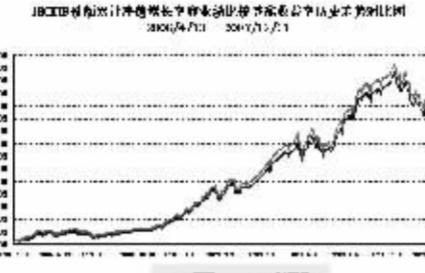


华安上证180交易型开放式指数证券投资基金 2007年第四季度报告

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

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。			
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2008年1月16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。投资人投资于本基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。			
1. 基金产品概况			
基金简称：华安上证180ETF			
交易代码：510180			
深交所上市代码：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：128,322,674.00份			
基金存续期间：不定期			
2. 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，根据基金份额的折算比例，选择部分标的指数成份股为基础的股票投资组合，并通过量化模型确定投资组合中个股的权重，以实现基金组合收益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： 本基金的业绩基准为标的指数：“上证180指数”。			
风险收益特征：本基金属于股票基金，风险与收益高于货币基金、债券基金与货币市场基金。本基金将股票基金、风险与收益高于货币基金、债券基金与货币市场基金。			
风险收益特征：本基金主要投资于股票，风险与收益高于货币基金、债券基金与货币市场基金。			
3. 基金管理人			
基金管理人：华安基金管理有限公司			
4. 基金托管人			
基金管理人：中国建设银行股份有限公司			
三、主要财务指标和基金净值表现			
1. 主要财务指标(未经审计) 单位：元			
序号	财务指标	2007年第4季度	
1	本基金利润总额	-50,961,910.15	
2	本期利润总额/本期公允价值变动损益后的净额	107,021,537.09	
3	加权平均基金份额利润率	-0.439%	
4	本期基金份额净值	1,522,737,921.57	
5	期末基金份额净值	11,896	
6	基金份额净值本期累计净值	4.439	
7. 上述基金的费用指标(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低于预期时，基金管理人将向持有人返还已收取的费用)			
8. 所列数据未包含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低于预期时，基金管理人将向持有人返还已收取的费用			
9. 本期利润总额/本期公允价值变动损益后的净额，原“加权平均基金份额本期净收益”=第2项/(第1项/第3项)			
10. 报告期基金份额总额的变动表现			
阶段 净值 增长率% 净值增长标准差% 业绩比较基准 收益率标准差% ①-③ ②-④			
2007年第4季度	-358% 2.00% -315% 2.02% -0.43% -0.02%		
3. 基金合同生效以来基金份额净值表现			
序号 资产组合 金额(元) 占基金总资产比例			
1	股票 1,478,114,530.09	96.99%	
2	债券 465,212,000	0.03%	
3	权证 207,372.02	0.01%	
4	银行存款和清算备付金合计 31,280,129.88	2.05%	
5	其它资产 13,930,520.04	0.91%	
6	合计 1,523,987,773.93	100.00%	
4. 报告期期末基金资产组合			
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			
1	600030 中信证券 1,105,040	98,649,920.30	6.48%
2	600028 中国石化 4,140,048	97,001,324.64	6.37%
3	600016 民生银行 4,761,134	70,854,406.88	4.65%
4	600009 浦发银行 1,318,566	69,620,284.80	4.57%
5	600036 招商银行 1,741,400	69,011,682.00	4.53%
5. 报告期期末前五名股票明细			
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	601168 西部证券 110,000	4,588,100.00	0.30%
2	601009 南京银行 130,000	2,483,000.00	0.16%
3	600027 中船重工 35,000	1,494,500.00	0.10%
4	600894 杉杉股份 55,000	93,100,100.00	0.06%
5	600390 健康元 30,000	79,900,000.00	0.05%
6. 开放式基金份额变动			
序号 项目 份额(份)			
1	期初基金份额总额 87,522,674.00		
2	加: 本期申购基金份额总额 66,000,000.00		
3	减: 本期赎回基金份额总额 25,200,000.00		
4	期末基金份额总额 128,322,674.00		
7. 备查文件			
1. 上证180交易型开放式指数证券投资基金招募说明书			
2. 上证180交易型开放式指数证券投资基金托管协议			
3. 上述文件的存放地点和查阅方式如下:			
存放地点:基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站http://www.huaxian.com.cn。			
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。			



(二) 报告期末股票投资组合	
1. 按行业分类的股票投资组合	
行业分类	市值(元)
A 农林、牧、渔业	9,965,616.26
B 采掘业	196,951,905.04
C 制造业	363,731,306.42
D 食品、饮料	51,306,802.13
E 纺织、服装、皮革	13,096,556.04
F 石油、化学、塑胶、涂料	30,480,549.89
G 电子	3,196,596.02
C9 金属、非金属	153,459,511.67
C7 机械、设备、仪表	89,127,761.12
C5 医药、生物制品	10,100,450.00
C6 电子元件	2,647,402.89
D 电力、煤气及水的生产和供应业	109,060,020.03
E 建筑业	5,044,894.74
F 交通运输、仓储业	140,064,034.63
G 信息技术业	58,483,647.90
H 批发和零售贸易	36,965,149.62
I 金融、保险业	460,131,218.57
J 制造业、农林牧渔业	49,031,794.19
K 社会服务业	8,377,884.72
L 传播与文化产业	0.00
M 综合类	34,446,746.33
合计	1,467,846,030.09
	94.40%

(三) 报告期末债券投资组合					
1. 按品种分类的债券投资组合					
序号	债券品种				
1	企业债券				
	合计				
	456,212.00				
	0.03%				
2. 基金投资前五名债券明细					
序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	126006	上汽CWB1	22,824	207,372.02	0.01%
3. 报告期内权证及股指期货投资组合					
序号	权证代码	权证名称	数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	680016	上汽CWB1	22,824	207,372.02	0.01%
4. 本报告期内没有权证及股指期货投资。					
5. 基金持有的上证证券交易公告内容截止日(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,未上市股票的权值按0计算。					
6. 本报告期内,本基金的前十名持有人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涉及公开谴责、处罚的情况。					
7. 基金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	580001	上汽CWB1	22,824	182,162.63	0.01%
8. 其他资产					
	其他资产		金额(元)		
			13,921,236.29		
			9,203.75		
	合计		13,930,520.04		
9. 期末持有的上证证券交易权证投资(包括配股权)按公允价值估值。					
10. 本报告期内,本基金没有进行权证及股指期货的交易。					
11. 本报告期内,本基金的前十名持有人不存在投资于超出基金合同规定范围的买卖股票之外的股票。					
12. 本报告期内,本基金没有其他构成影响重大的投资决策。					
13. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
14. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
15. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
16. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
17. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
18. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
19. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
20. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
21. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
22. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
23. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
24. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
25. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
26. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
27. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
28. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
29. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
30. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
31. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
32. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
33. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
34. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
35. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
36. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
37. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
38. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
39. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
40. 本报告期内,本基金没有其他对当期损益有重大影响的事项。					
41. 本报告期内,本基金没有其他					