

华安上证 180 指数增强型 证券投资基金 2004 年半年度报告

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行

签发日期：二〇〇四年八月二十八日

一、	重要提示	3
二、	基金产品概况	3
	1、基金概况	3
	2、基金的投资	3
	3、基金管理人	4
	4、基金托管人	4
	5、信息披露	4
	6、登记注册机构	5
三、	主要财务指标和基金净值表现	5
	1、主要财务指标（未经审计）	5
	2、净值表现	5
四、	管理人报告	6
	1、基金经理	6
	2、基金运作合规性声明	7
	3、基金经理工作报告	7
五、	托管人报告	8
六、	财务会计报告（未经审计）	9
	（一）、资产负债表	9
	（二）、经营业绩表	10
	（三）、收益分配表	10
	（四）、净值变动表	10
	（五）、会计报表附注	11
七、	投资组合报告	16
	（一）、基金资产组合	16
	（二）、股票投资组合	16
	（三）、股票明细	17
	（四）、报告期内股票投资组合的重大变动	22
	（五）、债券投资组合	23
	（六）、投资组合报告附注	23
八、	基金份额持有人户数和持有人结构	24
九、	开放式基金份额变动	24
十、	重大事件	24
十一、	备查文件目录	26

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。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于 2004 年 8 月 16 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。

二、基金产品概况

1、基金概况

基金名称:	华安上证 180 指数增强型证券投资基金
基金简称:	华安 180
交易代码:	040002
基金运作方式:	契约型开放式
基金合同生效日:	2002 年 11 月 8 日
期末基金份额总额:	1,350,024,601.68 份
基金存续期:	不定期

2、基金的投资

投资目标: 运用增强性指数化投资方法,通过控制股票投资组合相对上证 180 指数有限度的偏离,力求基金收益率适度超越本基金比较基准,并在谋求基金资产长期增值的基础上,择机实现一定的收益和分配。

投资策略: (1) 资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 75%,国债投资不低于基金资产净值的 20%,其余基金资产为现金。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下,可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况,适当调整基金资产分配比例。

(2) 股票投资:本基金以上证 180 指数成分股构成及其权重等指标为基础,通过复制和有限度的增强管理方法,构造指数化投资组合。在投资组合建立后,基金经理定期检验该组合与比较基准

的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。

(3) 国债投资：本基金将根据国家经济形势、利率变化趋势、市场状况、基金资产收益和流动性的需要等因素，采取积极管理模式进行国债投资。

(4) 其它投资：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的收益。

业绩比较基准： $75\% * \text{上证 180 指数收益率} + 25\% * \text{中信国债指数收益率}$

风险收益特征：本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。

3、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 38 楼
邮政编码：200120
法定代表人：杜建国
信息披露负责人：冯颖
联系电话：021-58881111
传真：021-68863414
电子邮箱：fengying@huaan.com.cn
客户服务热线：021-68604666

4、基金托管人

基金托管人：中国工商银行
注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码：100032
法定代表人：姜建清
信息披露负责人：庄为
联系电话：010-66107333
传真：010-66106904
电子邮箱：custodian@icbc.com.cn

5、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

6、登记注册机构

登记注册机构： 华安基金管理有限公司
办公地点： 上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

三、主要财务指标和基金净值表现

(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：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

1、主要财务指标（未经审计）

财务指标	本报告期
基金本期净收益：	66,857,348.20
加权平均基金份额本期净收益：	0.056
期末可供分配基金收益	-104,508,585.15
期末可供分配基金份额收益	-0.0774
期末基金资产净值：	1,245,516,016.53
期末基金份额净值：	0.923
基金加权平均净值收益率	5.35%
本期基金份额净值增长率	-5.63%
基金份额累计净值增长率	3.40%

2、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	-7.42%	0.92%	-7.89%	0.90%	0.47%	0.02%
过去三个月	-15.09%	0.91%	-16.97%	0.88%	1.88%	0.03%
过去六个月	-5.63%	1.03%	-9.38%	0.97%	3.75%	0.06%
过去一年	-2.10%	0.90%	-9.86%	0.85%	7.76%	0.05%
自基金合同 生效起至今	3.40%	0.86%	-10.78%	0.90%	14.18%	-0.04%

B、图示自基金合同生效以来基金份额净值表现

华安180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
2002/11/8--2004/6/30



四、 管理人报告

1、基金经理

王国卫 先生：经济学硕士，10 年证券从业经历。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 年进入华安基金管理有限公司投资部任基金安信的基金经理，现任华安基金管理有限公司总经理助理、基金投资部总监，华安 180 和基金安久的基金经理。

刘光华 先生：中欧国际工商学院工商管理硕士，6 年银行、证券从业经历。曾在中国农业银行上海市分行国际业务部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 年 6 月加入华安基金管理有限公司后，曾任研究发展部高级研究员，从事汽车和机械行业及相关上市公司研究。现任华安 180 的基金经理助理。

2、基金运作合规性声明

本报告期间，本基金管理人严格遵守有关法律法规和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，无违法违规或未履行基金合同承诺的行为存在。

3、基金经理工作报告

截止 04 年 6 月 30 日，华安 180 基金单位净值 0.923 元，累计净值 1.043 元。04 年上半年，华安 180 基金进行了一次现金分红，每份额分配 0.05 元。04 年 6 月 30 日，华安 180 基金的跟踪偏离度为 0.0938%。

华安 180 是增强型指数基金，衡量本基金业绩的比较基准为：75%*上证 180 指数收益率+25%*中信国债指数收益率。04 年上半年，上证 180 指数下跌 10.62%，本基金比较基准下跌 9.38%，华安 180 基金净值下跌 5.63%，超越比较基准 3.75 个百分点。

上证 180 指数从 03 年 11 月 18 日的 2532 点，经历了 5 个月的上升和 3 个月的下跌，至 04 年 6 月 30 日，又回到 2528 点。这期间，以收盘点位计，高点出现在 04 年 4 月 6 日，上证 180 指数达 3273 点。市场在喜逢近 30% 的上涨后，又迅速经历了一轮超过 20% 的下跌。这种波动，是我国“新兴加转轨”时期资本市场的写照。

华安 180 作为增强型指数基金，以被动投资为主，增强性操作为辅。对于市场的大起大落，我们的目标是市场上涨时能跟上比较基准的涨幅，作到“赚了指数就赚钱”；市场下跌时争取跌幅小于比较基准。下表列出了以 4 月 6 日为界本基金在 04 年上半年上涨和下跌中的表现：

	2003/12/31-2004/4/6	2004/4/6-2004/6/30	2003/12/31-2004/6/30
上证 180 指数	15.71%	-22.75%	-10.62%
基金比较基准	11.22%	-17.93%	-9.38%
华安 180 净值	12.78%	-16.32%	-5.63%
超越比较基准	1.56%	1.61%	3.75%

虽然华安 180 基金在市场上升和下跌中的表现都好于比较基准，但是对宏观调控及其影响的认识不足使得本基金在二季度出现了较大幅度的净值下跌。在四、五、六连续 3 个月的下跌中，我们过早地判断市场将要见底，从而保留了 75% 左右的股票仓位，这是造成本基金二季度净值下跌了 15% 的根本原因。

展望 04 年下半年市场的走势，我们认为，上证综指在 1400 点下方将振荡

筑底，此后市场将重拾升势。对于指数基金的投资者，我们的建议是 1400 点以下是低风险区域，越跌越买是理性选择。

我们对市场判断的理由是：1) 宏观调控的成效已经显现，下一步不会有更严厉的措施出台。2) 市场经历了上证综指自 1783 点以来近 400 点的下跌，系统性风险已得到较大的释放。3) 《国务院关于推进资本市场改革开放和稳定发展的若干意见》对资本市场的影响是中长期的，04 年下半年落实《若干意见》的具体措施将逐步出台。4) 从保险资金、社保基金、到企业年金，进入资本市场的中长线资金体系正在形成。5) 统计数据表明，用流通股加权，上证 180 指数成份股的市盈率接近 20 倍；如果用总股本加权，该市盈率接近 17 倍。说明在股价下跌和上市公司盈利增长的双重作用下，A 股的市盈率已具有国际可比性。下表是截止 6 月 30 日对市场的部分统计数据：

	市盈率 (P/E)	市净率 (P/B)	净资产收益率 (ROE)
上证 180 指数成份股	20.3	2.29	13.95%
上海 A 股	26.7	2.33	11.3%
全部 A 股	27.45	2.31	10.67%

注：1) 数据来源为天相系统；2) 价格为 2004 年 6 月 30 日收盘价；3) 采用流通股加权。

五、 托管人报告

2004 年上半年，本托管人在托管华安上证 180 指数增强型证券投资基金过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，完全尽职尽责地履行应尽义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

2004 年上半年，华安上证 180 指数增强型证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规，严格按照基金合同规定进行，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

本托管人依法对华安上证 180 指数增强型证券投资基金管理人——华安基金管理有限公司于 2004 年上半年所编制和披露的华安上证 180 指数增强型证券投资基金半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确、完整。

特此报告。

中国工商银行资产托管部

2004 年 7 月 27 日

六、 财务会计报告（未经审计）

（一）、资产负债表

项 目	附注	2004年6月30日	2003年12月31日
资产：			
银行存款		38,609,369.24	11,833,170.10
交易保证金		111,915.28	250,000.00
应收证券清算款		2,783,306.56	0.00
应收股利		66,294.41	0.00
应收利息	4(1)	2,536,606.50	2,779,735.52
应收申购款		15,521,013.68	789,834.07
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值		938,024,600.62	940,806,338.29
其中：股票投资成本		1,012,227,471.62	877,867,375.10
债券投资市值		260,943,706.08	287,838,554.00
其中：债券投资成本		261,122,686.08	286,217,485.34
配股权证		0.00	1,163.54
买入返售证券		0.00	0.00
待摊费用	4(2)	170,929.28	0.00
其他资产		0.00	0.00
资产合计		1,258,767,741.65	1,244,298,795.52
负债：			
应付证券清算款		5,201,407.38	261,583.11
应付赎回款		6,045,589.13	6,793,325.95
应付管理人报酬		1,012,925.50	1,172,732.94
应付托管费		202,585.08	234,546.59
应付佣金	4(4)	344,627.15	490,009.41
其他应付款	4(5)	250,000.00	250,000.00
预提费用	4(6)	194,590.88	120,000.00
负债合计		13,251,725.12	9,322,198.00
所有者权益：			
实收基金	4(7)	1,350,024,601.68	1,205,252,621.50
未实现利得	4(8)	-129,275,086.43	19,232,254.79
未分配收益		24,766,501.28	10,491,721.23

持有人权益合计	1,245,516,016.53	1,234,976,597.52
负债和所有者权益合计	1,258,767,741.65	1,244,298,795.52

(二)、经营业绩表

项 目	附注	2004年1-6月	2003年1-6月
收入：			
股票差价收入		71,536,608.47	77,793,757.65
债券差价收入		-8,013,639.01	10,226,887.04
债券利息收入		3,408,335.01	5,116,555.66
存款利息收入		426,075.01	2,045,340.29
股利收入		7,469,075.71	7,047,412.16
买入返售证券收入		79,013.70	616,007.67
其他收入	4(11)	74,033.50	169,147.99
收入合计		74,979,502.39	103,015,108.46
费用：			
基金管理人报酬		6,205,751.26	8,393,726.61
基金托管费		1,241,150.26	1,678,745.25
卖出回购证券支出		415,430.00	629,752.00
其他费用	4(12)	259,822.67	1,049,867.94
其中：信息披露费		169,070.72	834,113.16
审计费用		74,590.88	91,739.85
费用合计		8,122,154.19	11,752,091.80
基金净收益		66,857,348.20	91,263,016.66
加：未实现估值增值变动数		-138,943,046.39	78,285,816.82
基金经营业绩		-72,085,698.19	169,548,833.48

(三)、收益分配表

项 目	附注	2004年1-6月	2003年1-6月
本期基金净收益		66,857,348.20	91,263,016.66
加：期初未分配收益		10,491,721.23	3,359,681.55
加：本期损益平准金		6,707,808.24	-14,804,579.22
可供分配基金净收益		84,056,877.67	79,818,118.99
减：本期已分配基金净收益		59,290,376.39	62,680,616.95
期末基金未分配净收益		24,766,501.28	17,137,502.04

(四)、净值变动表

项 目	附注	2004年1-6月	2003年1-6月
一、期初基金净值		1,234,976,597.52	2,201,214,733.19

二、本期经营活动:

基金净收益	66,857,348.20	91,263,016.66
未实现估值增值变动数	-138,943,046.39	78,285,816.82
经营活动产生的基金净值变动数	-72,085,698.19	169,548,833.48

三、本期基金单位交易:

基金申购款	801,112,736.83	493,194,067.36
基金赎回款	-659,197,243.24	-1,512,857,110.39
基金单位交易产生的基金净值变动数	141,915,493.59	-1,019,663,043.03

四、本期向持有人分配收益	-59,290,376.39	-62,680,616.95
五、期末基金净值	1,245,516,016.53	1,288,419,906.69

(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于 2004 年 7 月 1 日起颁布的《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. 会计政策:

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。

根据财政部、国家税务总局的财税字财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》中有关规定:自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税。

2. 本报告期重大会计差错:

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 基金发起人 基金注册与过户登记人 基金销售机构	提取管理费	基金契约
中国工商银行	基金托管人 基金代销机构	提取托管费	基金契约

申银万国证券股份有限公司 基金管理人的股东 租用交易席位 席位使用协议
公司

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，因此佣金比率是公允的。

(2). 通过关联方席位进行的交易

①本报告期通过关联人席位的股票成交量：

关联人	交易量	占总交易量比例	佣金	占总佣金比例
申银万国证券股份有限公司	133,839,378.52	11.89%	106,913.50	11.81%

上年度的上半年通过关联人席位的股票成交量：

关联人	交易量	占总交易量比例	佣金	占总佣金比例
申银万国证券股份有限公司	272,368,423.22	11.90%	219,620.86	12.01%

上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

②本报告期通过关联人席位的债券和回购成交量：

关联人	债券交易量	比例	回购交易量	比例
申银万国证券股份有限公司	101,913,669.20	16.97%	180,000,000.00	18.75%

上年度的上半年通过关联人席位的债券和回购成交量：

关联人	债券交易量	比例	回购交易量	比例
申银万国证券股份有限公司	428,561,699.80	12.68%	0.00	0.00%

③本报告期本基金与关联人未进行银行间市场债券买卖和回购交易。

上年度的上半年本基金与关联人未进行银行间市场债券买卖和回购交易。

(3). 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 1% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1\% \div \text{当年天数}$$

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 6,205,751.26 元。(上年度的上半年: 8,393,726.61 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 0.2% 的年费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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 1,241,150.26 元。(上年度的上半年: 1,678,745.25 元)

4. 基金会计报表重要项目的说明:

(1). 应收利息明细:

明细项目	本报告期末金额
银行存款利息	23,584.57
债券利息	2,513,021.93
买入返售证券利息	0.00
合计	2,536,606.50

(2). 待摊费用明细:

明细项目	本报告期末金额
信息披露费	170,929.28
审计费用	0.00
合计	170,929.28

(3). 投资估值增值明细:

明细项目	本报告期末金额
股票估值增值余额	-74,202,871.00
债券估值增值余额	-178,980.00
合计	-74,381,851.00

(4). 应付佣金明细:

明细项目	本报告期末金额
招商证券	52,069.20
宏源证券	139,877.44
国泰君安	152,680.51

合计	344,627.15
 (5). 其他应付款明细:	
券商垫付交易保证金	本报告期末金额 250,000.00
合计	250,000.00
 (6). 预提费用明细:	
明细项目	本报告期末金额
信息披露费	0.00
审计费用	194,590.88
合计	194,590.88
 (7). 实收基金变动明细:	
明细项目	本报告期金额
期初数	1,205,252,621.50
加: 本期因申购的增加数	756,961,315.82
减: 本期因赎回的减少数	612,189,335.64
期末数	1,350,024,601.68
 (8). 未实现利得明细:	
明细项目	金额
期初未实现利得:	19,232,254.79
其中: 投资估值增值数:	64,561,195.39
未实现利得平准金:	-45,328,940.60
本期投资估值增值发生数:	-138,943,046.39
本期申购的未实现利得平准金:	24,209,707.28
本期赎回的未实现利得平准金:	-33,774,002.11
期末未实现利得:	-129,275,086.43
其中: 投资估值增值数:	-74,381,851.00
未实现利得平准金:	-54,893,235.43
 (9). 卖出股票:	
明细项目	本报告期发生额
卖出股票成交总额	548,345,745.65
减: 佣金	465,847.99
成本总额	476,343,289.19
股票差价收入	71,536,608.47

(10). 卖出债券:

明细项目	本报告期发生额
卖出债券成交总额	861,143,226.44
减: 成本总额	860,224,288.47
应收利息总额	8,932,576.98
债券差价收入	-8,013,639.01

(11). 其他收入:

明细项目	本报告期发生额
开放式基金赎回费收入	0.00
新股、配股手续费返还	74,033.50
合计	74,033.50

(12). 其他费用:

明细项目	本报告期发生额
审计费用	74,590.88
信息披露费	169,070.72
交易所费用	6,021.07
债券账户服务费	10,140.00
合计	259,822.67

(13). 基金收益分配:

分红公告日	权益登记日、除息日	每10份基金单位收益分配金额	收益分配金额
2004-3-4	2004-3-9	0.50 元	59,290,376.39

5. 本基金流通受限、不能自由转让的基金资产

本基金流通受限、不能自由转让的资产为获配的新股和配股。在估值时如果该股票还未上市，则按成本计价；如已上市，则按当日收盘价计价。获配新股从新股获配日至新股上市日之间不能自由流通。

(1)、本基金截止本报告期末流通受限股票情况如下:

股票名称	数量	总成本	总市值	估值方法	转让受限原因	流通受限期限
盾安环境	12,000	137,040.00	137,040.00	按成本	未上市	至 2004-7-5
凯恩股份	14,000	98,420.00	98,420.00	按成本	未上市	至 2004-7-5
中航精机	8,000	48,960.00	48,960.00	按成本	未上市	至 2004-7-5
永新股份	10,000	86,300.00	86,300.00	按成本	未上市	至 2004-7-8
霞客环保	7,000	46,340.00	46,340.00	按成本	未上市	至 2004-7-8
威尔科技	11,000	82,500.00	82,500.00	按成本	未上市	至 2004-7-8
东信和平	11,000	114,730.00	114,730.00	按成本	未上市	至 2004-7-13
华星化工	7,000	59,850.00	59,850.00	按成本	未上市	至 2004-7-13
宁波热电	32,000	134,400.00	134,400.00	按成本	未上市	至 2004-7-6
建设机械	22,000	140,800.00	140,800.00	按成本	未上市	至 2004-7-7
武钢股份	1,982,605	12,649,019.90	12,926,584.60	按市价	增发部分未上市	至 2004-7-5
合 计		13,598,359.90	13,875,924.60			

(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)、基金资产组合

序号	资产组合	金额	占基金总资产比例
1	股票	938,024,600.62	74.52%
2	债券	260,943,706.08	20.73%
3	银行存款和清算备付金合计	38,609,369.24	3.07%
4	应收证券清算款	2,783,306.56	0.22%
5	其他资产	18,406,759.15	1.46%
	合计	1,258,767,741.65	100.00%

(二)、股票投资组合

1、指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	6,872,547.29	0.55%
B	采掘业	45,535,367.16	3.66%
C	制造业	342,407,571.73	27.49%
C0	其中：食品、饮料	30,023,547.49	2.41%
C1	纺织、服装、皮毛	15,250,572.53	1.22%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	40,448,505.56	3.25%
C5	电子	44,834,744.23	3.60%
C6	金属、非金属	110,826,039.90	8.90%
C7	机械、设备、仪表	67,216,985.08	5.40%

C8	医药、生物制品	28,528,215.22	2.29%
C99	其他	5,278,961.72	0.42%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	97,635,473.97	7.84%
E	建筑业	9,645,110.45	0.77%
F	交通运输、仓储业	101,401,709.48	8.14%
G	信息技术业	72,317,217.72	5.81%
H	批发和零售贸易	15,470,396.66	1.24%
I	金融、保险业	103,152,672.75	8.28%
J	房地产业	17,637,771.59	1.42%
K	社会服务业	23,139,629.05	1.86%
L	传播与文化产业	7,404,031.82	0.59%
M	综合类	47,079,858.35	3.78%
	合 计	889,699,358.02	71.43%

2、积极投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值	占资产净值比例
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B	采掘业	5,796,204.00	0.47%
C	制造业	28,121,328.54	2.26%
C0	其中：食品、饮料	1,139,608.64	0.09%
C1	纺织、服装、皮毛	2,003,535.20	0.16%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	1,704,852.03	0.14%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	6,848,793.68	0.55%
C5	电子	5,499,718.63	0.44%
C6	金属、非金属	1,314,185.17	0.11%
C7	机械、设备、仪表	8,274,083.83	0.66%
C8	医药、生物制品	1,336,551.36	0.11%
C99	其他	0.00	0.00%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	4,523,031.00	0.36%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	5,116,015.08	0.41%
G	信息技术业	3,736,663.98	0.30%
H	批发和零售贸易	1,032,000.00	0.08%
I	金融、保险业	0.00	0.00%
J	房地产业	0.00	0.00%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	0.00	0.00%
	合 计	48,325,242.60	3.88%

(三)、股票明细

1、指数投资的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	600050	中国联通	13,357,131	46,082,101.95	3.70%
2	600900	长江电力	4,819,644	40,870,581.12	3.28%
3	600036	招商银行	4,036,011	34,225,373.28	2.75%
4	600019	宝钢股份	5,017,313	31,558,898.77	2.53%
5	600028	中国石化	6,218,552	29,786,864.08	2.39%
6	600016	民生银行	4,097,649	25,651,282.74	2.06%
7	600104	上海汽车	2,565,290	21,856,270.80	1.75%
8	600000	浦发银行	2,298,257	20,201,679.03	1.62%
9	600009	上海机场	1,589,264	17,640,830.40	1.42%
10	600018	上港集箱	1,353,719	16,989,173.45	1.36%
11	600839	四川长虹	1,898,698	14,676,935.54	1.18%
12	600688	上海石化	2,353,128	14,142,299.28	1.14%
13	600029	南方航空	3,232,524	14,061,479.40	1.13%
14	600642	申能股份	1,908,714	13,532,782.26	1.09%
15	600795	国电电力	1,937,386	13,174,224.80	1.06%
16	600005	武钢股份	2,008,416	13,094,872.32	1.05%
17	600015	华夏银行	2,322,149	11,982,288.84	0.96%
18	600011	华能国际	1,154,850	11,132,754.00	0.89%
19	600002	齐鲁石化	1,096,170	10,589,002.20	0.85%
20	600519	贵州茅台	288,195	9,755,400.75	0.78%
21	600026	中海发展	1,120,977	9,270,479.79	0.74%
22	600887	伊利股份	848,231	8,592,580.03	0.69%
23	600309	烟台万华	919,950	8,555,535.00	0.69%
24	600649	原水股份	1,221,285	8,194,822.35	0.66%
25	600601	方正科技	882,419	8,135,903.18	0.65%
26	600808	马钢股份	1,735,280	7,930,229.60	0.64%
27	600602	广电电子	863,189	7,777,332.89	0.62%
28	600832	东方明珠	592,311	7,605,273.24	0.61%
29	600205	山东铝业	664,159	7,504,996.70	0.60%
30	600100	清华同方	522,908	7,310,253.84	0.59%
31	600270	外运发展	800,384	7,163,436.80	0.58%
32	600690	青岛海尔	813,153	6,944,326.62	0.56%
33	600030	中信证券	978,528	6,810,554.88	0.55%
34	600207	安彩高科	632,991	6,557,786.76	0.53%
35	600717	天津港	564,106	6,453,372.64	0.52%
36	600004	白云机场	771,262	6,386,049.36	0.51%
37	600188	兖州煤业	459,819	6,354,698.58	0.51%
38	600660	福耀玻璃	799,936	6,231,501.44	0.50%
39	600598	北大荒	1,011,499	6,068,994.00	0.49%
40	600008	首创股份	594,962	5,973,418.48	0.48%
41	600812	华北制药	1,153,818	5,838,319.08	0.47%
42	600895	张江高科	877,471	5,826,407.44	0.47%
43	600350	山东基建	1,399,399	5,821,499.84	0.47%
44	600085	同仁堂	311,950	5,746,119.00	0.46%

45	600868	梅雁股份	1,632,646	5,616,302.24	0.45%
46	600835	上海电气	578,228	5,574,117.92	0.45%
47	600177	雅戈尔	913,418	5,498,776.36	0.44%
48	600006	东风汽车	1,156,368	5,469,620.64	0.44%
49	600583	海油工程	403,003	5,468,750.71	0.44%
50	600362	江西铜业	763,819	5,453,667.66	0.44%
51	600585	海螺水泥	448,483	5,341,432.53	0.43%
52	600210	紫江企业	1,051,586	5,278,961.72	0.42%
53	600851	海欣股份	428,897	5,206,809.58	0.42%
54	600863	内蒙华电	980,214	5,106,914.94	0.41%
55	600031	三一重工	221,439	5,066,524.32	0.41%
56	600171	上海贝岭	558,487	4,987,288.91	0.40%
57	600635	大众公用	852,192	4,951,235.52	0.40%
58	600597	光明乳业	699,611	4,904,273.11	0.39%
59	600183	生益科技	607,431	4,877,670.93	0.39%
60	600600	青岛啤酒	531,212	4,786,220.12	0.38%
61	600500	中化国际	665,480	4,771,491.60	0.38%
62	600569	安阳钢铁	1,236,790	4,749,273.60	0.38%
63	600849	上海医药	738,405	4,496,886.45	0.36%
64	600663	陆家嘴	495,109	4,455,981.00	0.36%
65	600037	歌华有线	245,113	4,318,891.06	0.35%
66	600236	桂冠电力	409,377	4,192,020.48	0.34%
67	600811	东方集团	813,192	4,171,674.96	0.33%
68	600651	飞乐音响	724,741	4,080,291.83	0.33%
69	600637	广电信息	451,339	3,989,836.76	0.32%
70	600307	酒钢宏兴	655,799	3,941,351.99	0.32%
71	600508	上海能源	374,171	3,925,053.79	0.32%
72	600770	综艺股份	334,213	3,910,292.10	0.31%
73	600664	哈药集团	504,355	3,858,315.75	0.31%
74	600418	江淮汽车	293,347	3,813,511.00	0.31%
75	600170	上海建工	602,576	3,802,254.56	0.31%
76	600631	第一百货	409,584	3,796,843.68	0.30%
77	600428	中远航运	318,684	3,773,218.56	0.30%
78	600591	上海航空	753,348	3,766,740.00	0.30%
79	600098	广州控股	384,684	3,635,263.80	0.29%
80	600654	飞乐股份	740,243	3,619,788.27	0.29%
81	600747	大显股份	700,004	3,556,020.32	0.29%
82	600012	皖通高速	646,737	3,479,445.06	0.28%
83	600705	北亚集团	1,015,150	3,431,207.00	0.28%
84	600060	海信电器	413,779	3,289,543.05	0.26%
85	600652	爱使股份	538,575	3,274,536.00	0.26%
86	600675	中华企业	649,627	3,261,127.54	0.26%
87	600383	金地集团	307,991	3,243,145.23	0.26%
88	600033	福建高速	562,110	3,226,511.40	0.26%
89	600609	金杯汽车	794,192	3,216,477.60	0.26%

90	600296	兰州铝业	554,596	3,177,835.08	0.26%
91	600266	北京城建	392,426	3,159,029.30	0.25%
92	600166	福田汽车	428,208	3,125,918.40	0.25%
93	600548	深 高 速	525,523	3,121,606.62	0.25%
94	600271	航天信息	135,299	2,981,989.96	0.24%
95	600231	凌钢股份	436,824	2,904,879.60	0.23%
96	600643	爱建股份	441,267	2,797,632.78	0.22%
97	600102	莱钢股份	446,892	2,797,543.92	0.22%
98	600058	五矿发展	277,023	2,778,540.69	0.22%
99	600805	悦达投资	604,246	2,700,979.62	0.22%
100	600115	东方航空	654,255	2,688,988.05	0.22%
101	600820	隧道股份	537,841	2,683,826.59	0.22%
102	600581	八一钢铁	533,340	2,672,033.40	0.21%
103	600282	南钢股份	333,601	2,658,799.97	0.21%
104	600718	东软股份	232,434	2,635,801.56	0.21%
105	600710	常林股份	404,323	2,624,056.27	0.21%
106	600126	杭钢股份	355,553	2,545,759.48	0.20%
107	600741	巴士股份	546,109	2,544,867.94	0.20%
108	600196	复星实业	536,636	2,500,723.76	0.20%
109	600135	乐凯胶片	245,104	2,458,393.12	0.20%
110	600380	健 康 元	324,536	2,411,302.48	0.19%
111	600010	钢联股份	595,145	2,392,482.90	0.19%
112	600121	郑州煤电	375,119	1,988,130.70	0.16%
113	600186	莲花味精	565,548	1,985,073.48	0.16%
114	600866	星湖科技	502,135	1,978,411.90	0.16%
115	600151	航天机电	336,748	1,976,710.76	0.16%
116	600138	中 青 旅	234,412	1,933,899.00	0.16%
117	600215	长春经开	312,372	1,933,582.68	0.16%
118	600894	广钢股份	451,016	1,925,838.32	0.15%
119	600639	浦东金桥	266,940	1,919,298.60	0.15%
120	600641	中远发展	362,036	1,893,448.28	0.15%
121	600088	中视传媒	207,528	1,838,698.08	0.15%
122	600854	春兰股份	294,080	1,823,296.00	0.15%
123	600221	海南航空	442,277	1,800,067.39	0.14%
124	600535	天 士 力	166,484	1,698,136.80	0.14%
125	600091	明天科技	250,850	1,597,914.50	0.13%
126	600377	宁沪高速	240,901	1,580,310.56	0.13%
127	600226	升华拜克	237,161	1,579,492.26	0.13%
128	600076	青鸟华光	241,272	1,551,378.96	0.12%
129	600871	仪征化纤	344,440	1,525,869.20	0.12%
130	600223	万杰高科	269,939	1,511,658.40	0.12%
131	600001	邯郸钢铁	286,450	1,509,591.50	0.12%
132	600398	凯诺科技	222,181	1,499,721.75	0.12%
133	600816	鞍山信托	331,960	1,483,861.20	0.12%
134	600677	航天通信	272,122	1,461,295.14	0.12%

135	600007	中国国贸	251,675	1,449,648.00	0.12%
136	600357	承德钒钛	175,242	1,338,848.88	0.11%
137	600511	国药股份	175,459	1,293,132.83	0.10%
138	600640	联通国脉	146,468	1,246,442.68	0.10%
139	600258	首旅股份	156,357	1,224,275.31	0.10%
140	600120	浙江东方	273,770	1,210,063.40	0.10%
141	600665	天地源	214,102	1,096,202.24	0.09%
142	600322	天房发展	188,882	931,188.26	0.07%
143	600823	世茂股份	116,502	891,240.30	0.07%
144	600072	江南重工	162,234	848,483.82	0.07%
145	600555	茉织华	136,754	815,053.84	0.07%
146	600275	武昌鱼	223,831	803,553.29	0.06%
147	600086	多佳股份	199,201	768,915.86	0.06%
148	600838	上海九百	162,742	729,084.16	0.06%

2、积极投资的股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值	占净值比例
1	600348	国阳新能	450,500	4,649,160.00	0.37%
2	600021	上海电力	510,900	4,388,631.00	0.35%
3	000866	扬子石化	328,651	3,838,643.68	0.31%
4	000100	TCL 集团	535,947	3,692,674.83	0.30%
5	600406	国电南瑞	238,442	3,621,933.98	0.29%
6	000581	威孚高科	351,148	3,300,791.20	0.27%
7	600143	金发科技	200,000	2,864,000.00	0.23%
8	000625	长安汽车	285,271	2,538,911.90	0.20%
9	000022	深赤湾 A	126,732	2,369,888.40	0.19%
10	600303	曙光股份	258,631	2,025,080.73	0.16%
11	600220	江苏阳光	552,880	1,957,195.20	0.16%
12	600317	营口港	241,924	1,952,326.68	0.16%
13	600707	彩虹股份	220,910	1,807,043.80	0.15%
14	600308	华泰股份	155,813	1,606,432.03	0.13%
15	600267	海正药业	72,168	1,336,551.36	0.11%
16	600674	川投控股	249,371	1,314,185.17	0.11%
17	600489	中金黄金	156,700	1,147,044.00	0.09%
18	600429	三元股份	257,248	1,139,608.64	0.09%
19	600153	厦门建发	200,000	1,032,000.00	0.08%
20	600087	南京水运	140,000	793,800.00	0.06%
21	600984	建设机械	22,000	140,800.00	0.01%
22	002011	盾安环境	12,000	137,040.00	0.01%
23	600982	宁波热电	32,000	134,400.00	0.01%
24	002017	东信和平	11,000	114,730.00	0.01%
25	002012	凯恩股份	14,000	98,420.00	0.01%

26	002014	永新股份	10,000	86,300.00	0.01%
27	002016	威尔科技	11,000	82,500.00	0.01%
28	002018	华星化工	7,000	59,850.00	0.00%
29	002013	中航精机	8,000	48,960.00	0.00%
30	002015	霞客环保	7,000	46,340.00	0.00%

(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	占期初基金资产净值的比例
1	600900	长江电力	39,507,375.30	3.20%
2	600050	中国联通	18,628,868.26	1.51%
3	600016	民生银行	17,300,305.27	1.40%
4	600005	武钢股份	15,726,603.55	1.27%
5	600029	南方航空	15,505,495.85	1.26%
6	600028	中国石化	14,065,241.52	1.14%
7	600015	华夏银行	12,938,176.65	1.05%
8	600036	招商银行	11,969,669.08	0.97%
9	600104	上海汽车	11,246,649.97	0.91%
10	600019	宝钢股份	10,674,731.63	0.86%
11	600688	上海石化	9,468,608.53	0.77%
12	600832	东方明珠	9,134,985.87	0.74%
13	600000	浦发银行	8,682,326.75	0.70%
14	000100	TCL 集团	8,636,038.43	0.70%
15	000027	深能源 A	8,202,687.19	0.66%
16	000581	威孚高科	7,484,819.78	0.61%
17	600795	国电电力	7,323,063.94	0.59%
18	600205	山东铝业	7,237,824.02	0.59%
19	600031	三一重工	7,034,679.19	0.57%
20	600602	广电电子	7,023,397.11	0.57%

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的比例
1	600050	中国联通	23,785,062.38	1.93%
2	600019	宝钢股份	21,127,331.51	1.71%
3	600036	招商银行	17,629,427.58	1.43%
4	600028	中国石化	17,176,463.19	1.39%
5	600104	上海汽车	12,068,897.83	0.98%
6	600000	浦发银行	11,564,256.88	0.94%
7	600016	民生银行	10,709,087.51	0.87%

8	600005	武钢股份	9,323,777.70	0.75%
9	600839	四川长虹	9,254,749.68	0.75%
10	600009	上海机场	8,556,771.27	0.69%
11	600018	上港集箱	8,542,957.40	0.69%
12	000027	深能源 A	8,503,188.99	0.69%
13	600688	上海石化	8,476,588.32	0.69%
14	000581	威孚高科	7,818,846.24	0.63%
15	600002	齐鲁石化	7,447,730.91	0.60%
16	600717	天津港	7,104,394.19	0.58%
17	600001	邯郸钢铁	6,962,475.27	0.56%
18	000100	TCL 集团	6,383,801.70	0.52%
19	600808	马钢股份	6,315,729.09	0.51%
20	600100	清华同方	6,313,159.97	0.51%

2、整个报告期内买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额。

买入股票的成本总额:	610,703,385.71
卖出股票的收入总额:	548,345,745.65

(五)、债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值 (元)	占资产净值比例
1	国家债券	3,751,440.00	0.30%
2	金融债券	249,058,378.08	20.00%
3	企业债券	0.00	0.00%
4	可转换债券	8,133,888.00	0.65%
	合计	260,943,706.08	20.95%

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	0302020	03 国开 02	2,100,000	210,000,000.00	16.86%
2	030209	03 国开 09	400,000	39,058,378.08	3.14%
3	110001	邯钢转债	76,800	8,133,888.00	0.65%
4	010401	04 国债 01	38,500	3,751,440.00	0.30%

(六)、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。

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。

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	占总资产比例
1	深圳结算保证金	111,915.28	0.01%
2	应收股利	66,294.41	0.01%
3	应收利息	2,536,606.50	0.20%
4	应收基金申购款	15,521,013.68	1.23%
5	待摊费用	170,929.28	0.01%
	合计	18,406,759.15	1.46%

4、处于转股期的可转换债券明细

序号	转债代码	转债名称	转债数量(张)	市值(元)	占资产净值比例
1	110001	邯钢转债	76,800	8,133,888.00	0.65%

八、基金份额持有人户数和持有人结构

基金份额持有人户数和持有人结构

项目	份额(份)	占总份额的比例
基金份额持有人户数	30,111	-
平均每户持有基金份额	44,834.93	-
机构投资者持有的基金份额	775,362,882.05	57.43%
个人投资者持有的基金份额	574,661,719.63	42.57%

九、开放式基金份额变动

项目	份额(份)
基金合同生效日的基金份额总额	3,094,001,262
期初基金份额总额	1,205,252,621.50
加：本期申购基金份额总额	756,961,315.82
减：本期赎回基金份额总额	612,189,335.64
期末基金份额总额	1,350,024,601.68

十、重大事件

(一)、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

本基金管理人于 2004 年 02 月 20 日公告：经公司董事会审议通过，并报经中国证监会证监基金字〔2004〕14 号文核准，决定免去尚健先生副总经理职务。

本基金管理人于 2004 年 06 月 05 日公告：经华安基金管理有限公司董事会审议通过，并报经中共上海市金融工作委员会沪金融工委干[2004]33 号文和中国证监会证监基金字[2004]66 号文核准，我公司决定聘任姚毓林先生为公司副总经理。

(二)、基金收益分配事项

分红公告日	权益登记日、除息日	每10份基金份额收益分配金额	收益分配总金额
2004-3-4	2004-3-9	0.50 元	59,290,376.39

(三)、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). 股票交易情况：

券商名称	成交量	占总成交总量比例	佣金	占总佣金总量比例
宏源证券股份有限公司	242,714,378.87	21.56%	195,871.11	21.64%
国泰君安证券股份有限公司	214,655,263.37	19.06%	174,590.58	19.29%
中信证券股份有限公司	213,676,408.62	18.98%	171,823.28	18.98%
申银万国证券股份有限公司	133,839,378.52	11.89%	106,913.50	11.81%
北方证券有限责任公司	113,051,794.50	10.04%	91,141.88	10.07%
招商证券股份有限公司	107,613,874.77	9.56%	84,245.34	9.31%
银河证券有限责任公司	66,841,873.59	5.94%	53,215.07	5.88%
华夏证券股份有限公司	33,601,069.61	2.98%	27,275.98	3.01%
合计	<u>1,125,994,041.85</u>	100.00%	<u>905,076.74</u>	100.00%

(2). 债券及回购交易情况：

券商名称	债券成交量	占总成交总量比例	回购成交量	占总成交总量比例
宏源证券股份有限公司	163,194,945.90	27.18%	154,800,000.00	16.13%
招商证券股份有限公司	112,649,688.27	18.76%	13,300,000.00	1.39%
申银万国证券股份有限公司	101,913,669.20	16.97%	180,000,000.00	18.75%
国泰君安证券股份有限公司	91,544,986.90	15.25%	50,000,000.00	5.21%
中信证券股份有限公司	75,700,162.90	12.61%	270,200,000.00	28.15%
北方证券有限责任公司	34,024,537.10	5.67%	121,600,000.00	12.67%
银河证券有限责任公司	13,847,699.40	2.31%	150,000,000.00	15.63%
华夏证券股份有限公司	7,594,309.20	1.26%	20,000,000.00	2.08%
合计	<u>600,469,998.87</u>	100.00%	<u>959,900,000.00</u>	100.00%

(四)、其他重大事项

以下重大事项已在本基金的指定信息披露报纸上披露。

1. 本基金管理人于 2004 年 3 月 18 日发布公告，新增渤海证券有限责任公

司为华安创新证券投资基金和华安上证 180 指数增强型证券投资基金的代销机构。

2. 本基金管理人于 2004 年 4 月 6 日发布公告,“华安特快”电子直销交易平台开通基金转换业务。

3. 本基金管理人于 2004 年 5 月 18 日发布公告,新增海通证券股份有限公司为华安创新证券投资基金、华安上证 180 指数增强型证券投资基金和华安现金富利投资基金的代销机构。

4. 本基金管理人于 2004 年 5 月 25 日发布公告,新增兴业证券股份有限公司为华安创新证券投资基金、华安上证 180 指数增强型证券投资基金和华安现金富利投资基金的代销机构。

5. 本基金管理人于 2004 年 5 月 25 日发布公告,新增招商证券股份有限公司为华安创新证券投资基金、华安上证 180 指数增强型证券投资基金和华安现金富利投资基金的代销机构。

6. 本基金管理人于 2004 年 5 月 25 日发布公告,新增申银万国证券股份有限公司为华安创新证券投资基金和华安上证 180 指数增强型证券投资基金的代销机构。

7. 本基金管理人于 2004 年 7 月 13 日发布公告,“华安特快”基金电子交易业务增加兴业银行“银基通”资金结算方式。

8. 本基金管理人于 2004 年 7 月 16 日发布公告,“华安特快”基金电子交易业务开通全国部分地区和城市“银联通”资金结算方式。

9. 本基金管理人于 2004 年 7 月 22 日发布公告,新增中国银河证券有限责任公司为华安创新证券投资基金、华安上证 180 指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金和华安宝利配置证券投资基金的代销机构。

10. 本基金管理人于 2004 年 7 月 23 日发布公告,新增广发证券股份有限公司为华安创新证券投资基金、华安上证 180 指数增强型证券投资基金、华安现金富利投资基金和华安宝利配置证券投资基金的代销机构。

十一、备查文件目录

1. 中国证监会批准华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的文件。
2. 《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》、《华安上证 180 指数增强型证券投资基金发行公告》、《华安上证 180 指数增强型证券投资基金成立公告》、《华安上证 180 指数增强型证券投资基金申购、赎回公告》、《华安上证 180 指数增强型证券投资基金公开说明书》。
3. 《华安上证 180 指数增强型证券投资基金托管协议》。
4. 华安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。

5. 本基金于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. 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.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
2004 年 8 月 28 日