业经历。1998 年至 2004 年曾先后在美国先锋证券公司(The Vanguard Group)投资系统部和股票基金管理部工作,参与负责公司证券管理系统的研发和协助基金经理管理本公司主要股票指数基金的运作。2004 年 7 月加入华安基金管理有限公司,在基金投资部负责交易型开放式指数证券投资基金的研发工作。2006 年 4 月至今担任本基金的基金经理。 |
| 刘璎 | 本基金的基金经理 | 2007年 3 月 14 日 | – | 8年 | 管理学硕士,8 年证券从业经历。曾在交通银行工作,2001 年加入华安基金管理有限公司,历任市场部高级投资顾问、专户理财部客户主管、上证 180 交易型开放式指数证券投资基金经理助理。2007 年 3 月起任本基金的基金经理,2008 年 4 月起同时担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理。 |

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《华安上证 180 交易型开放式指数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,不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配,实现公平交易。本报告期内,场内业务的公平交易运作良好,未出现异常情况。

对于场外交易,公司制定《交易端基金间公平交易管理办法 – 银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范,执行情况良好,未出现异常情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为交易型开放式指数证券投资基金,其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前,华安旗下没有与本基金风格相同的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

截至 2008 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 4.206 元。本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)基金净值增长 –64.55%,同期上证 180 指数下跌 –66.34%,基金净值表现好于同期标的指数;本基金收益率与上证 180 指数同期收益率的跟踪误差为 0.155%,累计跟踪偏离度为 1.79%,与上证 180 指数同期收益率的相关系数为 99.95%。

自 2008 年 2 月 1 日起,上海证券交易所和中证指数有限公司调整了自由流通量实施规则,以进一步提高上证 180 指数可投资性。相应的,我们将本基金指数跟踪方法也进行了变更,由过去的抽样复制改为全复制。上证 180 指数依照惯例于 2008 年 7 月 1 日及 2009 年 1 月 5 日进行了两次指数成分股调整,根据基金相关法律法规,我们以平稳过渡为原则对本基金投资组合进行了相应调整。

由于受到全球金融危机的影响,2008 年国内外经济形势异常严峻。面对国内股市的大幅下挫以及外围经济形势持续低迷,投资者信心遭受较大打击,上市公司盈利预期不断下调的情况,在本基金的投资策略上,我们在满足指数基金法律法规和基金合同的前提下,相应的持续采取了谨慎保守的投资策略,以尽可能降低市场下跌对基金投资组合所造成的冲击。

截至 12 月 31 日,本基金仓位为 96.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场方面,我们认为对 2009 年的中国经济不应过分悲观,后续应继续观察信贷及宏观经济的相关数据,以及经济刺激政策和产业振兴规划的进一步深入和细化,同时也应该对市场短期大幅冲高保持一定的谨慎,避免盲目乐观。

对于 2009 年经济形势,我们维持 U 型底部震荡的判断,但密切关注在市场的宽幅震荡中存在的投资机会,关注从流动性推动、估值进入相对低点带来的股市反弹,关注去库存接近尾声、成本持续下降带来的实体经济盈利逐渐企稳,关注经济刺激计划背景下的产业机会、在经济转型过程中的行业内整合。我们也同样重视新能源、节能减排、基建、医药、农业等主题投资行情。

作为指数基金,本基金将紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,并在此前提下适当提高组合的防御性和灵活性。我们将密切关注政策的动向以及各类数据的变化,充分利用上证 180 指数编制规则的优势,积极把握在中国经济振兴与转型中出现的投资机会。规范运作、勤勉尽责,认真努力地为广大投资者创造长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化:

对于通过组合证券申购、赎回的上证 180 交易型开放式指数证券投资基金,暂执行原估值方法。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响:

不适用。

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

(1)公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历:

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

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

宋磊,研究发展部总经理,工学硕士,曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作,2000 年 2 月加入华安基金管理公司,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,12 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等复核和核查的责任。

(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

基金当年未出现满足分红条件的情况,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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核审查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。

## §6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师薛竞、金毅签字出具了普华永道中天审字(2009)第 20107 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读年度报告正文。

## §7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日:2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2008年 12 月 31 日 | 上年度末 2007年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 28,959,168.80 | 30,829,034.85 |
| 结算备付金 | 191,661.79 | 451,095.03 |
| 存出保证金 | – | – |
| 交易性金融资产 | 796,242,317.13 | 1,478,569,742.99 |
| 其中:股票投资 | 796,242,317.13 | 1,478,114,530.99 |
| 基金投资 | – | – |
| 债券投资 | – | 455,212.00 |
| 资产支持证券投资 | – | – |
| 衍生金融资产 | – | 207,372.02 |
| 买入返售金融资产 | – | – |
| 应收证券清算款 | 4,131,291.53 | 13,921,235.29 |
| 应收利息 | 6,013.80 | 9,293.75 |
| 应收股利 | – | – |
| 应收申购款 | – | – |
| 递延所得税资产 | – | – |
| 其他资产 | – | – |
| 资产总计 | 829,530,453.05 | 1,523,987,773.93 |
| **负债和所有者权益** | **本期末 2008年 12 月 31 日** | **上年度末 2007年 12 月 31 日** |
| 负 债: | | |
| 短期借款 | – | – |
| 交易性金融负债 | – | – |
| 衍生金融负债 | – | – |
| 卖出回购金融资产款 | – | – |
| 应付证券清算款 | – | – |
| 应付赎回款 | – | – |
| 应付管理人报酬 | 381,190.08 | 599,576.78 |
| 应付托管费 | 76,238.03 | 119,915.36 |
| 应付销售服务费 | – | – |
| 应付交易费用 | 227,392.50 | 267,786.62 |
| 应交税费 | – | – |
| 应付利息 | – | – |
| 应付利润 | – | – |
| 递延所得税负债 | – | – |
| 其他负债 | 108,050.00 | 262,573.60 |
| 负债合计 | 792,870.61 | 1,249,852.36 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 528,660,062.97 | 344,321,146.04 |
| 未分配利润 | 300,077,519.47 | 1,178,416,775.53 |
| 所有者权益合计 | 828,737,582.44 | 1,522,737,921.57 |
| 负债和所有者权益总计 | 829,530,453.05 | 1,523,987,773.93 |

注:报告截止日 2008 年 12 月 31 日,基金份额净值 4.206 元,基金份额总额 197,022,674.00 份。

后附 7.4 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

7.2 利润表

会计主体:华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | –1,200,413,710.56 | 624,502,402.76 |
| 1.利息收入 | 428,699.11 | 86,972.01 |
| 其中:存款利息收入 | 425,801.58 | 86,713.92 |
| 债券利息收入 | 2,897.53 | 258.09 |
| 资产支持证券利息收入 | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | – | – |
| 其他利息收入 | – | – |
| 2.投资收益(损失以"–"填列) | –547,650,537.93 | 482,417,854.71 |
| 其中:股票投资收益 | –561,597,432.26 | 475,776,860.10 |
| 基金投资收益 | – | – |
| 债券投资收益 | 43,936.22 | 95,546.43 |
| 资产支持证券投资收益 | – | – |
| 衍生工具收益 | 872,915.40 | 1,449,731.25 |
| 股利收益 | 13,030,042.71 | 5,095,716.93 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"–"号填列) | –654,044,142.41 | 141,794,886.64 |
| 4.汇兑收益(损失以"–"号填列) | – | – |
| 5.其他收入(损失以"–"号填列) | 852,270.67 | 202,689.40 |
| 二、费用(以"–"号填列) | –9,624,189.17 | –7,864,198.90 |
| 1. 管理人报酬 | –6,005,609.56 | –4,303,370.15 |
| 2. 托管费 | –1,201,121.98 | –860,674.05 |
| 3. 销售服务费 | – | – |
| 4. 交易费用 | –2,016,575.63 | –2,329,672.20 |
| 5. 利息支出 | – | – |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | – | – |
| 6. 其他费用 | –400,882.00 | – 370,482.50 |
| 三、利润总额(亏损总额以"–"号填列) | –1,210,037,899.73 | 616,638,203.86 |
| 减:所得税费用 | – | – |
| 四、净利润(净亏损以"–"号填列) | –1,210,037,899.73 | 616,638,203.86 |

后附 7.4 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

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2008年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 344,321,146.04 | 1,178,416,775.53 | 1,522,737,921.57 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | –1,210,037,899.73 | –1,210,037,899.73 |
| 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) | 184,338,916.93 | 331,698,643.67 | 516,037,560.60 |
| 其中:1.基金申购款 | 985,287,486.00 | 1,385,820,235.63 | 2,371,107,721.63 |
| 2.基金赎回款(以"–"号填列) | –800,948,569.07 | –1,054,121,591.96 | –1,855,070,161.03 |
| 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) | 528,660,062.97 | 300,077,519.47 | 828,737,582.44 |
| **项目** | **上年度可比期间 2007年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日** | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 222,770,157.11 | 177,057,099.33 | 399,827,256.44 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | – | 616,638,203.86 | 616,638,203.86 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"–"号填列) | 121,550,988.93 | 384,721,472.34 | 506,272,461.27 |
| 其中:1.基金申购款 | 422,611,054.03 | 1,117,633,520.25 | 1,540,244,574.28 |
| 2.基金赎回款 | –301,060,065.10 | –732,912,047.91 | –1,033,972,113.01 |
| 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) | 344,321,146.04 | 1,178,416,775.53 | 1,522,737,921.57 |

后附 7.4 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

7.4 报表附注

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 华安基金管理有限公司(以下简称"华安基金公司") | 基金管理人 |
| 中国建设银行股份有限公司(以下简称"中国建设银行") | 基金托管人 |
| 上海国际信托有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海电气(集团)总公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海锦江国际投资管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海沸点投资发展有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 上海工业投资(集团)有限公司 | 基金管理人的股东 |

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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

本报告期通过关联人交易单元的股票成交量:无。

上年度通过关联人交易单元的股票成交量:无。

7.4.3.1.2 权证交易

本报告期通过关联人交易单元的权证成交量:无。

上年度通过关联人交易单元的权证成交量:无。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期应支付关联方的佣金:无。

上年度应支付关联方的佣金:无。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日) | 上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日) |
|---|---|---|
| 当期应支付的管理费 | 6,005,609.56 | 4,303,370.15 |
| 其中:当期已支付 | 5,624,419.48 | 3,703,793.37 |
| 期末未支付 | 381,190.08 | 599,576.78 |

注:支付基金管理人华安基金公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5%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 X 0.5% / 当年天数。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日) | 上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日) |
|---|---|---|
| 当期应支付的托管费 | 1,201,121.98 | 860,674.05 |
| 其中:当期已支付 | 1,124,883.95 | 740,758.69 |
| 期末未支付 | 76,238.03 | 119,915.36 |

注:支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.1% / 当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易:无。

上年度与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易:无。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金的情况:无。

上年度基金管理人运用固有资金投资本基金的情况:无。

7.4.3.4.2 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

本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:无。

上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况:无。

7.4.3.5 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(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日) | | 上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日) | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国建设银行 | 28,959,168.80 | 418,951.71 | 30,829,034.85 | 82,103.00 |

注:本基金用于证券交易结算的资金通过"建设银行基金托管结算资金专用存款账户"转存于中国证券登记结算有限责任公司,按银行同业利率计息。于 2008 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的结算备付金"科目中单独列示(2007 年 12 月 31 日:同)。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内买入的管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券和管理人、托管人的主要股东(非控股)在承销期内承销的股票等:无。

7.4.4 期末(2008 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止本基金无因认购新发 / 增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.4.2 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 600900 | 长江电力 | 2008年 5 月 8 日 | 公告重大事项 | 14.35 | 未知 | 未知 | 2,301,388.00 | 34,736,316.64 | 33,024,917.80 |
| 600886 | 国投电力 | 2008年 12 月 9 日 | 公告重大事项 | 9.13 | 2009年 3 月 4 日 | 10.04 | 304,309.00 | 2,705,253.51 | 2,778,341.17 |
| 601918 | 国投新集 | 2008年 12 月 9 日 | 公告重大事项 | 7.55 | 2009年 2 月 27 日 | 8.31 | 138,000.00 | 991,357.94 | 1,041,900.00 |

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止,本基金无正回购余额。

## §8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 权益投资 | 796,242,317.13 | 95.99 |
| | 其中:股票 | 796,242,317.13 | 95.99 |
| 2 | 固定收益投资 | – | – |
| | 其中:债券 | – | – |
| | 资产支持证券 | – | – |
| 3 | 金融衍生品投资 | – | – |
| 4 | 买入返售金融资产 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售金融资产 | – | – |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 29,150,830.59 | 3.51 |
| 6 | 其他资产 | 4,137,305.33 | 0.50 |
| 7 | 合计 | 829,530,453.05 | 100.00 |

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | 5,854,168.57 | 0.71 |
| B | 采掘业 | 90,767,141.30 | 10.95 |
| C | 制造业 | 154,559,398.16 | 18.65 |
| C0 | 食品、饮料 | 30,027,134.02 | 3.62 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 7,256,679.03 | 0.88 |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | 641,451.00 | 0.08 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 9,037,772.97 | 1.09 |
| C5 | 电子 | 3,459,188.20 | 0.42 |
| C6 | 金属、非金属 | 49,806,025.02 | 6.01 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 36,616,847.48 | 4.42 |
| C8 | 医药、生物制品 | 14,432,433.16 | 1.74 |
| C99 | 其他制造业 | 3,281,867.28 | 0.40 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 68,261,164.85 | 8.24 |
| E | 建筑业 | 16,462,875.41 | 1.99 |
| F | 交通运输、仓储业 | 61,510,681.46 | 7.42 |
| G | 信息技术业 | 29,094,027.92 | 3.51 |
| H | 批发和零售贸易 | 19,241,705.60 | 2.32 |
| I | 金融、保险业 | 280,652,328.86 | 33.87 |
| J | 房地产业 | 29,610,478.64 | 3.57 |
| K | 社会服务业 | 8,542,914.25 | 1.03 |
| L | 传播与文化产业 | 2,758,135.64 | 0.33 |
| M | 综合类 | 21,122,496.47 | 2.55 |
| | 合计 | 788,437,517.13 | 95.14 |

8.2.2 积极投资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(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| A | 农、林、牧、渔业 | – | – |
| B | 采掘业 | 576,000.00 | 0.07 |
| C | 制造业 | – | – |
| C0 | 食品、饮料 | – | – |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | – | – |
| C2 | 木材、家具 | – | – |
| C3 | 造纸、印刷 | – | – |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | – | – |
| C5 | 电子 | – | – |
| C6 | 金属、非金属 | – | – |
| C7 | 机械、设备、仪表 | – | – |
| C8 | 医药、生物制品 | – | – |
| C99 | 其他制造业 | – | – |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | – | – |
| E | 建筑业 | 7,228,800.00 | 0.87 |
| F | 交通运输、仓储业 | – | – |
| G | 信息技术业 | – | – |
| H | 批发和零售贸易 | – | – |
| I | 金融、保险业 | – | – |
| J | 房地产业 | – | – |
| K | 社会服务业 | – | – |
| L | 传播与文化产业 | – | – |
| M | 综合类 | – | – |
| | 合计 | 7,804,800.00 | 0.94 |

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资、指数投资前五名股票投资明细

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 601186 | 中国铁建 | 720,000 | 7,228,800.00 | 0.87 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 120,000 | 576,000.00 | 0.07 |
| 3 | – | – | – | – | – |
| 4 | – | – | – | – | – |
| 5 | – | – | – | – | – |

注:投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细,应阅读登载于 http://www.huaan.com.cn 网站的年度报告正文

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

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 3,899,123 | 47,413,335.68 | 5.72 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 2,329,080 | 41,853,567.60 | 5.05 |
| 3 | 600900 | 长江电力 | 2,301,388 | 33,024,917.80 | 3.98 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 1,233,437 | 32,797,089.83 | 3.96 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 2,127,466 | 28,188,924.50 | 3.40 |

注:投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细,应阅读登载于 http://www.huaan.com.cn 网站的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601088 | 中国神华 | 41,648,636.07 | 2.74 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 27,895,180.36 | 1.83 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 27,596,917.20 | 1.81 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 22,302,730.55 | 1.46 |
| 5 | 601390 | 中国中铁 | 11,489,388.57 | 0.75 |
| 6 | 601601 | 中国太保 | 10,796,632.00 | 0.71 |
| 7 | 601919 | 中国远洋 | 10,262,745.03 | 0.67 |
| 8 | 601006 | 大秦铁路 | 7,625,029.37 | 0.50 |
| 9 | 601808 | 中海油服 | 7,596,404.47 | 0.50 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 7,195,021.16 | 0.47 |
| 11 | 601398 | 工商银行 | 7,082,260.91 | 0.47 |
| 12 | 601186 | 中国铁建 | 6,934,999.00 | 0.46 |
| 13 | 601169 | 北京银行 | 6,530,626.00 | 0.43 |
| 14 | 601857 | 中国石油 | 5,291,913.34 | 0.35 |
| 15 | 600585 | 海螺水泥 | 5,167,790.38 | 0.34 |
| 16 | 601001 | 大同煤业 | 4,978,103.00 | 0.33 |
| 17 | 600221 | 海南航空 | 4,818,217.00 | 0.32 |
| 18 | 600158 | 中体产业 | 4,561,910.00 | 0.30 |
| 19 | 600839 | 四川长虹 | 4,422,106.00 | 0.29 |
| 20 | 600115 | 东方航空 | 4,392,574.00 | 0.29 |

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600028 | 中国石化 | 44,529,296.72 | 2.92 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 19,963,465.06 | 1.31 |
| 3 | 600016 | 民生银行 | 14,708,876.00 | 0.97 |
| 4 | 601991 | 大唐发电 | 10,483,936.48 | 0.69 |
| 5 | 600000 | 浦发银行 | 8,707,850.00 | 0.57 |
| 6 | 601699 | 潞安环能 | 7,886,450.70 | 0.52 |
| 7 | 600018 | 上港集团 | 7,714,631.70 | 0.51 |
| 8 | 600019 | 宝钢股份 | 6,743,000.00 | 0.44 |
| 9 | 600271 | 航天信息 | 4,863,955.80 | 0.32 |
| 10 | 601006 | 大秦铁路 | 4,741,643.00 | 0.31 |
| 11 | 600050 | 中国联通 | 4,521,650.00 | 0.30 |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 4,405,046.00 | 0.29 |
| 13 | 600795 | 国电电力 | 4,355,700.00 | 0.29 |
| 14 | 600104 | 上海汽车 | 4,335,012.38 | 0.28 |
| 15 | 600004 | 白云机场 | 4,152,726.00 | 0.27 |
| 16 | 600011 | 华能国际 | 3,789,918.50 | 0.25 |
| 17 | 600875 | 东方电气 | 3,779,966.20 | 0.25 |
| 18 | 601088 | 中国神华 | 3,551,147.00 | 0.23 |
| 19 | 600027 | 华电国际 | 3,281,422.60 | 0.22 |
| 20 | 600169 | 太原重工 | 3,210,599.94 | 0.21 |

注:本项的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本(成交)总额 | 406,463,793.17 |
| 卖出股票收入(成交)总额 | 285,943,512.57 |

注:本项的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.8 投资组合报告附注

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

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

8.8.3 其他资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,131,291.53 |
| 3 | 应收股利 | – |
| 4 | 应收利息 | 6,013.80 |
| 5 | 应收申购款 | – |
| 6 | 其他应收款 | – |
| 7 | 其他 | – |
| 8 | 合计 | 4,137,305.33 |

8.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.8.5 报告期末指数投资或积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产的净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 33,024,917.80 | 3.98 | 因重大事项停牌 |

## §9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 19,777 | 9,962.21 | 119,439,511.00 | 60.62% | 77,583,163.00 | 39.38% |

9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国人寿资产管理有限公司 | 14,446,577.00 | 7.33% |
| 2 | 光大证券股份有限公司 | 11,982,409.00 | 6.08% |
| 3 | 中国工商银行托管中国人保资产管理有限公司 | 10,999,727.00 | 5.58% |
| 4 | 交通银行托管泰康资产管理有限责任公司 | 7,175,637.00 | 3.64% |
| 5 | 交通银行托管中国人寿资产管理有限公司 | 5,049,341.00 | 2.56% |
| 6 | 招商银行股份有限公司托管招商证券基金宝集合资产管理计划 | 5,000,000.00 | 2.54% |
| 7 | 瑞银证券有限责任公司 | 4,752,596.00 | 2.41% |
| 8 | 华安证券有限责任公司 | 2,429,100.00 | 1.23% |
| 9 | 中国人寿资产管理有限公司 | 2,427,124.00 | 1.23% |
| 10 | 国泰君安证券股份有限公司 | 2,000,000.00 | 1.02% |

9.3 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 | 份额级别 | 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 | – | 600.00 | 0.0003% |
| | 合计 | 600.00 | 0.0003% |

## §10 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 基金合同生效日(2006 年 4 月 13 日)基金份额总额 | 1,072,822,105.00 |
| 报告期期初基金份额总额 | 128,322,674.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 367,200,000.00 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 298,500,000.00 |
| 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 | 197,022,674.00 |

## §11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下:

2008年 6 月 10 日,基金管理人公告了关于董事和监事变更的公告,经本公司股东会审议,选举马名驹先生担任本公司董事,顾培柱先生不再担任本公司董事;选举李梅清女士担任本公司监事,戴金宝先生不再担任本公司监事。

2009 年 1 月 12 日,基金管理人公告了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。

2009 年 2 月 19 日,基金管理人公告了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。

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:

2008 年 6 月 13 日,中国证券监督管理委员会核准中国建设银行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本基金管理人于 2008 年 1 月 29 日发布《关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金指数跟踪方法变更的公告》,华安基金管理有限公司决定从 2008 年 2 月 1 日起对公司管理的上证 180 交易型开放式指数跟踪方法进行变更,即将指数跟踪方法由抽样复制改为全复制。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金改聘为其审计的会计师事务所情况:无。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况:人民币 100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自 2006 年 4 月 13 日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 股票交易

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 | |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 679,225,124.84 | 100% | 577,336.86 | 100% | – |
| 合计 | 1 | 679,225,124.84 | 100% | 577,336.86 | 100% | |

11.7.2 债券、权证交易

金额单位:人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 权证交易 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 7,790,471.60 | 100% | 3,252,422.07 | 100% |
| 合计 | 7,790,471.60 | 100% | 3,252,422.07 | 100% |

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、本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

1、2008 年 5 月 27 日,中国建设银行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告,美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于 2005 年 6 月 17 日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权;

2、2008 年 9 月 23 日,中国建设银行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持中国建设银行股份的公告;

3、2008 年 11 月 17 日,中国建设银行公告美国银行公司行使认购期权的事宜;

4、2008 年 12 月 2 日,中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

华安基金管理有限公司
2009 年 3 月 26 日