

华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金

2007年第一季度报告

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 签发日期: 二〇〇七年四月十八日

注: 1. 本基金于 2006 年 4 月 13 日成立, 并于 2006 年 5 月 18 日起在上海证券交易所上市并办理申购、赎回业务。截至本报告期末, 本基金成立不满一年。

2. 本基金以标的指数的成份股、备选成份股为主要投资对象, 投资于指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 95%。本基金投资在基金合同生效之日起 3 个月的时间达到这一投资比例。

3. 截至本报告期末, 本基金已符合上述投资比例限制。

四、管理人报告 1. 基金经理 卢亦霖 先生, 硕士学位, 9 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) 投资系统部股票基金管理部工作, 参与负责该公司资产管理系统的研发协助基金

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, 任基金投资部基金经理助理, 负责上证 180 交易型开放式指数基金的研究工作。现任上证 180ETF 基金经理。

刘璐 女士: 管理学硕士, 6 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, 2005 年 10 月转入基金投资部协助基金经理日常工作。现任上证 180ETF 基金经理。

3. 基金运作合规性报告 截至 2007 年 3 月 31 日, 本基金份额净值为 6.340 元, 基金份额还原净值为 2.380 元, 自成立以来基金净值增长 139.11%。本报告期 (2007 年 1 月 1 日至 2007 年 3 月 31 日) 基金净值增长 31.64%, 同期上证 180 指数增长 33.37%。本基金收益率与上证 180 指数同期收益率的跟踪误差为 0.124%, 累计跟踪误差为 -1.726%, 与上证 180 指数同期收益率的相关系数也高达 99.893%。

在本报告期内的三个月内, 上证 180ETF 先后经历了三次标的指数成份股的定期调整, 三次标的指数成份股的临时调整 (即 2 月 23 日“中国人寿 (601628)”的临时调整, 2 月 26 日“兴业银行 (601166)”的临时调整和 3 月 15 日“中国平安 (601318)”的临时调整) 以及以工商银行、中国银行、上海机场、歌华有线为代表的央企国企的投融资重组案例的调整, 使得本基金的跟踪精度受到一定影响, 同时管理操作相对于前期一季度也面临较大的挑战。因而在本季度本基金的操作主要集中在上述调整

变更等因素而导致的投资组合调整方面。在操作中, 为了尽可能地降低调整成本和减小对投资组合的冲击, 我们对影响投资组合跟踪精度的相关事件提前进行了分析并制定相应应对方案, 压低了调整的频率和幅度, 顺利完成了投资组合调整工作。由于上证 180ETF 是以紧密跟踪标的指数的指数, 以实现基金投资组合收益率与标的指数的收益率跟踪偏离度和跟踪误差最小化为投资目标, 因此本季度本基金业绩跟踪位同

期跟踪型开放式基金前列, 使“大投资者几乎赚了指数就赚钱”的投资目标。 截止 3 月 30 日, 本基金仓位保持在 99.71% 以上。 在 2007 年第二季度本基金将继续秉承既定的投资目标与投资策略, 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。

五、投资组合报告

表一: 基金资产组合 序号 资产组合 金额(元) 占基金总资产比例

表二: 股票投资组合 序号 股票 金额(元) 占基金总资产比例

表三: 指数股投资组合 行业分类 市值(元) 占资产净值比例

2. 积极投资行业分类的股票投资组合

表四: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表五: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

银川新华百货商店股份有限公司 2007年第一季度报告

非经常性损益项目 年初至报告期末金额(元)

表一: 非经常性损益项目 年初至报告期末金额(元)

22 报告期期末股东总数及前十名无限售条件流通股股东持股已完成情况

表二: 报告期期末股东总数及前十名无限售条件流通股股东持股已完成情况

表三: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表四: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表五: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表六: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表七: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表八: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表九: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十一: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十二: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十三: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十四: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十五: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十六: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

武汉马应龙药业集团股份有限公司 2007年第一季度报告

非经常性损益项目 年初至报告期末金额(元)

表一: 非经常性损益项目 年初至报告期末金额(元)

22 报告期期末股东总数及前十名无限售条件流通股股东持股已完成情况

表二: 报告期期末股东总数及前十名无限售条件流通股股东持股已完成情况

表三: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表四: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表五: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表六: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表七: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表八: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表九: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十一: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十二: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十三: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十四: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十五: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

表十六: 前十名无限售条件流通股股东持股情况

华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金 2007年第一季度报告

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 签发日期: 二〇〇七年四月十八日

注: 1. 本基金于 2006 年 4 月 13 日成立, 并于 2006 年 5 月 18 日起在上海证券交易所上市并办理申购、赎回业务。截至本报告期末, 本基金成立不满一年。

2. 本基金以标的指数的成份股、备选成份股为主要投资对象, 投资于指数成份股、备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的 95%。本基金投资在基金合同生效之日起 3 个月的时间达到这一投资比例。

3. 截至本报告期末, 本基金已符合上述投资比例限制。

四、管理人报告 1. 基金经理 卢亦霖 先生, 硕士学位, 9 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) 投资系统部股票基金管理部工作, 参与负责该公司资产管理系统的研发协助基金

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, 任基金投资部基金经理助理, 负责上证 180 交易型开放式指数基金的研究工作。现任上证 180ETF 基金经理。

刘璐 女士: 管理学硕士, 6 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, 2005 年 10 月转入基金投资部协助基金经理日常工作。现任上证 180ETF 基金经理。

3. 基金运作合规性报告 截至 2007 年 3 月 31 日, 本基金份额净值为 6.340 元, 基金份额还原净值为 2.380 元, 自成立以来基金净值增长 139.11%。本报告期 (2007 年 1 月 1 日至 2007 年 3 月 31 日) 基金净值增长 31.64%, 同期上证 180 指数增长 33.37%。本基金收益率与上证 180 指数同期收益率的跟踪误差为 0.124%, 累计跟踪误差为 -1.726%, 与上证 180 指数同期收益率的相关系数也高达 99.893%。

在本报告期内的三个月内, 上证 180ETF 先后经历了三次标的指数成份股的定期调整, 三次标的指数成份股的临时调整 (即 2 月 23 日“中国人寿 (601628)”的临时调整, 2 月 26 日“兴业银行 (601166)”的临时调整和 3 月 15 日“中国平安 (601318)”的临时调整) 以及以工商银行、中国银行、上海机场、歌华有线为代表的央企国企的投融资重组案例的调整, 使得本基金的跟踪精度受到一定影响, 同时管理操作相对于前期一季度也面临较大的挑战。因而在本季度本基金的操作主要集中在上述调整

变更等因素而导致的投资组合调整方面。在操作中, 为了尽可能地降低调整成本和减小对投资组合的冲击, 我们对影响投资组合跟踪精度的相关事件提前进行了分析并制定相应应对方案, 压低了调整的频率和幅度, 顺利完成了投资组合调整工作。由于上证 180ETF 是以紧密跟踪标的指数的指数, 以实现基金投资组合收益率与标的指数的收益率跟踪偏离度和跟踪误差最小化为投资目标, 因此本季度本基金业绩跟踪位同

期跟踪型开放式基金前列, 使“大投资者几乎赚了指数就赚钱”的投资目标。 截止 3 月 30 日, 本基金仓位保持在 99.71% 以上。 在 2007 年第二季度本基金将继续秉承既定的投资目标与投资策略, 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。

五、投资组合报告

表一: 基金资产组合 序号 资产组合 金额(元) 占基金总资产比例

表二: 股票投资组合 序号 股票 金额(元) 占基金总资产比例

表三: 指数股投资组合 行业分类 市值(元) 占资产净值比例

2. 积极投资行业分类的股票投资组合

表四: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表五: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表六: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表七: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表八: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表九: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十一: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十二: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十三: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十四: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十五: 积极投资行业分类的股票投资组合 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

表十六: 积极投资行业分类的股票投资组合 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