

华安上证 180 交易型开放式 指数证券投资基金 2009 年半年度报告

2009 年 6 月 30 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 8 月 28 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 2009 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§3	主要财务指标和基金净值表现	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
§4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§5	托管人报告	11
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3	托管人对本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.....	12
§6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
§7	投资组合报告	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	28
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	29
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	36
7.7	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.....	36
7.8	投资组合报告附注.....	36
§8	基金份额持有人信息	37
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	37
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	37
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	38
§9	开放式基金份额变动	38
§10	重大事件揭示	38
10.1	基金份额持有人大会决议.....	38
10.2	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.....	38
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4	基金投资策略的改变.....	39
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8	其他重大事件.....	40
§11	影响投资者决策的其他重要信息	42
§12	备查文件目录	43

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	华安上证 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	2,960,226,740.00 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

注册地址	上海市浦东南路 360 号 新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区金融大街 25 号
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	北京市西城区闹市口大 街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200120	100140
法定代表人	俞妙根	郭树清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	http://www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	5,150,857.41
本期利润	576,130,999.71
加权平均基金份额本期利润	0.8601
本期加权平均净值利润率	53.18%
本期基金份额净值增长率	71.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	934,426,669.71
期末可供分配基金份额利润	0.3157
期末基金资产净值	2,083,036,780.58
期末基金份额净值	0.704
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	172.40%

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）

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

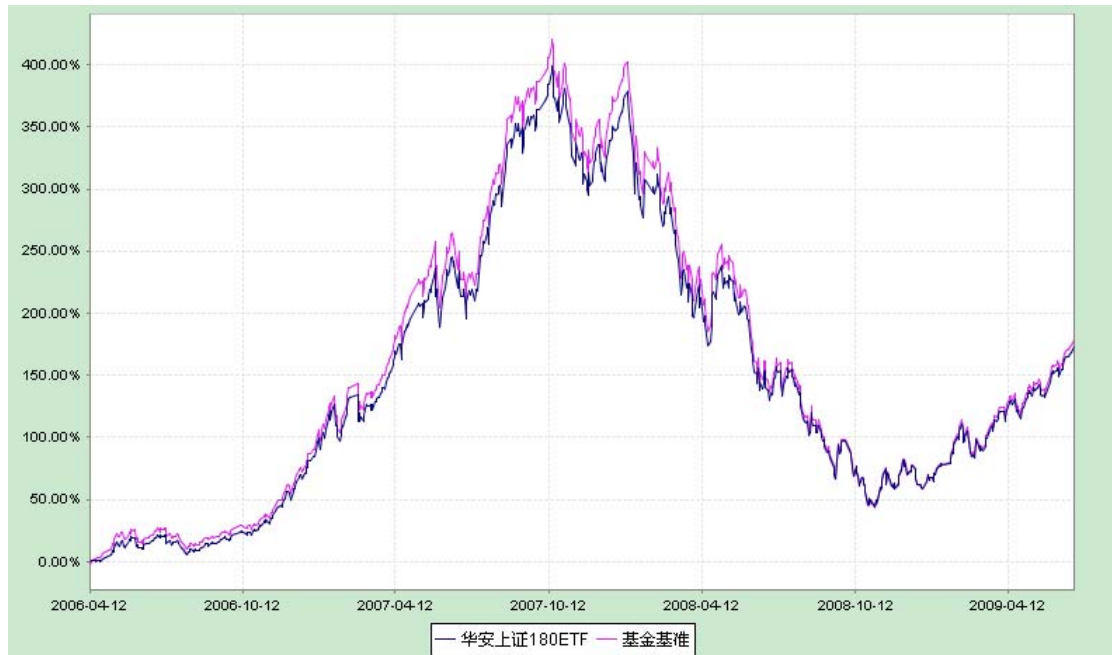
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	15.60%	1.24%	15.66%	1.28%	-0.06%	-0.04%
过去三个月	26.58%	1.52%	26.99%	1.56%	-0.41%	-0.04%
过去六个月	71.72%	1.90%	74.74%	1.97%	-3.02%	-0.07%
过去一年	14.30%	2.51%	12.90%	2.63%	1.40%	-0.12%
过去三年	128.46%	2.38%	122.63%	2.44%	5.83%	-0.06%
自基金合同生效起至今	172.40%	2.33%	177.19%	2.41%	-4.79%	-0.08%

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历史走势对比图

（2006 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 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。

§ 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 2009 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新股票、华安中国 A 股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证 180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安国际配置(QDII) 等 12 只开放式基金，管理资产规模达到 790.62 亿人民币、0.972 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。
刘瓊	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、华安上证 180 交易 型开放式指数证券投资 基金经理助理。2007 年 3 月起担任本基金的基 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合规守信情况的说明

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。2009 年 4 月 13 日，华安上证 180ETF 因申购赎回清单中的预估现金计算出现偏差。为保护投资者利益，公司于当日 13:00 至 15:00，采取了停止基金份额二级市场交易和一级市场申购赎回等措施。除此以外，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、账户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2009年6月30日,本基金份额净值为0.704元,基金份额累计净值为2.696元。本报告期(2009年1月1日至2009年6月30日)基金净值增长71.72%,同期上证180指数上涨74.74%;本基金收益率与上证180指数同期收益率的跟踪误差为0.086%,累计跟踪偏离度为3.02%,与上证180指数同期收益率的相关系数为99.95%。

经历了2008年A股市场大幅下挫后,2009年上半年A股市场出现强劲反弹。受4万亿刺激计划政策推动、宽松货币政策、产业振兴计划、市场充裕流动性和外围市场经济刺激计划等因素影响,国内市场首先是走出一拨独立上涨行情,接着伴随市场信心恢复、交投活跃程度甚至超过2007年,2009年上半年A股市场强劲反弹,A股上半年涨幅在世界主要证券市场位居第一。

按照相关法律文本的规定,上证180ETF基金在4月中旬进行了基金第二次收益分红,每10份基金份额派发现金收益1.49元。为了提高二级市场的流动性,降低中小投资者参与ETF降低交易门槛,随后上证180ETF基金在5月中旬实施了基金份额拆分,权益登记日登记在册的基金份额的拆分比例为10:1。拆分后上证180ETF基金二级市场交易活跃,同时也带动了基金的一级市场申购。

在基金操作上,组合在仓位策略上按照既定策略保持较高的仓位,年初完成基金投资组合标的指数成份股的调整后将股票仓位提升至98%左右。同时结合基金4月分红和5月拆分工作,根据市场实际情况,提高组合仓位的灵活性,以保持基金与指数的高度拟合。基金完成拆分后,一级市场申购赎回、二级市场交易活跃度明显增加;组合仓位始终保持在高仓位98%左右以保持基金与指数高度拟合。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望市场,预期国内各项宏观指标进一步好转,房地产行业作为经济重要组成部分下半年随着新开工增加将进一步复苏;除了政府投资外,民间投资近期也陆续升温。在上半年经济和各项产业政策刺激下,下半年将在实体经济中有所体现,下半年国内经济形势向好。市场普遍预期海外经济,尤其是美国经济下半年复苏概率较大,海外经济复苏带来中国外需的好转。近期A股市场IPO重新开闸,创业板也呼之欲出,证券市场的部分融资功能逐渐显现;A股市场在融资功能方面逐渐有效;A股市场功能也逐步完善。

中长期来看,我们对未来中国经济抱有较强信心。但是外需对中国经济贡献能够完全恢复仍需时间检验,外需相关A股存在一定不确定性;市场上半年大幅上涨后,市场估值逐渐超过历史长期均值,风险正在累积;伴随大盘IPO陆续上市,下半年市场A股流动性将受到冲击,而当前市场上涨动力更多依靠流动性。对此,我们由理由对A股市场保持谨慎。下半年中报和季报为主导因素的市场振荡在所难免,个股分化加剧,行业板块在个股分化后将出现轮动;这无疑对基金运作提出更高要求。

相应地,在操作上,我们将在保持180指数拟合度情况下适当注意仓位灵活选择,密切关注180ETF基金投资组合结构,适当关注市场的阶段性、结构性投资机会。

作为指数基金,本基金将在操作上提高组合与180指数的拟合度,密切国内外经济数据的变化,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。

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：

无。

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：

无。

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：

姓名	职务	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，13 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，现任华安福利基金的基金经理、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检查责任。

(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

在本报告期内实施的利润分配：

向全体持有人按每 10 份基金份额收益分配金额 1.49 元。红利发放的公告日：2009 年 4 月 7 日，权益登记日：2009 年 4 月 10 日，权益除息日：2009 年 4 月 13 日，红利发放日：2009 年 4 月 17 日。

§ 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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 24349979.02 元。

5.3 托管人对本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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	41,766,742.15	28,959,168.80
结算备付金		312,837.28	191,661.79
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.6.2	2,041,230,699.81	796,242,317.13
其中：股票投资		2,041,230,699.81	796,242,317.13
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投 资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		593,457.37	4,131,291.53
应收利息	6.4.6.5	7,877.78	6,013.80
应收股利		597,600.02	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	51,499.18	-
资产总计		2,084,560,713.59	829,530,453.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-

衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
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	6.4.9.2.1	663,989.44	381,190.08
应付托管费	6.4.9.2.2	132,797.90	76,238.03
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	159,271.59	227,392.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	567,874.08	108,050.00
负债合计		1,523,933.01	792,870.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.6.9	794,301,297.95	528,660,062.97
未分配利润	6.4.6.10	1,288,735,482.63	300,077,519.47
所有者权益合计		2,083,036,780.58	828,737,582.44
负债和所有者权益总计		2,084,560,713.59	829,530,453.05

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.704 元，基金份额总额 2,960,226,740.00 份。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

6.2 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
一、收入		579,991,668.17	-805,567,735.41
1. 利息收入		105,815.50	240,848.11
其中：存款利息收入	6.4.6.11	105,815.50	238,314.31
债券利息收入		-	2,533.80
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）		7,418,263.83	-74,693,313.37
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-2,597,573.42	-84,832,551.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	-	121,631.63

资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	525,252.46
股利收益	6.4.6.15	10,015,837.25	9,492,354.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	570,980,142.30	-731,706,496.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	1,487,446.54	591,226.45
二、费用（以“-”号填列）		-3,860,668.46	-6,016,034.85
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	-2,655,492.39	-3,570,424.03
2. 托管费	6.4.9.2.2	-531,098.50	-714,084.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.18	-443,759.73	-1,532,017.50
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.6.19	-230,317.84	-199,508.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		576,130,999.71	-811,583,770.26
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		576,130,999.71	-811,583,770.26

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

6.3 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 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）	528,660,062.97	300,077,519.47	828,737,582.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	576,130,999.71	576,130,999.71
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）	265,641,234.98	436,876,942.47	702,518,177.45
其中：1. 基金申购款	1,534,279,370.63	1,900,444,780.32	3,434,724,150.95
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,268,638,135.65	-1,463,567,837.85	-2,732,205,973.50
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）	-	-24,349,979.02	-24,349,979.02
五、期末所有者权益（基金净值）	794,301,297.95	1,288,735,482.63	2,083,036,780.58
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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）	-	-811,583,770.26	-811,583,770.26
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）	123,965,909.22	267,732,163.92	391,698,073.14
其中：1. 基金申购款	344,528,630.80	749,211,416.55	1,093,740,047.35
2. 基金赎回款	-220,562,721.58	-481,479,252.63	-702,041,974.21
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）	468,287,055.26	634,565,169.19	1,102,852,224.45

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 30 号《关于同意上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,072,807,826.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 35 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,072,822,105.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,279.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为了与上证 180 指数进行对比,根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,华安基金管理有限公司确定 2006 年 5 月 10 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 指数收盘值为 2,919.214 点,本基金资产净值为 1,167,168,017.51 元,折算前基金份额总额为 1,072,822,105.00 份,折算前基金份额净值为 1.088 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.37268313,折算后基金份额总额为 399,822,674.00 份,折算后基金份额净值为 2.919 元。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2006 年 5 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2006]第 39 号文审核同意,本基金 399,822,674.00 份基金份额于 2006 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的主要投资范围为标的指数上证 180 指数的成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;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他金融

工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：上证 180 指数。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2009 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

- (e) 卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）
活期存款	41,766,742.15
定期存款	-
其他存款	-
合计	41,766,742.15

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）		
	成本	公允价值	估值增值
股票	1,834,484,639.08	2,041,230,699.81	206,746,060.73
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,834,484,639.08	2,041,230,699.81	206,746,060.73

注：本报告期末股票公允价值包括可退替代款估值 4,367.00 元。

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

6.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末(2009年6月30日)买入返售金融资产余额为零。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 (2009 年 6 月 30 日)
应收活期存款利息	7,779.23
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	98.55
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	7,877.78

6.4.6.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 (2009 年 6 月 30 日)
其他应收款	-
待摊费用	51,499.18
合计	51,499.18

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 (2009 年 6 月 30 日)
交易所市场应付交易费用	159,271.59
银行间市场应付交易费用	-
合计	159,271.59

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 (2009 年 6 月 30 日)
应付券商交易单元保证金	-
预提费用	208,273.08
应付替代款	27,879.30
可退替代款	331,721.70
合计	567,874.08

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	197,022,674.00	528,660,062.97
本期申购	328,800,000.00	882,250,886.46
本期赎回	-358,200,000.00	-961,138,283.03
2009 年 5 月 19 日基金拆分前	167,622,674.00	449,772,666.40

基金拆分变动份额	1,508,604,066.00	-
本期申购	2,430,000,000.00	652,028,484.17
本期赎回	-1,146,000,000.00	-307,499,852.62
本期末	2,960,226,740.00	794,301,297.95

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	650,524,922.31	-350,447,402.84	300,077,519.47
本期利润	5,150,857.41	570,980,142.30	576,130,999.71
本期基金份额交易产生的变动数	303,100,869.01	133,776,073.46	436,876,942.47
其中：基金申购款	1,649,163,872.21	251,280,908.11	1,900,444,780.32
基金赎回款	-1,346,063,003.20	-117,504,834.65	-1,463,567,837.85
本期已分配利润	-24,349,979.02	-	-24,349,979.02
本期末	934,426,669.71	354,308,812.92	1,288,735,482.63

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
活期存款利息收入	103,836.87
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,978.63
其他	-
合计	105,815.50

6.4.6.12 股票投资收益

6.4.6.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
股票投资收益——买卖股票差价收入	-17,554,231.63
股票投资收益——赎回差价收入	14,956,658.21
合计	-2,597,573.42

6.4.6.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
卖出股票成交总额	105,409,839.47
卖出股票成本总额	-122,964,071.10
买卖股票差价收入	-17,554,231.63

注：本基金于本年度与上年度均未获得股权分置改革中由流通股股东支付的现金对价。

6.4.6.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
赎回基金份额对价总额	2,732,205,973.50
现金支付赎回款总额	-40,713,538.50
赎回股票成本总额	-2,676,535,776.79
赎回差价收入	14,956,658.21

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
卖出债券成交金额	-
卖出债券成本总额	-
应收利息总额	-
债券投资收益	-

6.4.6.14 衍生工具收益

6.4.6.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
卖出权证成交金额	-
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
股票投资产生的股利收益	10,015,837.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	10,015,837.25

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
1. 交易性金融资产	
——股票投资	570,980,142.30
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	
——权证投资	-
合计	570,980,142.30

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
基金赎回费收入	-
印花税返还	2,450.15
ETF 替代损益*	1,484,996.39
合计	1,487,446.54

*注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
交易所市场交易费用	443,759.73
银行间市场交易费用	-
合计	443,759.73

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
信息披露费	128,931.73
审计费用	49,588.57
上市年费	29,752.78
分红手续费	21,550.76
其他	494.00
合计	230,317.84

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

无。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本报告期通过关联人交易单元的股票成交量：无。

上年度可比期间通过关联人交易单元的股票成交量：无。

6.4.9.1.2 权证交易

本报告期通过关联人交易单元的权证成交量：无。

上年度可比期间通过关联人交易单元的权证成交量：无。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期应支付关联方的佣金：无。

上年度可比期间应支付关联方的佣金：无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)	上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)
当期应支付的管理费	2,655,492.39	3,570,424.03
其中：当期已支付	1,991,502.95	3,055,840.27
期末未支付	663,989.44	514,583.76

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)	上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)
当期应支付的托管费	531,098.50	714,084.84
其中：当期已支付	398,300.60	611,168.09
期末未支付	132,797.90	102,916.75

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。

6.4.9.3 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。

上年度可比期间与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易：无。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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。

上年度可比期间基金管理人运用固有资金投资本基金的情况：无。

6.4.9.4.2 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。

上年度可比期间末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况：无。

6.4.9.5 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(2009年1月1日至2009年6月30日)		上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30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	41,766,742.15	103,836.87	47,145,986.75	234,624.87

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2009年6月30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(2008年6月30日：同)。

6.4.9.6 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。

6.4.10 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
1	2009-4-10	2009-4-13	1.490	24,349,979.02	-	24,349,979.02	-

6.4.11 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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2009年6月30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。

6.4.11.2 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
600161	天坛生物	2009年6月29日	公司股票并购重组	22.60	2009年7月2日	24.86	163,413	3,370,132.62	3,693,133.80
600115	ST东航	2009年6月8日	联合重组	5.33	2009年7月13日	5.60	273,047	1,496,335.54	1,455,340.51

600591	*ST 上航	2009 年 6 月 8 日	联合重 组	5.92	2009 年 7 月 13 日	6.22	220,824	1,198,986.50	1,307,278.08
--------	--------	----------------	----------	------	-----------------	------	---------	--------------	--------------

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无正回购余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%，若本基金完全按照标的指数的构成比例进行投资的，则本基金不受上述比例限制的约束。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除附注期末本基金持有的流通受限证券中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金将不高于基金资产净值 5% 的资产投资于交易所交易的固定收益品种。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 6 月 30	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------------	-------	---------	-------	-----	----

日					
资产					
银行存款	41,766,742.15	-	-	-	41,766,742.15
结算备付金	312,837.28	-	-	-	312,837.28
交易性金融资产	-	-	-	2,041,230,699.81	2,041,230,699.81
应收证券清算款	-	-	-	593,457.37	593,457.37
应收利息	-	-	-	7,877.78	7,877.78
应收股利	-	-	-	597,600.02	597,600.02
其他资产	-	-	-	51,499.18	51,499.18
资产总计	42,079,579.43	-	-	2,042,481,134.16	2,084,560,713.59
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	663,989.44	663,989.44
应付托管费	-	-	-	132,797.90	132,797.90
应付交易费用	-	-	-	159,271.59	159,271.59
其他负债	-	-	-	567,874.08	567,874.08
负债总计	-	-	-	1,523,933.01	1,523,933.01
利率敏感度缺口	42,079,579.43	-	-	2,040,957,201.15	2,083,036,780.58
上年度末 2008 年 12 月 31 日					
	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	28,959,168.80	-	-	-	28,959,168.80
结算备付金	191,661.79	-	-	-	191,661.79
交易性金融资产	-	-	-	796,242,317.13	796,242,317.13
应收证券清算款	-	-	-	4,131,291.53	4,131,291.53
应收利息	-	-	-	6,013.80	6,013.80
资产总计	29,150,830.59	-	-	800,379,622.46	829,530,453.05
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	381,190.08	381,190.08
应付托管费	-	-	-	76,238.03	76,238.03
应付交易费用	-	-	-	227,392.50	227,392.50
其他负债	-	-	-	108,050.00	108,050.00
负债总计	-	-	-	792,870.61	792,870.61
利率敏感度缺口	29,150,830.59	-	-	799,586,751.85	828,737,582.44

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2008 年 12 月 31 日：本基金未持有交易性债券投资)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.12.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中，上证 180 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及及其它金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。

6.4.12.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）		上年度末（2008年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	2,041,230,699.81	97.99	796,242,317.13	96.08
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,041,230,699.81	97.99	796,242,317.13	96.08

6.4.12.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
分析		本期末（2009年6月30日）	上年度末（2008年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 10,000	增加约 4,102
	业绩比较基准下降 5%	下降约 9,900	下降约 4,102

§ 7 投资组合报告

7.1 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	2,041,230,699.81	97.92
	其中：股票	2,041,230,699.81	97.92
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	42,079,579.43	2.02
6	其他资产	1,250,434.35	0.06
7	合计	2,084,560,713.59	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	13,623,137.09	0.65
B	采掘业	269,803,572.01	12.95
C	制造业	347,660,872.48	16.69
C0	食品、饮料	49,233,912.41	2.36
C1	纺织、服装、皮毛	15,961,666.88	0.77
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	22,270,546.04	1.07
C5	电子	7,792,759.12	0.37
C6	金属、非金属	124,093,924.96	5.96
C7	机械、设备、仪表	94,489,633.48	4.54
C8	医药、生物制品	24,701,907.98	1.19
C99	其他制造业	9,116,521.61	0.44
D	电力、煤气及水的生产和供应业	91,065,946.74	4.37
E	建筑业	49,538,820.08	2.38
F	交通运输、仓储业	127,004,048.00	6.10

G	信息技术业	50,360,933.89	2.42
H	批发和零售贸易	58,196,152.37	2.79
I	金融、保险业	836,602,670.50	40.16
J	房地产业	108,997,837.18	5.23
K	社会服务业	18,939,099.67	0.91
L	传播与文化产业	4,499,673.36	0.22
M	综合类	54,499,794.56	2.62
	合计	2,030,792,557.93	97.49

7.2.2 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,271,400.00	0.06
B	采掘业	-	-
C	制造业	8,170,371.68	0.39
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	682,500.00	0.03
C7	机械、设备、仪表	6,435,771.68	0.31
C8	医药、生物制品	1,052,100.00	0.05
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	992,003.20	0.05
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	10,433,774.88	0.50

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有积极投资股票明细

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	占基金资产净值
----	------	------	--------	------	---------

					比例 (%)
1	601766	中国南车	1,216,592	6,435,771.68	0.31
2	600438	通威股份	130,000	1,271,400.00	0.06
3	600867	通化东宝	90,000	1,052,100.00	0.05
4	600498	烽火通信	60,488	992,003.20	0.05
5	600022	济南钢铁	150,000	682,500.00	0.03

7.3.2 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有指数投资股票明细

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	占基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	5,341,181	119,695,866.21	5.75
2	601318	中国平安	1,807,825	89,415,024.50	4.29
3	600016	民生银行	11,234,088	88,973,976.96	4.27
4	601166	兴业银行	2,387,906	88,615,191.66	4.25
5	601328	交通银行	9,304,774	83,836,013.74	4.02
6	600000	浦发银行	3,584,811	82,522,349.22	3.96
7	600030	中信证券	2,890,468	81,684,625.68	3.92
8	601088	中国神华	2,042,201	61,082,231.91	2.93
9	601398	工商银行	9,078,088	49,203,236.96	2.36
10	601169	北京银行	2,609,934	42,437,526.84	2.04
11	600050	中国联通	5,146,579	35,305,531.94	1.69
12	601857	中国石油	2,370,015	34,317,817.20	1.65
13	600519	贵州茅台	215,678	31,922,500.78	1.53
14	600900	长江电力	2,224,106	30,648,180.68	1.47
15	600028	中国石化	2,569,252	27,388,226.32	1.31
16	601006	大秦铁路	2,379,513	25,199,042.67	1.21
17	601628	中国人寿	894,292	24,637,744.60	1.18
18	601601	中国太保	988,514	22,122,943.32	1.06
19	600048	保利地产	791,065	22,062,802.85	1.06
20	600019	宝钢股份	3,118,570	21,954,732.80	1.05
21	601390	中国中铁	3,177,184	21,573,079.36	1.04
22	600383	金地集团	1,329,528	21,431,991.36	1.03
23	601186	中国铁建	1,839,306	18,926,458.74	0.91
24	600739	辽宁成大	571,117	18,915,395.04	0.91
25	601919	中国远洋	1,358,909	18,440,395.13	0.89
26	601988	中国银行	3,831,400	17,202,986.00	0.83
27	600089	特变电工	863,099	15,570,305.96	0.75
28	600015	华夏银行	1,234,290	15,465,653.70	0.74
29	600005	武钢股份	1,940,796	15,293,472.48	0.73
30	600018	上港集团	2,580,721	14,787,531.33	0.71

31	600489	中金黄金	219,808	14,480,951.04	0.70
32	601600	中国铝业	1,159,593	14,112,246.81	0.68
33	600550	天威保变	386,257	13,781,649.76	0.66
34	600585	海螺水泥	310,427	13,081,393.78	0.63
35	600011	华能国际	1,637,246	13,032,478.16	0.63
36	601009	南京银行	721,659	12,982,645.41	0.62
37	601899	紫金矿业	1,250,600	12,756,120.00	0.61
38	600547	山东黄金	204,000	12,260,400.00	0.59
39	601898	中煤能源	978,851	12,079,021.34	0.58
40	600104	上海汽车	794,508	11,877,894.60	0.57
41	601666	平煤股份	407,379	11,777,326.89	0.57
42	600795	国电电力	1,656,987	11,549,199.39	0.55
43	600031	三一重工	388,889	11,188,336.53	0.54
44	601699	潞安环能	280,300	11,069,047.00	0.53
45	600320	振华重工	1,022,869	10,637,837.60	0.51
46	601168	西部矿业	694,250	10,580,370.00	0.51
47	600649	城投控股	716,509	9,880,659.11	0.47
48	600832	东方明珠	880,194	9,620,520.42	0.46
49	600583	海油工程	807,688	9,554,949.04	0.46
50	600895	张江高科	615,209	9,529,587.41	0.46
51	600177	雅戈尔	683,400	9,424,086.00	0.45
52	601958	金铂股份	577,081	9,319,858.15	0.45
53	600348	国阳新能	303,543	9,215,565.48	0.44
54	600009	上海机场	587,932	9,030,635.52	0.43
55	600325	华发股份	396,747	8,962,514.73	0.43
56	601333	广深铁路	1,749,415	8,939,510.65	0.43
57	600642	申能股份	885,132	8,727,401.52	0.42
58	600635	大众公用	717,509	8,402,030.39	0.40
59	601998	中信银行	1,362,947	8,136,793.59	0.39
60	600875	东方电气	202,133	7,862,973.70	0.38
61	600309	烟台万华	491,337	7,748,384.49	0.37
62	600675	中华企业	481,242	7,680,622.32	0.37
63	600663	陆家嘴	297,865	7,610,450.75	0.37
64	600881	亚泰集团	939,483	7,450,100.19	0.36
65	601001	大同煤业	201,000	7,312,380.00	0.35
66	600123	兰花科创	205,794	7,258,354.38	0.35
67	600690	青岛海尔	532,563	7,061,785.38	0.34
68	600808	马钢股份	1,392,010	6,737,328.40	0.32
69	600196	复星医药	463,701	6,719,027.49	0.32
70	600362	江西铜业	199,137	6,704,942.79	0.32
71	600001	邯郸钢铁	1,180,420	6,574,939.40	0.32

72	601111	中国国航	935,612	6,567,996.24	0.32
73	601866	中海集运	1,467,922	6,473,536.02	0.31
74	600655	豫园商城	371,157	6,413,592.96	0.31
75	600100	同方股份	406,499	6,398,294.26	0.31
76	600010	宝钢股份	1,552,932	6,149,610.72	0.30
77	600717	天津港	505,494	6,131,642.22	0.29
78	600694	大商股份	185,085	6,068,937.15	0.29
79	600029	南方航空	1,116,218	6,049,901.56	0.29
80	601588	北辰实业	1,002,900	6,047,487.00	0.29
81	601808	中海油服	367,814	5,954,908.66	0.29
82	600331	宏达股份	372,086	5,912,446.54	0.28
83	600188	兖州煤业	373,914	5,833,058.40	0.28
84	600153	建发股份	418,191	5,658,124.23	0.27
85	600111	宝钢稀土	290,485	5,629,599.30	0.27
86	600528	中铁二局	462,852	5,424,625.44	0.26
87	600872	中炬高新	459,907	5,390,110.04	0.26
88	600208	新湖中宝	474,623	5,292,046.45	0.25
89	600748	上实发展	302,503	5,227,251.84	0.25
90	600611	大众交通	386,751	5,190,198.42	0.25
91	600631	百联股份	396,600	5,179,596.00	0.25
92	600598	北大荒	403,005	5,130,253.65	0.25
93	600660	福耀玻璃	623,340	5,117,621.40	0.25
94	600058	五矿发展	277,998	5,084,583.42	0.24
95	600026	中海发展	392,020	5,060,978.20	0.24
96	600150	中国船舶	79,653	5,054,779.38	0.24
97	600811	东方集团	587,321	4,986,355.29	0.24
98	600500	中化国际	419,064	4,978,480.32	0.24
99	600688	S 上石化	592,137	4,932,501.21	0.24
100	601872	招商轮船	846,022	4,847,706.06	0.23
101	600220	江苏阳光	773,868	4,767,026.88	0.23
102	600643	爱建股份	365,663	4,742,649.11	0.23
103	600600	青岛啤酒	177,064	4,708,131.76	0.23
104	600216	浙江医药	174,281	4,642,845.84	0.22
105	600256	广汇股份	294,593	4,530,840.34	0.22
106	600037	歌华有线	390,936	4,499,673.36	0.22
107	600601	方正科技	1,046,463	4,489,326.27	0.22
108	600432	吉恩镍业	198,946	4,486,232.30	0.22
109	600108	亚盛集团	883,292	4,416,460.00	0.21
110	600497	驰宏锌锗	211,380	4,183,210.20	0.20
111	600428	中远航运	396,812	4,114,940.44	0.20
112	600812	华北制药	485,300	4,081,373.00	0.20

113	600269	赣粤高速	368,072	4,026,707.68	0.19
114	600886	国投电力	385,456	4,020,306.08	0.19
115	600887	*ST 伊利	267,651	3,963,911.31	0.19
116	600638	新黄浦	279,664	3,878,939.68	0.19
117	600653	中华控股	845,292	3,871,437.36	0.19
118	600839	四川长虹	800,731	3,771,443.01	0.18
119	600879	火箭股份	269,674	3,702,624.02	0.18
120	600161	天坛生物	163,413	3,693,133.80	0.18
121	600674	川投能源	198,771	3,685,214.34	0.18
122	600096	云天化	164,455	3,677,213.80	0.18
123	600266	北京城建	212,377	3,614,656.54	0.17
124	600737	中粮屯河	288,364	3,500,738.96	0.17
125	600008	首创股份	518,724	3,397,642.20	0.16
126	600508	上海能源	185,600	3,379,776.00	0.16
127	600779	水井坊	203,985	3,373,911.90	0.16
128	600158	中体产业	355,277	3,360,920.42	0.16
129	601918	国投新集	199,200	3,284,808.00	0.16
130	601991	大唐发电	397,402	3,222,930.22	0.15
131	600219	南山铝业	313,889	3,217,362.25	0.15
132	600064	南京高科	160,476	3,119,653.44	0.15
133	600027	华电国际	577,542	3,014,769.24	0.14
134	600138	中青旅	281,885	3,007,712.95	0.14
135	600755	厦门国贸	208,135	2,945,110.25	0.14
136	600816	安信信托	169,500	2,900,145.00	0.14
137	600085	同仁堂	170,373	2,836,710.45	0.14
138	600823	世茂股份	190,943	2,785,858.37	0.13
139	600357	承德钒钛	330,200	2,776,982.00	0.13
140	600109	国金证券	120,794	2,692,498.26	0.13
141	600236	桂冠电力	337,879	2,676,001.68	0.13
142	600307	酒钢宏兴	196,200	2,666,358.00	0.13
143	600456	宝钛股份	115,728	2,650,171.20	0.13
144	600804	鹏博士	321,886	2,649,121.78	0.13
145	600052	浙江广厦	243,853	2,623,858.28	0.13
146	600251	冠农股份	105,097	2,610,609.48	0.13
147	600117	西宁特钢	254,485	2,583,022.75	0.12
148	600770	综艺股份	183,968	2,557,155.20	0.12
149	600641	万业企业	248,894	2,493,917.88	0.12
150	600533	栖霞建设	360,100	2,484,690.00	0.12
151	600210	紫江企业	442,401	2,481,869.61	0.12
152	600033	福建高速	368,547	2,469,264.90	0.12
153	600747	大连控股	402,207	2,385,087.51	0.11

154	600183	生益科技	350,505	2,365,908.75	0.11
155	600151	航天机电	188,990	2,328,356.80	0.11
156	600322	天房发展	389,286	2,316,251.70	0.11
157	600685	广船国际	101,140	2,252,387.80	0.11
158	600797	浙大网新	388,147	2,150,334.38	0.10
159	600221	海南航空	391,367	2,101,640.79	0.10
160	600837	海通证券	123,240	2,027,298.00	0.10
161	600639	浦东金桥	136,297	2,010,380.75	0.10
162	600376	首开股份	90,121	1,906,960.36	0.09
163	600162	香江控股	211,773	1,823,365.53	0.09
164	600851	海欣股份	352,700	1,770,554.00	0.08
165	600127	金健米业	279,670	1,764,717.70	0.08
166	601003	柳钢股份	290,610	1,708,786.80	0.08
167	600380	健康元	259,404	1,673,155.80	0.08
168	600171	上海贝岭	274,535	1,636,228.60	0.08
169	600723	西单商场	179,700	1,554,405.00	0.07
170	600467	好当家	210,002	1,465,813.96	0.07
171	600115	ST 东航	273,047	1,455,340.51	0.07
172	600289	亿阳信通	117,640	1,414,032.80	0.07
173	600830	香溢融通	188,400	1,397,928.00	0.07
174	600110	中科英华	187,777	1,342,605.55	0.06
175	600591	*ST 上航	220,824	1,307,278.08	0.06
176	600007	中国国贸	112,640	1,306,624.00	0.06
177	600488	天药股份	141,890	1,055,661.60	0.05
178	600072	中船股份	48,540	804,793.20	0.04
179	600764	中电广通	96,701	603,414.24	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601328	交通银行	31,369,301.50	3.79
2	600036	招商银行	14,766,716.86	1.78
3	601169	北京银行	14,248,226.44	1.72
4	600016	民生银行	11,491,268.86	1.39
5	601318	中国平安	9,716,177.80	1.17
6	601186	中国铁建	7,125,034.00	0.86
7	601919	中国远洋	6,481,228.52	0.78

8	601766	中国南车	6,410,273.92	0.77
9	600875	东方电气	5,111,759.50	0.62
10	601898	中煤能源	5,067,135.40	0.61
11	601899	紫金矿业	4,971,034.00	0.60
12	601088	中国神华	4,525,244.28	0.55
13	601958	金铂股份	4,424,342.00	0.53
14	600030	中信证券	3,517,405.00	0.42
15	601699	潞安环能	3,406,498.00	0.41
16	601168	西部矿业	3,361,971.00	0.41
17	600655	豫园商城	2,957,572.20	0.36
18	600383	金地集团	2,946,082.00	0.36
19	600000	浦发银行	2,709,852.00	0.33
20	600150	中国船舶	2,432,438.21	0.29

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600000	浦发银行	7,913,749.74	0.95
2	600030	中信证券	7,605,395.00	0.92
3	600519	贵州茅台	4,948,083.00	0.60
4	601398	工商银行	4,648,476.00	0.56
5	600028	中国石化	4,300,065.57	0.52
6	600900	长江电力	4,092,500.00	0.49
7	600036	招商银行	3,845,600.00	0.46
8	600887	*ST 伊利	3,630,730.00	0.44
9	601088	中国神华	3,051,500.00	0.37
10	600050	中国联通	2,969,150.00	0.36
11	600019	宝钢股份	2,870,720.00	0.35
12	600795	国电电力	1,854,940.00	0.22
13	600583	海油工程	1,824,950.00	0.22
14	601006	大秦铁路	1,767,330.00	0.21
15	601988	中国银行	1,626,400.00	0.20
16	600015	华夏银行	1,563,117.00	0.19
17	600011	华能国际	1,463,040.00	0.18
18	600110	中科英华	1,427,000.00	0.17
19	600005	武钢股份	1,348,586.00	0.16
20	600267	海正药业	1,322,134.00	0.16

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。

7.4.3 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	216,054,214.43
卖出股票收入（成交）总额	105,409,839.47

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。

7.5 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。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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。

7.8.3 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	593,457.37
3	应收股利	597,600.02
4	应收利息	7,877.78
5	应收申购款	-
6	待摊费用	51,499.18
7	其他	-
8	合计	1,250,434.35

7.8.4 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。

7.8.5 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

本基金本报告期末积极投资、指数投资前五名股票未出现流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息
8.1 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
35,649	83,038.14	1,634,164,291.00	55.20%	1,326,062,449.00	44.80%

8.2 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	哈佛大学	141,700,000.00	4.79%
2	光大永明人寿保险有限公司—投连一个险投连	137,449,942.00	4.64%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	123,081,079.00	4.16%
4	中融国际信托有限公司—双重精选 2 号	113,532,100.00	3.84%
5	中国人民人寿保险股份有限公司—万能—一个险万能	109,997,270.00	3.72%
6	华泰证券—招行—华泰紫金 2 号集合资产管理计划	109,608,309.00	3.70%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	64,000,000.00	2.16%
8	中国工商银行企业年金中金公司定向资产管理—中国工商银行	59,999,964.00	2.03%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—团体分红	59,732,000.00	2.02%
10	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—013C—CT001 沪	58,999,928.00	1.99%

8.3 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	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	97,000.00	0.0033%

§ 9 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	197,022,674.00
报告期期间基金总申购份额	2,758,800,000.00
报告期期间基金总赎回份额	1,504,200,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	1,508,604,066.00
报告期期末基金份额总额	2,960,226,740.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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. 基金管理人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2009 年 1 月 12 日，基金管理人发布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，基金管理人发布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。

2009 年 7 月 3 日，基金管理人发布了增聘基金经理助理的公告，增聘熊志勇先生担任华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金（简称：华安上证 180ETF）基金经理助理，协助该基金之基金经理卢赤斌先生、刘璎女士进行该基金的投资运作。

2009 年 8 月 3 日，基金管理人发布了基金经理暂停职务的公告，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金（简称：华安中国 A 股增强指数）和华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金（简称：华安上证 180ETF）的基金经理刘璎女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，本公司根据有关法规和公司制度批准刘璎女士于 2009 年 8 月 3 日开始休产假，本次休假暂定持续至 2009 年 12 月 18 日。在此期间，刘璎女士所任职的华安中国 A 股增强指数基金由该基金的另一基金经理许之彦先生和基金经理助理牛勇先生继续管理，华安上证 180ETF 基金由该基金的另一基金经理卢赤斌先生和基金经理助理熊志勇先生继续管理。

2. 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	321,464,053.90	100%	273,244.19	100%	
合计	1	321,464,053.90	100%	273,244.19	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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于新增国元证券股份有限公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-16]
2	关于新增国都证券有限责任公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-16]
3	关于新增中国建银投资证券有限责任公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-17]
4	关于新增红塔证券股份有限公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-18]
5	关于新增江南证券有限责任公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-7]
6	关于新增中信金通有限责任公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-13]

7	关于新增湘财证券有限责任公司代销上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-6-10]
8	关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金实施份额拆分和修改基金合同的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-13]
9	关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金实施份额拆分和修改基金合同的提示性公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-18]
10	上证 180 交易型开放式指数证券投资基金第二次收益分配公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-4-7]
11	关于提请投资者及时更新身份证明文件的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-2-14]
12	关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金临时停牌的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-4-14]
13	关于恢复旗下基金持有的“长江电力”股票进行市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-19]
14	关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金份额拆分结果的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-20]
15	关于上证 180 交易型开放式指数证券投资基金恢复交易和申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网	[2009-5-21]

		站	
--	--	---	--

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009 年 1 月 16 日，本基金托管人公告聘请胡哲一先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。
- 2、2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书
- 3、2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书
- 4、2009 年 5 月 26 日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书
- 5、2009 年 8 月 2 日，本基金托管人公告，自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任中国建设银行股份有限公司执行董事。
- 6、2009 年 7 月 31 日基金份额总额：5,087,226,740.00 份。

§ 12 备查文件目录

备查文件目录

- 1、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》
- 2、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 3、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 4、《关于核准上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的批复》；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

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.huaan.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。

华安基金管理有限公司

2009 年 8 月 28 日