

华安上证 180 指数增强型证券投资基金

投资组合公告

(2004 年第 1 号)

一、重要提示

本基金为指数增强型基金，采用增强性指数化投资方法。

本基金的托管人中国工商银行已于 2004 年 4 月 12 日复核了本公告。

截止 2004 年 3 月 31 日，华安上证 180 指数增强型证券投资基金资产净值为 1,423,602,173.01 元，基金份额为 1,309,562,468.73 份，单位基金净值为 1.087 元。

二、基金投资组合

(一) 按投资类型分类的股票投资组合

序号	项目	市值(元)	占净值比例
1	指数型投资	1,053,104,735.41	73.97%
2	非成分股增强性投资	19,531,487.50	1.37%

(二) 按行业分类的股票投资组合

序号	分类	市值(元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	8,806,030.73	0.62%
B	采掘业	50,172,181.18	3.52%
C	制造业	435,677,286.63	30.60%
C0	其中：食品、饮料	29,543,161.88	2.08%
C1	纺织、服装、皮毛	17,700,621.10	1.24%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	3,504,513.60	0.25%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	44,143,012.90	3.10%
C5	电子	51,049,463.22	3.59%
C6	金属、非金属	151,627,416.13	10.65%
C7	机械、设备、仪表	94,706,666.58	6.65%
C8	医药、生物制品	36,184,034.92	2.54%
C99	其他	7,218,396.30	0.51%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	100,436,458.13	7.06%
E	建筑业	13,345,716.75	0.94%
F	交通运输、仓储业	123,523,594.33	8.68%
G	信息技术业	97,947,762.80	6.88%

H	批发和零售贸易	15,321,591.66	1.08%
I	金融、保险业	107,817,175.18	7.57%
J	房地产业	25,270,722.49	1.78%
K	社会服务业	31,727,970.25	2.23%
L	传播与文化产业	5,637,277.36	0.40%
M	综合类	56,952,455.42	4.00%
	合 计	1,072,636,222.91	75.35%

(三) 债券 (不包括国债、政策性金融债) 合计

截止 2004 年 3 月 31 日, 基金持有债券 (不含应收利息) 14,436,572.00 元, 占基金资产净值的 1.01%。

(四) 国债、政策性金融债、货币资金合计

截止 2004 年 3 月 31 日, 基金持有的国债和政策性金融债 (不含应收利息) 及货币资金合计为 301,828,216.94 元, 占基金资产净值的 21.20%。

三、指数型投资中前十名股票明细

序号	名称	市值 (元)	占净值比例
1	中国联通	57,482,035.38	4.04%
2	宝钢股份	41,643,204.79	2.93%
3	中国石化	37,997,492.50	2.67%
4	招商银行	33,894,640.95	2.38%
5	上海汽车	28,345,445.73	1.99%
6	长江电力	26,898,741.00	1.89%
7	浦发银行	22,339,096.02	1.57%
8	上港集箱	21,921,783.20	1.54%
9	民生银行	21,387,877.20	1.50%
10	上海机场	18,112,945.29	1.27%

四、非成分股增强性投资中前五名股票明细

序号	名称	市值 (元)	占净值比例
1	华泰股份	3,504,513.60	0.25%
2	一汽轿车	2,933,304.90	0.21%
3	深能源A	2,762,500.00	0.19%
4	威孚高科	2,635,000.00	0.19%
5	长安汽车	2,538,132.00	0.18%

五、报告附注

（一）报告项目的计价方法

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。

（二）本基金不存在购入成本已超过基金资产净值 10% 的股票。

（三）截止 2004 年 3 月 31 日，本基金其他应收应付款项为借方余额 34,701,161.16 元。其他应收应付款项包括：深圳交易保证金、应收股利、应收利息、应收基金申购款、待摊费用、应付基金赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付券商佣金、其他应付款、以及预提费用。

（四）增强性投资的限制

本基金以指数化投资为主，增强性投资为辅，为控制因增强性投资而导致的投资组合相对指数标准结构的偏离，本基金选择以“跟踪偏离度”为标准，对增强性投资行为予以约束，以控制基金相对指数的偏离风险。

本基金以日跟踪偏离度为测算基准，将该指标的最大容忍值设定为 0.5%，以每周为检测周期，即本基金将每周计算该指标，计算区间为每周最后一个交易日起前 30 个交易日（含当日）。

截止 2004 年 3 月 31 日，本基金前 30 个交易日的日跟踪偏离度为 0.13%。

除此之外，本基金对增强性投资的其他限制包括：

（1）投资组合中持有的上证 180 指数成份股数量不低于 120 只。截止 2004 年 3 月 31 日，本基金投资组合中持有的上证 180 指数成份股数量为 161 只；

（2）投资组合中投资于股票资产的比例不低于基金资产净值的 50%。截止 2004 年 3 月 31 日，本基金投资组合中投资的股票资产占基金资产净值的 75.35%。

华安基金管理有限公司

2004 年 4 月 16 日