# 华安上证180交易型开放式指数证券投资基金 2007年半年度报告摘要

**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**

**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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年8月23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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

**二、基金产品概况**

(一)、基金概况

| | |
|---|---|
| 基金名称: | 华安上证180交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称: | 180ETF |
| 交易代码: | 510180 |
| 深交所行情代码: | 160405 |
| 基金运作方式: | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日: | 2006年4月13日 |
| 期末基金份额总额: | 80,922,674.00份 |
| 基金存续期: | 不定期 |
| 基金上市地点: | 上海证券交易所 |
| 基金上市日期: | 2006年5月18日 |

(二)、基金的投资

| | |
|---|---|
| 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: | 采取抽样复制的指数跟踪方法,即根据定量化的选股指标,选择部分标的指数成份股构建基金股票投资组合,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。 |
| 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,采用抽样复制策略,跟踪上证180指数,是股票基金中风险中等、收益中等的产品。 |

(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 |
| 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: | 021–68604666,40088–50099 |

(四)、基金托管人

| | |
|---|---|
| 基金托管人: | 中国建设银行股份有限公司 |
| 注册地址: | 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 |
| 邮政编码: | 100032 |
| 法定代表人: | 郭树清 |
| 信息披露负责人: | 尹东 |
| 联系电话: | 010–67595104 |
| 传真: | 010–66275853 |
| 电子邮箱: | yindong@ccb.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 |
| 管理人互联网网址: | http://www.huaan.com.cn |
| 基金半年度报告置备地点: | 上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼 |

(六)、注册登记机构

| | |
|---|---|
| 注册登记机构: | 中国证券登记结算有限责任公司 |
| 办公地点: | 中国北京西城区金融大街27号投资广场22层 |

**三、主要财务指标和基金净值表现**

(除特殊注明外,单位:人民币元)

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:基金交易佣金,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(一)、主要财务指标(未经审计)

| 财务指标 | 2007年1月1日至6月30日 |
|---|---|
| 基金本期净收益: | 233,455,340.72 |
| 加权平均基金份额本期净收益: | 2.6934 |
| 期末可供分配基金收益: | 303,403,018.38 |
| 期末可供分配基金份额收益: | 3.7493 |
| 期末基金资产净值: | 673,176,271.10 |
| 期末基金份额净值: | 8.319 |
| 期末还原后基金份额累计净值: | 3.117 |
| 基金加权平均净值收益率: | 39.40% |
| 本期基金份额净值增长率: | 72.74% |
| 基金份额累计净值增长率: | 213.74% |

注:本基金已于2006年5月10日进行了基金份额折算,折算比例为0.37268313。加权平均基金份额以折算后的基金份额为计算标准。还原后基金份额累计净值=(基金份额净值+基金份额累计分红)×折算比例,该净值可反映投资者在认购期以份额面值1.00元购买本基金后的实际份额净值变动情况。

(二)、净值表现

A、本报告期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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -1.88% | 2.85% | -3.25% | 2.93% | 1.37% | -0.08% |
| 过去三个月 | 31.21% | 2.41% | 31.03% | 2.46% | 0.18% | -0.05% |
| 过去六个月 | 72.74% | 2.46% | 74.75% | 2.48% | -2.01% | -0.02% |
| 过去一年 | 163.14% | 1.99% | 162.91% | 2.01% | 0.23% | -0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | 213.74% | 1.93% | 227.34% | 1.97% | -13.60% | -0.04% |

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

180ETF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
2006/4/13—2007/6/30

注: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、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。本基金按规定在基金合同生效之日起3个月的时间内达到这一投资比例。截止本报告期末,本基金符合上述投资比例限制。

**四、管理人报告**

(一)、基金管理人及基金经理简介

(1)基金管理人简介

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。

(2)基金经理简介

卢赤斌 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。现任上证180ETF基金经理。

刘璎 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。

(二)、基金运作合规性声明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《上证180交易型开放式指数证券投资基金合同》、《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。

(三)、基金经理工作报告

截至2007年6月30日,本基金份额净值为8.319元,还原后基金份额累计净值为3.117元,自成立以来基金净值增长213.74%。本报告期(2007年1月1日至2007年6月30日)基金净值增长72.74%,同期上证180指数增长74.75%;本基金收益率与上证180指数同期收益率的跟踪误差为0.105%,累计跟踪偏离度为负的2.01%,与上证180指数同期收益率的相关系数也高达99.92%。

在本报告期内,上证180ETF先后经历了一次标的指数成份股的定期调整、六次标的指数成份股的临时调整(即1月23日"中国人寿(601628)"的临时调入、2月26日"兴业银行(601166)"的临时调入、3月5日"中国平安(601328)"的临时调入、4月30日"中国铝业(601600)"和"巨化股份(600160)"的临时调入、5月18日"中信银行(601998)"的临时调入和5月29日"交通银行(601328)"的临时调入)以及以招商银行、中信证券、浦发银行、民生银行、长江电力、中国平安、贵州茅台、华能国际等等一批大权重股为代表的众多成份股流通股数量的频繁变更,使得本基金的跟踪精度持续受到严重影响,同时管理操作相对于去年也面临更大的挑战。因而在本报告期内本基金的操作主要集中在因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仓成本和减小对投资组合的冲击,我们继续对影响投资组合跟踪精度的相关事件提前进行了分析和判断并制定出相应对策,尽可能地压低了调仓的频率和幅度,顺利完成了投资组合调整工作。由于上证180ETF是以坚持紧密跟踪标的指数,以实现基金投资组合收益率与标的指数收益率跟踪偏离度和跟踪误差最小化为投资目标,因此本报告期内本基金业绩继续位居同期股票型开放式基金前列,使广大投资者实现"赚了指数就赚钱"的投资目标。

截止6月30日,本基金仓位保持在99.28%以上。

在2007年下半年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继续创造长期、稳定的回报。

**五、托管人报告**

中国建设银行股份有限公司根据《华安上证180交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华安上证180交易型开放式指数证券投资基金托管协议》,托管华安上证180交易型开放式指数证券投资基金(以下简称180ETF基金)。

本报告期,中国建设银行股份有限公司在180ETF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,依法安全保管了基金财产,按规定如实、独立地向中国证监会提交了本基金运作情况报告,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。

本报告期,按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,本托管人对基金管理人–华安基金管理有限公司在180ETF基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

由180ETF基金管理人–华安基金管理有限公司编制,并经本托管人复核审查的本报告中的财务指标、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真实、准确和完整。

**六、财务会计报告(未经审计)**

(除特殊注明外,单位:人民币元)

(一)、资产负债表

| 项　目 | 附注 | 2007年6月30日 | 2006年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 5,163,077.39 | 2,212,470.74 |
| 清算备付金 | | 416,372.92 | 105,780.73 |
| 交易保证金 | | 0.00 | 0.00 |
| 应收证券清算款 | | 0.00 | 2,375,217.63 |
| 应收股利 | | 578,071.81 | 0.00 |
| 应收利息 | | 1,281.94 | 658.32 |
| 应收申购款 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他应收款 | | 0.00 | 0.00 |
| 股票投资市值 | | 668,976,884.50 | 395,418,228.48 |
| 其中:股票投资成本 | | 437,308,605.87 | 247,404,265.28 |
| 债券投资市值 | | 0.00 | 0.00 |
| 其中:债券投资成本 | | 0.00 | 0.00 |
| 权证投资市值 | | 0.00 | 0.00 |
| 其中:权证投资成本 | | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售证券 | | 0.00 | 0.00 |
| 待摊费用 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | | 0.00 | 0.00 |
| 资产合计 | | 675,135,688.56 | 400,112,355.90 |
| 负债: | | | |
| 应付证券清算款 | | 1,259,335.05 | 0.00 |
| 应付赎回款 | | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回费 | | 0.00 | 0.00 |
| 应付管理人报酬 | | 287,429.55 | 154,597.82 |
| 应付托管费 | | 57,485.91 | 30,919.58 |
| 应付佣金 | | 97,991.45 | 35,711.26 |
| 应付利息 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他应付款 | | 83,614.60 | 7,870.80 |
| 卖出回购证券款 | | 0.00 | 0.00 |
| 预提费用 | | 173,560.90 | 56,000.00 |
| 负债合计 | | 1,959,417.46 | 285,099.46 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | | 217,135,343.16 | 222,770,157.11 |
| 未实现利得 | | 152,637,909.56 | 96,188,858.34 |
| 未分配收益 | | 303,403,018.38 | 80,868,240.99 |
| 持有人权益合计 | | 673,176,271.10 | 399,827,256.44 |
| 负债和所有者权益合计 | | 675,135,688.56 | 400,112,355.90 |
| 期末基金份额净值 | | 8.319 | 4.816 |

(二)、经营业绩表

| 项　目 | 附注 | 2007年1月1日至2007年6月30日 | 2006年4月13日至2006年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 收入: | | | |
| 股票差价收入 | | 230,338,281.37 | 109,149,493.23 |
| 债券差价收入 | | 0.00 | 0.00 |
| 权证差价收入 | | 1,449,618.83 | 7,071,393.92 |
| 债券利息收入 | | 0.00 | 0.00 |
| 存款利息收入 | | 19,972.04 | 516,823.43 |
| 股利收入 | | 3,510,243.44 | 8,461,163.64 |
| 买入返售证券收入 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他收入 | | 70,942.43 | 50,171.06 |
| 收入合计 | | 235,389,058.11 | 125,249,045.28 |
| 费用: | | | |
| 基金管理人报酬 | 3(4) | 1,466,633.32 | 843,578.66 |
| 基金托管费 | 3(4) | 293,326.67 | 168,715.70 |
| 卖出回购证券支出 | | 0.00 | 0.00 |
| 其他费用 | | 173,757.40 | 116,059.50 |
| 其中:信息披露费 | | 119,012.93 | 72,091.45 |
| 审计费用 | | 24,795.19 | 30,038.17 |
| 上市年费 | | 29,752.78 | 13,508.88 |
| 费用合计 | | 1,933,717.39 | 1,128,353.86 |
| 基金净收益 | | 233,455,340.72 | 124,120,691.42 |
| 加:未实现估值增值变动数 | | 83,630,710.43 | 43,523,480.73 |
| 基金经营业绩 | | 317,086,051.15 | 167,644,172.15 |

(三)、收益分配表

| 项　目 | 附注 | 2007年1月1日至2007年6月30日 | 2006年4月13日至2006年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 本期基金净收益 | | 233,455,340.72 | 124,120,691.42 |
| 加:期初未分配收益 | | 80,868,240.99 | 0.00 |
| 加:本期损益平准金 | | –10,920,563.33 | –55,648,492.91 |
| 可供分配基金净收益 | | 303,403,018.38 | 68,472,198.51 |
| 减:本期已分配基金净收益 | | 0.00 | 0.00 |
| 期末基金未分配净收益 | | 303,403,018.38 | 68,472,198.51 |

(四)、净值变动表

| 项　目 | 附注 | 2007年1月1日至2007年6月30日 | 2006年4月13日至2006年6月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、期初基金净值: | | 399,827,256.44 | 1,072,822,105.00 |
| 二、本期经营活动: | | | |
| 基金净收益 | | 233,455,340.72 | 124,120,691.42 |
| 未实现估值增值变动数 | | 83,630,710.43 | 43,523,480.73 |
| 经营活动产生的净值变动数 | | 317,086,051.15 | 167,644,172.15 |
| 三、本期基金份额交易: | | | |
| 申购基金产生的净值变动数 | | 413,983,417.08 | 39,399,209.29 |
| 赎回基金产生的净值变动数 | | –457,720,453.57 | –901,008,625.98 |
| 基金份额交易产生的净值变动数 | | –43,737,036.49 | –861,609,416.69 |
| 四、本期向持有人分配收益 | | 0.00 | 0.00 |
| 五、期末基金净值 | | 673,176,271.10 | 378,856,860.46 |

(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颁布并于2004年7月1日起实施的《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

除主要税项外,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。

主要税项的变更内容如下:

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‰。

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

(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 |
| 中国建设银行股份有限公司 | 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 | 基金管理人的股东 | | |
| 上海电气(集团)总公司 | 基金管理人的股东 | | |
| 上海广电(集团)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 | | |

(2).通过关联方席位进行的交易

本报告期(2007年1月1日至2007年6月30日)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。

上年度的上半年(2006年4月13日至2006年6月30日)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。

(3).与关联人进行银行间市场债券买卖和回购交易情况:

本报告期(2007年1月1日至2007年6月30日)本基金与关联人未进行银行间市场债券买卖和回购交易。

上年度的上半年(2006年4月13日至2006年6月30日)本基金与关联人未进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(4).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0.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.5%÷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

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需支付基金管理费1,466,633.32元。(2006年4月13日至2006年6月30日:843,578.66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0.1%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×0.1%÷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需支付基金托管费293,326.67元。(2006年4月13日至2006年6月30日:168,715.70元)

(5).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建设银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2007年6月30日保管的本基金银行存款为5,163,077.39元(2006年6月30日:9,605,721.01元)。本报告期所保管的银行存款产生的利息收入18,410.35元(2006年4月13日至2006年6月30日:267,239.86元)。

(6).基金各关联方投资本基金的情况

1、基金管理人运用固有资金对基金的投资

本报告期(2007年1月1日至2007年6月30日)基金管理人未运用固有资金对本基金进行投资。

上年度的上半年(2006年4月13日至2006年6月30日)基金管理人未运用固有资金对本基金进行投资。

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:

本报告期与上年度的上半年(2006年4月13日至2006年6月30日)均无。

4.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列示如下:

本基金截至2007年6月30日持有以下因中国铝业换股吸收合并包头铝业而暂时停牌的股票。此类股票按停牌日最近的股票收盘价估值。

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌估值单价 | 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 601600 | 中国铝业 | 20070612 | 23.08 | 20070703 | 25.39 | 508,653 | 5,830,317.65 | 11,739,711.24 |
| 600472 | 包头铝业 | 20070612 | 26.74 | 20070703 | 29.41 | 61,700 | 806,722.05 | 1,649,858.00 |
| | 合计 | | | | | | 6,637,039.70 | 13,389,569.24 |

(2)、本基金截止本报告期末无流通受限债券。

**七、投资组合报告**

(一)、报告期末基金资产组合

| 序号 | 资产组合 | 金额(元) | 占基金总资产比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 股票 | 668,976,884.50 | 99.09% |
| 2 | 债券 | 0.00 | 0.00% |
| 3 | 权证 | 0.00 | 0.00% |
| 4 | 银行存款和清算备付金合计 | 5,579,450.31 | 0.83% |
| 5 | 其他资产 | 579,353.75 | 0.09% |
| | 合计 | 675,135,688.56 | 100.00% |

(二)、报告期末股票投资组合

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 | 2,458,124.00 | 0.37% |
| B 采掘业 | 47,895,377.96 | 7.11% |
| C 制造业 | 199,956,212.33 | 29.70% |
| C0 食品、饮料 | 25,200,010.11 | 3.74% |
| C1 纺织、服装、皮毛 | 11,405,399.00 | 1.69% |
| C4 石油、化学、塑胶、塑料 | 22,072,473.20 | 3.28% |
| C5 电子 | 6,184,832.80 | 0.92% |
| C6 金属、非金属 | 63,656,460.86 | 9.46% |
| C7 机械、设备、仪表 | 58,801,320.12 | 8.73% |
| C8 医药、生物制品 | 9,159,723.15 | 1.36% |
| C99 其他制造业 | 3,475,993.09 | 0.52% |
| D 电力、煤气及水的生产和供应业 | 48,462,634.22 | 7.20% |
| E 建筑业 | 4,978,388.88 | 0.74% |
| F 交通运输、仓储业 | 59,621,597.61 | 8.86% |
| G 信息技术业 | 30,090,748.60 | 4.47% |
| H 批发和零售贸易 | 21,910,804.10 | 3.25% |
| I 金融、保险业 | 198,570,167.14 | 29.50% |
| J 房地产业 | 22,660,022.72 | 3.37% |
| K 社会服务业 | 7,989,908.40 | 1.19% |
| L 传播与文化产业 | 6,562,073.30 | 0.97% |
| M 综合类 | 17,542,825.24 | 2.61% |
| 合计 | 668,698,884.50 | 99.33% |

2、积极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 |
|---|---|---|
| M 综合类 | 278,000.00 | 0.04% |
| 合计 | 278,000.00 | 0.04% |

(三)、报告期末股票明细

1、指数投资前五名股票明细

| 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 | 600036 | 招商银行 | 1,493,600 | 36,712,688.00 | 5.45% |
| 2 | 600000 | 浦发银行 | 923,466 | 33,789,620.94 | 5.02% |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 563,947 | 29,872,272.59 | 4.44% |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 2,492,134 | 28,485,091.62 | 4.23% |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 282,549 | 20,205,078.99 | 3.00% |

2、积极投资前五名股票明细

| 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 | 600653 | 申华控股 | 50,000 | 278,000.00 | 0.04% |

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

(四)、报告期内股票投资组合的重大变动

1、本期累计买入、累计卖出价值超出期初基金资产净值2%或前二十名股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额(元) | 占期初基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 601318 | 中国平安 | 14,893,886.79 | 3.73% |
| 2 | 600011 | 华能国际 | 11,044,596.89 | 2.76% |
| 3 | 600000 | 浦发银行 | 10,767,216.83 | 2.69% |
| 4 | 601628 | 中国人寿 | 10,097,647.39 | 2.53% |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 8,644,754.71 | 2.16% |
| 6 | 601328 | 交通银行 | 4,831,254.83 | 1.21% |
| 7 | 601998 | 中信银行 | 2,890,696.14 | 0.72% |
| 8 | 601600 | 中国铝业 | 2,819,297.22 | 0.71% |
| 9 | 600030 | 中信证券 | 2,690,867.92 | 0.67% |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 2,678,756.12 | 0.67% |
| 11 | 600010 | 包钢股份 | 2,362,421.32 | 0.59% |
| 12 | 600631 | 百联股份 | 2,215,040.95 | 0.55% |
| 13 | 600166 | 福田汽车 | 2,147,656.33 | 0.54% |
| 14 | 600001 | 邯郸钢铁 | 1,898,650.18 | 0.47% |
| 15 | 600219 | 南山铝业 | 1,888,774.84 | 0.47% |
| 16 | 600900 | 长江电力 | 1,870,522.04 | 0.47% |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 1,518,681.02 | 0.38% |
| 18 | 600583 | 海油工程 | 1,396,707.80 | 0.35% |
| 19 | 600635 | 大众公用 | 1,389,488.59 | 0.35% |
| 20 | 600649 | 原水股份 | 1,291,276.01 | 0.32% |

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额(元) | 占期初基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600036 | 招商银行 | 8,880,736.57 | 2.22% |
| 2 | 600016 | 民生银行 | 4,316,667.42 | 1.08% |
| 3 | 600050 | 中国联通 | 3,013,060.65 | 0.75% |
| 4 | 600019 | 宝钢股份 | 2,969,128.82 | 0.74% |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 2,914,329.66 | 0.73% |
| 6 | 600028 | 中国石化 | 2,839,256.38 | 0.71% |
| 7 | 600005 | 武钢股份 | 2,595,181.94 | 0.65% |
| 8 | 600900 | 长江电力 | 2,387,158.93 | 0.60% |
| 9 | 600009 | 上海机场 | 2,196,629.74 | 0.55% |
| 10 | 600643 | S爱建 | 2,183,613.69 | 0.55% |
| 11 | 601006 | 大秦铁路 | 1,989,638.19 | 0.50% |
| 12 | 600361 | 华联综超 | 1,466,044.91 | 0.37% |
| 13 | 600015 | 华夏银行 | 1,437,380.02 | 0.36% |
| 14 | 600104 | 上海汽车 | 1,271,762.70 | 0.32% |
| 15 | 600497 | 驰宏锌锗 | 1,259,926.20 | 0.32% |
| 16 | 600177 | 雅戈尔 | 1,214,329.39 | 0.30% |
| 17 | 600037 | 歌华有线 | 1,192,035.46 | 0.30% |
| 18 | 600739 | 辽宁成大 | 1,160,433.50 | 0.29% |
| 19 | 600832 | 东方明珠 | 1,084,680.68 | 0.27% |
| 20 | 600690 | 青岛海尔 | 1,081,076.92 | 0.27% |

2、整个报告期内买入股票与申购股票的成本总额及卖出股票与赎回股票的收入总额(元):

| | |
|---|---|
| 买入股票的成本总额*: | 116,213,442.66 |
| 申购股票的成本总额: | 396,545,320.15 |
| 卖出股票的收入总额: | 102,464,075.17 |
| 赎回股票的收入总额: | 450,815,836.00 |

*注:买入股票的成本总额中未扣减股权分置获得的现金对价。

(五)、报告期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末没有持有债券投资。

2、基金投资前五名债券明细

本基金本报告期末没有持有债券投资。

(六)、报告期末权证投资组合

1、基金投资前五名权证明细

本基金本报告期末没有持有权证投资。

(七)、资产支持证券投资组合

本基金本报告期没有投资资产支持证券。

(八)、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,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 | 应收证券清算款 | 0.00 |
| 2 | 应收股利 | 578,071.81 |
| 3 | 应收利息 | 1,281.94 |
| | 合计 | 579,353.75 |

4、处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末没有持有可转换债券投资。

5、整个报告期内获得的权证明细

| 序号 | 权证代码 | 权证名称 | 权证数量(份) | 成本总额(元) | 获得途径 |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 580989 | 南航JTP1 | 611,499 | 0.00 | 股权分置改革被动持有 |

**八、基金份额持有人户数和持有人结构**

(一)、基金份额持有人户数

截止2007年6月30日

| | |
|---|---|
| 基金份额持有人户数 | 3,706户 |
| 平均每户持有基金份额 | 21,823.58份 |

(二)、基金份额持有人结构

截止2007年6月30日

| 项目 | 份额(份) | 占总份额的比例 |
|---|---|---|
| 机构投资者持有的基金份额 | 59,373,965.00 | 73.37% |
| 个人投资者持有的基金份额 | 21,548,709.00 | 26.63% |
| 公司员工持有的基金份额合计 | 0.00 | 0.00% |

(三)、前十名持有人

截止2007年6月30日

| 序号 | 名称 | 份额(份) | 占总份额的比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 中国人寿保险股份有限公司 | 18,697,537.00 | 23.11% |
| 2 | 中国人寿保险(集团)公司 | 14,446,577.00 | 17.85% |
| 3 | 中国太平洋保险公司 | 7,666,615.00 | 9.47% |
| 4 | 中国平安保险(集团)股份有限公司 | 7,453,868.00 | 9.21% |
| 5 | 中信信托投资有限责任公司–光701信托产品 | 3,947,620.00 | 4.88% |
| 6 | 光大证券–工行–光大阳光2号集合资产管理计划 | 2,516,963.00 | 3.11% |
| 7 | 广发证券–招行–广发增强型基金优选集合资产管理计划 | 1,841,000.00 | 2.28% |
| 8 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司 | 777,261.00 | 0.96% |
| 9 | 王宁 | 630,000.00 | 0.78% |
| 10 | 美国友邦保险有限公司上海分公司–投连–个险投连 | 615,600.00 | 0.76% |

**九、开放式基金份额变动**

| | 项目 | 份额(份) |
|---|---|---|
| 1 | 基金合同生效日的基金份额总额 | 1,072,822,105.00 |
| 2 | 基金份额折算减少份额 | 672,999,431.00 |
| 3 | 期初基金份额总额 | 83,022,674.00 |
| 4 | 加:本期申购基金份额总额 | 59,100,000.00 |
| 5 | 减:本期赎回基金份额总额 | 61,200,000.00 |
| 6 | 期末基金份额总额 | 80,922,674.00 |

**十、重大事件**

(一)、基金份额持有人大会决议:无。

(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:

1)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。

2)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。

3)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。

4)本基金管理人于2007年3月14日发布关于基金经理调整的公告:增聘刘璎女士为上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,刘光华先生不再担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,卢赤斌先生仍继续担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

2.本基金托管人在本报告期内没有发生重大人事变动。

(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:无。

(六)、基金改聘为其审计的会计师事务所情况,包括解聘原会计师事务所的原因,以及是否履行了必要的程序:未改聘会计师事务所。

(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)、本报告期间租用证券公司席位情况如下:

1.报告期内租用证券公司席位的变更情况:无

2.交易成交量及佣金情况:

(1).股票及权证交易情况:

| 券商名称 | 租用席位数量 | 股票成交量(元) | 占总成交总量比例 | 权证成交量(元) | 占总成交总量比例 | 佣金(元) | 占总佣金总量比例 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 218,258,006.19 | 100.00% | 1,449,731.25 | 100.00% | 178,971.08 | 100.00% |
| 合　计 | 1 | 218,258,006.19 | 100.00% | 1,449,731.25 | 100.00% | 178,971.08 | 100.00% |

(2).债券及回购交易情况:

本基金本报告期间没有债券及回购交易。

(九)、其他重大事项

| | 其他重要事项 | 披露日期 |
|---|---|---|
| 1) | 华安基金管理有限公司关于临时调整上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告。自2007年1月23日起将"中国人寿"(代码601628)纳入上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股,同时将"天利高新"(代码600339)从上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股调出。 | 2007年1月22日 |
| 2) | 华安基金管理有限公司关于临时调整上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告。自2007年2月26日起将"兴业银行"(代码601166)纳入上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股,同时将"中电广通"(代码600764)从上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股调出。 | 2007年2月16日 |
| 3) | 华安基金管理有限公司关于临时调整上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告。自2007年3月15日起将"中国平安"(代码601318)纳入上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股,同时将"华发股份"(代码600325)从上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股调出。 | 2007年3月15日 |
| 4) | 华安基金管理有限公司关于临时调整上证180交易型开放式指数证券投资基金申购赎回清单成份股公告。自2007年4月30日起将"福田汽车"(代码600166)和"中国铝业"(代码601600)纳入上证180交易型开放式指数证券投资