

上证180交易型开放式指数证券投资基金

更新的招募说明书摘要

(2006年第1号)

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

重要提示

上证180交易型开放式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会2006年2月22日证监基金字[2006]30号文批准募集。本基金基金合同自2006年4月13日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险,投资者申购基金前应认真阅读本招募说明书。

基金过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本摘要根据本基金的基金合同和招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书中已经本基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2006年10月13日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年9月30日(未经审计)。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1. 名称: 华安基金管理有限公司
 2. 注册地址: 上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
 3. 设立日期: 1998年6月4日
 4. 法定代表人: 王成明
 5. 办公地址: 上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦2楼,37楼,38楼
 6. 联系电话: 021-58881111
 7. 联系人: 冯磊
- (二) 注册资本和股权结构
1. 注册资本: 15亿元人民币
 2. 股权结构:

持股单位	持股占总股本比例
上海电气(集团)总公司	20%
上海国际信托投资有限公司	20%
上海广电(集团)有限公司	20%
上海工业投资(集团)有限公司	20%
上海浦东投资发展有限公司	20%

(三) 主要人员情况

1. 基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员的姓名、从业经历、学历及兼职情况等。

(1) 董事会:

徐建国先生,研究生学历,高级经济师及上海财经大学兼职教授。历任上海日用化学工业公司副经理,上海市轻工工业局局长助理、副局长,党委书记,上海市经济委员会副主任,上海市金山区区长,上海市黄浦区区长,上海市人民政府副秘书长,上海市经济委员会主任,现任上海电气(集团)总公司董事长。

俞妙敏先生,大学学历,高级经济师。历任上海申进进出口公司副经理,上海国际信托投资公司公关部长,驻德国汉诺办事处总代表,ATC公司董事会董事总经理,信託二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理,资金信托总部总经理、行政管理部经理,上海国际信托投资有限公司副总经理,现主持华安基金管理有限公司日常工作。

曹昌基先生,大专学历,高级工程师。历任上海合成纤维研究所副科长,中石化上海石化总厂染整厂总工程师,厂长助理,中石化上海石化股份公司副总经理,中石化上海金山实业公司总经理,上海市经委副主任,现任上海工业投资(集团)有限公司董事长。

万竹华先生,大专学历,经济师。历任中国农业银行上海市分行川沙支行营业部职员,浦东花木信用社主任,浦东普善信用社副主任,中国农业银行上海市分行陆家嘴支行营业部副行长,中国农业银行上海市分行金桥支行副行长,兴业银行上海分行浦东支行行长,现任上海国际信托投资有限公司副经理。

顾胜兵先生,大专学历,高级经济师。历任上海电子管二厂车间副主任,上海电子管厂副科长,办公室主任,上海电子管六厂、二厂厂长,副厂长,上海灯泡厂厂长,上海真空电子器件股份有限公司常务副总经理,副董事长、董事长,上海广电(集团)有限公司副总裁兼上海广电电子股份有限公司董事长、上海广电NEC液晶显示器有限公司董事长,现任上海广电(集团)有限公司总裁。

张怀庆先生,大学学历,会计师职称,中国注册会计师,中国注册税务师。历任浦发证券有限责任公司营业部、上海总部财务负责人,现任上海浦东投资发展有限公司投资部总经理。

独立董事:

顾乃基先生,研究生学历,教授。现任全国政协委员,政协经济委员会委员,北京大学经济学院教授,博士生导师,北京市、云南省、吉林省、成都市、武汉市等省市专家顾问,北京市场经济研究所所长,《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长,上海市第一律师事务所律师主任,上海金茂律师事务所主任,上海市律师协会副会长,现任上海市金茂律师事务所高级合伙人,上海仲裁委员会仲裁员,上海市律师协会副会长。

夏大顺先生,研究生学历,教授。历任上海财经大学科研处处长,上海财经大学南德管理学院院长,上海财经大学常务副校长,现任上海国家会计学院院长、党委书记,APRC金融与发展项目执行秘书处秘书长,兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长,中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证券交易所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

(2) 监事会:

谢伟民先生,研究生学历,副教授。历任上海市城建局南工务所干部,空军政治学院训练部中共党史研究室宣贯室教员、讲师,上海市计委直属机关党委干事,中共上海综合经济工作委员会组织处干事,宣传员(副处级),副处长,中共上海金融工作党委组织部处长(宣传处),副处长兼党委组织部、机关党委书记,正处级。现任上海浦东投资发展有限公司总经理。

陈德士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理,资产信托总部实业投资部副经理,资产管理总部投资业务部副科长,现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生,研究生学历,高级经济师。历任上海良工阀门厂团委副书记、车间主任,副厂长,上海机电工业管理局办公室副主任,规划处处长,上海电气(集团)总公司副总裁兼上海机电股份有限公司党委书记、总经理。

徐丹女士,研究生学历,高级会计师,中国注册会计师。历任上海石化总厂计划处会计、财务副科长,中石化上海金山实业公司财务处副处长,上海金山实业发展有限公司财务总监兼财务部主任,上海金山区政府局副局长,中石化上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实业经济发展有限公司财务部经理,现任上海工业投资(集团)有限公司总会计师。

戴金宝先生,研究生学历,高级经济师。历任上海无线电三厂供销科科员,上海无线电二厂设计科设计师,党委书记助理,纪委书记,上海广电股份有限公司(原上海广播电视集团公司)组织部长、办公室主任、董事会秘书处主任,现任上海广电(集团)有限公司战略发展部经理。

蒋位先生,研究生学历,经济师。曾在上海财经大学任讲师,上海市发展计划委员会工作,现任上海浦东投资发展有限公司投资部高级经理。

孙志方先生,研究生学历,经济师。曾在上海国际信托投资公司综合研究室、法律顾问室、证券事务信托部工作,历任华安基金管理有限公司监察稽核部总经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理,研究发展部总监。

(3) 高级管理人员:

俞妙敏先生,大学学历,高级经济师。历任上海申进进出口公司副经理,上海国际信托投资公司公关部长,驻德国汉诺办事处总代表,ATC公司董事会董事总经理,信託二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理,资金信托总部总经理、行政管理部经理,上海国际信托投资有限公司副总经理,现主持华安基金管理有限公司日常工作。

邵杰军先生,研究生学历,13年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理部总经理助理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

魏敏林先生,研究生学历,13年证券和投资专业经验。曾是美国国际基金投资公司 Berens Capital 合伙人,并曾在美国道琼斯公司(Dow Jones)风险抵押贷款债券部,美国高盛公司(Goldman Sachs)风险管理部和美国国际基金 Alpha Asset Management 工作,现任华安基金管理有限公司副总经理。

李硕良先生,研究生学历,19年基金业工作经历。曾任国际证券信托投资公司资讯注册登记部主管、怡富证券投资信托公司注册登记与IT资讯部主管、综合规划部副总经理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

章国富先生,研究生学历,20年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师,上海大学会计师事务所会计师,中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理,上海华虹(集团)有限公司财务部副部长(主持工作),上海信虹投资管理有限公司副总经理,上海浦东投资管理咨询有限公司财务总监,现任华安基金管理有限公司董事长。

刘光华先生,工商管理硕士,7年银行、基金从业经历。曾在中国农业银行上海市分行国际业务部,路透社上海代表处,中银国际上海代表处工作。2001年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员,从事汽车和机械行业及相关上市公司研究,现任“华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金”基金经理。

卢亦斌先生,硕士学位,7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,参与负责美国证券管理系统的开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,任基金投资部从事交易型开放式指数证券投资基金的研发工作。

3. 本公司采取集体投资决策制度,投资决策委员会成员的姓名和职务如下:

魏敏林先生,副总经理
王卫先生,总经理助理,基金投资部总监
孙志方先生,总经理助理,研究发展部总监
陆敏女士,固定收益部副总监

诸慧女士,集中交易部副总监
沈女士,集中交易部副总监

二、基金托管人

(一) 基本情况
名称: 中国建设银行股份有限公司(简称: 中国建设银行)
住所: 北京市西城区金融大街25号
办公地址: 北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人: 郭树清
成立时间: 2004年09月17日
组织形式: 股份有限公司
注册资本: 壹仟玖佰肆拾贰亿叁仟零贰拾伍万人民币
存续期间: 持续经营

基金托管资格批文及文号: 中国证监会证监基金字[1998]12号
联系人: 尹东
联系电话: (010) 6759 5104

中国建设银行股份有限公司在中国拥有悠久的历史。其前身中国人民建设银行于1954年成立,于1996年易名为中国建设银行,是中国的四大国有商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。截至2005年12月31日,中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)总资产达人民币45,857.42亿元,客户存款达人民币40,080.46亿元,2005年实现税前利润人民币563.64亿元。截至2005年12月31日止,中国建设银行在中国内地设有13,977个分支机构,并在香港、新加坡、法兰克福、约翰内斯堡、东京及首尔设有分行,在伦敦、纽约设有代表处。英国《银行家》杂志2005年7月公布的世界1,000家大银行按一级资本排序中,中国建设银行列第25位,并被评选为“中国年度最佳银行”;《亚洲》杂志2005年“中国最佳内资银行”;《全球银行家》杂志主办的“2005年新兴市场托管服务调查”中,获得“中国最佳托管银行”称号。

中国建设银行总行设在北京,基金托管部设综合制度处、基金业务处、基金托管处、资产托管处、OTU托管处、基金核算处、基金清算处和监督稽核处7个职能部门,现有员工70余人。

(二) 主要人员情况

罗中涛,基金托管部总经理,曾就职于国家统计局,建设银行总行评估、信贷、委托代理等业务部门并担任领导工作,对统计、评估、信贷及委托代理业务具有丰富的管理经验。

李春信,基金托管部副总经理,曾就职于建设银行总行人力资源部,计划部、筹资部、国际业务部并担任领导工作,对计划、个人银行及国际业务具有丰富的经验。

(三) 基金托管业务经营情况

截止至2006年6月30日,中国建设银行已托管兴华、兴和、泰和、金鑫、金盛、金鼎、汉

博、通宝、通乾、鸿飞、银丰共11只封闭式证券投资基金,以及华夏成长、融通新蓝筹、博时价值增长、华宝兴业行业领先(包括宝康消费品、宝康债券、宝康灵活配置3只子基金)、博时裕富、长城久恒、银华保本增值、华夏现金增利、华宝兴业多策略增长、国泰金马稳健回报、银华-道琼斯88精选、上投摩根中国优势、东方龙、博时主题行业、华富竞争力优选、华宝兴业现金宝-上投摩根货币市场、华夏红利、博时稳定价值、银华核心价值、上投摩根阿尔法、中信红利精选、工银瑞信货币市场、华安上证180ETF、长城消费增值精选、上投摩根双息平衡混合、湘财裕利混合、交银施罗德稳健配置混合、华宝兴业收益增长混合、华夏理财中小企业板ETF、华富货币市场等共33只开放式证券投资基金,托管基金财产规模达681.77亿元。

三、相关服务机构

(一) 基金销售机构
(1) 申购赎回(即)证券公司(简称:一级交易商):

(1) 国泰君安证券股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区商城路618号
法定代表人: 杨幼明
电话: 021-62580818
传真: 021-62585439
联系人: 芮敏萱
客服电话: 400-8888-666
网址: www.gtja.com

(2) 申银万国证券股份有限公司
注册地址: 上海市常熟路171号
法定代表人: 谢平
电话: 021-54033888
传真: 021-64738844
联系人: 王开敏
客服电话: 021-962503
公司网址: www.sw2000.com.cn

(3) 海通证券股份有限公司
注册地址: 上海市淮海中路98号
法定代表人: 王开国
电话: 021-53594566
传真: 021-53830991
联系人: 丁晓峰
客服电话: 021-962503
公司网址: www.htsec.com

(4) 招商证券股份有限公司
注册地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层
法定代表人: 肖利兵
电话: 0755-82943511
传真: 0755-82943237
联系人: 黄健
客服电话: 4008881111; 0755-26961111
公司网址: www.newone.com.cn

(5) 长江证券有限责任公司
注册地址: 广州市天河区珠江新城花城大道8号
法定代表人: 王怀权
电话: 020-87565888
传真: 020-87567985
联系人: 肖冲
客服电话: 020-87565888
公司网址: www.cjsc.com.cn

(6) 光大证券股份有限公司
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦15楼
联系人: 陈群非
电话: 021-68816000-1587
传真: 021-68817271
联系人: 刘晨
客服电话: 01010898
公司网址: www.ebscn.com

(7) 广发证券股份有限公司
注册地址: 广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址: 广州天河区河北路163号大都会广场36、38、41、42楼
法定代表人: 王传福
电话: 020-87565888
传真: 020-87567985
联系人: 肖冲
客服电话: 020-87565888
公司网址: www.gfsc.com.cn

(8) 中国国际证券业金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人: 朱荣
电话: 010-68636133; 66568857
传真: 010-68682536
联系人: 郭京华
客服电话: 010-68016655
公司网址: www.chinastock.com.cn

(9) 上海证券有限责任公司
注册地址: 上海市九江路111号
办公地址: 上海市南京路19号
法定代表人: 蒋寅
电话: 021-6849818-657
传真: 021-65213164
联系人: 刘水
客服电话: 021-962518
公司网址: www.962518.com

(10) 中信证券股份有限公司
注册地址: 广东省深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦
办公地址: 北京市西城区闹市口大街3号京城大厦3楼
法定代表人: 王明
电话: 010-8498918-63266
传真: 010-84989560
联系人: 陈忠
客服电话: 010-84682666
公司网址: www.citic.com

(11) 中信万通证券有限责任公司
注册地址: 青岛市市南区东海西路28号
办公地址: 青岛市市南区东海西路28号
法定代表人: 李志刚
电话: 0532-85023906
传真: 0532-85023906
联系人: 李楠
客服电话: 0532-96577
公司网址: www.zxwt.com.cn

(12) 中信建投证券股份有限公司
注册地址: 北京市朝阳区安立路66号A号楼
办公地址: 北京市朝阳区内大街188号
法定代表人: 秦晓
电话: 010-65183888
传真: 010-65182261
联系人: 魏明
客服电话: 400888108
公司网站: www.csc108.com

(13) 中国国际金融有限公司
注册地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
办公地址: 北京市建国门外大街1号国贸大厦2座28层
法定代表人: 李达
电话: 021-58400383
传真: 021-58975123
联系人: 王欢
客服电话: 021-5879226-3670
公司网址: www.cic.com.cn

(14) 南京证券有限责任公司
注册地址: 江苏省南京市大钟亭8号
办公地址: 江苏省南京市大钟亭8号
法定代表人: 张东保
电话: 025-8367888-4101
传真: 025-8364032
联系人: 蒋春利
客服电话: 025-8394032
公司网站: www.njzq.com.cn

(15) 平安证券有限责任公司
办公地址: 深圳八卦三路平安大厦三楼
法定代表人: 叶黎成
电话: 0755-82450826
传真: 0755-82433794
联系人: 余江
客服电话: 0571-967218
公司网址: www.pa18.com

(16) 中原证券股份有限公司
注册地址: 许昌市南关大街38号
办公地址: 郑州市经三路15号广电国贸大厦10楼
法定代表人: 张建刚
电话: 0371-66585610
传真: 0371-66585605
联系人: 梁新立
客服电话: 0371-967218
公司网址: www.ccnew.com

(17) 东方证券股份有限公司
注册地址: 上海市浦东大道720号20楼
办公地址: 上海市浦东大道720号20楼
法定代表人: 王益民
电话: 021-62688000-3003
传真: 021-62689601
联系人: 吴宇
客服电话: 021-962506
公司网址: www.dfq.com.cn

(18) 东证证券有限责任公司
注册地址: 江苏常州中吴路裕隆大厦18、19楼
办公地址: 上海东方路989号中法广场17楼
法定代表人: 阙卫斌
电话: 021-50688776
传真: 021-50688076
联系人: 龙涛
客服电话: 0619-8166222
公司网址: www.longone.com.cn

(19) 华泰证券有限责任公司
注册地址: 南京市中山东路90号华泰证券大厦
办公地址: 南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人: 吴万善
电话: 025-84457777-721
传真: 025-84659879
联系人: 袁虹影
客服电话: 025-84579887
公司网址: www.htsc.com.cn

(20) 国信证券股份有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16-26层
法定代表人: 何如
电话: 0755-82133302
联系人: 林德茵
客服电话: 8008108888
公司网址: www.guosen.com.cn

(21) 国海证券股份有限公司
注册地址: 广西南宁市滨湖路46号
法定代表人: 张维强
电话: 0771-961010; 0755-82485852
传真: 0755-82485852
联系人: 徐伟平
客服电话: 4008881100
公司网址: www.guq.com.cn

(22) 德邦证券有限责任公司
注册地址: 江苏省常州市沈河区小西路49号
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路588号浦发大厦26层
法定代表人: 王军
电话: 021-68590808-8125
传真: 021-68596077
联系人: 罗芳
电话: 021-68590808-8119
公司网址: www.tebon.com.cn

(23) 联合证券有限责任公司
注册地址: 深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦10、25层
法定代表人: 王政
电话: 0755-82492000
传真: 0755-82492062
联系人: 范雷鸣
客服电话: 4008888565; 0755-25125666
公司网址: www.lhzq.com

(24) 广发华福证券有限责任公司
注册地址: 福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层
办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦8层
法定代表人: 王佐
电话: 0591-87836323
传真: 0591-87836310
联系人: 张鹏
公司网址: www.guafu.com.cn

(25) 信泰证券有限责任公司
注册地址: 江苏省南京市长江路88号
法定代表人: 钱卫法
电话: 025-84784782
传真: 025-84784741
联系人: 陈群非
公司网址: www.thpsec.com

(26) 宏源证券股份有限公司
注册地址: 新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号
法定代表人: 汤世生
电话: 010-62297799
传真: 010-62294470
联系人: 丁伟
二、二级市场交易代办证券机构
包括具有经纪证券资格和上海证券交易所会员资格的所有证券公司。

3. 基金管理人可根据有关法律法规,选择其他符合要求的机构代理发售本基金,并及时公告。

(二) 登记结算机构
名称: 中国证券登记结算有限责任公司
地址: 中国北京西城区金融大街27号证券广场22层
法定代表人: 陈耀庭
联系人: 刘玉文
联系电话: 010-58872625
传真: 021-68870311

(三) 律师事务所和经办律师
名称: 通力律师事务所
注册地址: 上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
负责人: 韩炯
电话: (021) 68818100
传真: (021) 68816880
联系人: 秦慧民
经办律师: 秦慧民、傅捷

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称: 普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址: 上海市浦东新区东路路568号
办公地址: 上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人: 杨绍信
电话: (021) 61238888
传真: (021) 61213880
联系人: 陈庆庆
经办注册会计师: 汪禄、薛竟

四、基金的名称

五、基金的类型

本基金名称: 上证180交易型开放式指数证券投资基金。

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象,投资于指数成份股、备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%,如因标的指数成份股调整、基金份额申购、赎回等原因导致现金差,或因基金管理人认为不符合上述标准的,基金管理人可在一个交易日内进行调整,同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略

本基金主要采取抽样复制的指数跟踪方法,即根据量化的跟踪指标,选择部分标的指数成份股构建基金投资组合,并通过优化模型确定投资组合中个股的权重,以实现基金组合收益率和标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。投资于股票部分的基金资产将严格按照基金管理人公示的抽样复制方法所确定的成份股比例进行配置。通过抽样复制,剔除流动性较差的成份股,从而减少基金资产运行过程中可能出现的流动性风险,并有效降低基金申购赎回的复杂度。基金管理人将在基金募集期开始前3个交易日抽样复制方法,同时根据标的指数的成交情况,基金管理人可对指数跟踪方法进行调整,并于方法调整前予以公告。

1. 决策依据

(1) 法律法规和基金合同等有关的规定;
(2) 标的指数编制、调整等相关规定,以及基金管理人事先制定的指数模拟和跟踪策略。

2. 决策程序

研究开发、投资决策、组合构建、交易、评估、组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序以保证投资管理的正确执行,避免重大风险的发生。

(1) 研究开发: 产品开发小组依托公司和外部独立研究机构力量,采用国际通行的指数模拟方法,并结合我国证券市场运行特征,开发上证180指数抽样复制策略。金融工程小组通过对成份股和公司行为等等相关信息进行量化分析,进行基金资产流动性分析,跟踪误差及其归因分析等工作,定期撰写研究报告,作为基金投资决策的重要依据。

(2) 投资决策: 投资决策委员会依据产品开发小组所开发的指数模拟策略,以及金融工程小组提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理日常工作。

(3) 组合构建: 根据标的指数的跟踪,结合研究开发,基金经理以抽样复制法构建组合。在追求跟踪误差跟踪偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本,控制投资风险。

(4) 交易执行:

集中交易部负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5) 投资绩效评估: 金融工程小组定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期,组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6) 组合监控与调整: 基金经理将跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人将根据标的指数成份股持有人的利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资策略做出调整,并在基金更新的招募说明书及后续公告。

在正常情况下,本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.2%,年跟踪误差率不超过2%。如因指数的编制规则调整或其因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

九、基金业绩比较基准

本基金业绩比较基准为标的指数。若本基金标的指数发生变更,则本基金业绩比较基准随之发生变更。

十、基金的风险收益特征

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。本基金为指数基金,采用抽样复制策略,跟踪上证180指数,是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

十一、基金投资组合报告

基金管理人的真实性和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。

基金托管人根据本基金合同规定,于2006年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2006年9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1. 基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占基金总资产比例
1	股票	323,507,947.81	99.21%
2	债券	0.00	0.00%
3	银行存款和结算备付金合计	2,549,251.78	0.78%
4	其他资产	4,040,578.97	0.01%
合计		326,097,719.36	100.00%

2. 股票投资组合

1) 指数投资按行业分类的股票投资组合

行业分类	市值(元)	占资产净值比例
A 农林牧渔业	1,185,409.00	0.36%
B 采掘业	23,349,290.68	7.17%
C 制造业	114,747,331.20	35.24%
C0 食品、饮料	19,090,770.95	5.86%
C1 纺织、服装、皮毛	3,726,470.01	1.14%
C4 石化、化学、塑胶、塑料	11,289,420.01	3.47%
C5 电子	6,103,431.66	1.87%
C6 金属、非金属	33,557,154.36	10.30%
C7 机械、设备、仪表	31,072,956.08	9.50%
C8 医药、生物制品	7,349,616.79	2.28%
C9 其他制造业	1,757,003.25	0.54%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	26,773,180.46	8.22%
E 建筑业	2,015,506.72	0.62%
F 交通运输、仓储业	31,797,951.84	9.76%
G 信息技术业	20,582,281.24	6.32%
H 批发和零售贸易	13,710,676.16	4.21%
I 金融、保险业	63,909,210.71	19.61%
J 房地产业	7,321,561.25	2.25%
K 社会服务业	4,700,147	