

**华安上证 180 指数增强型
证券投资基金**

2003 年度中期报告

华安基金管理有限公司

2003 年 8 月 29 日

重要提示

本基金的托管人中国工商银行已于 2003 年 8 月 27 日复核了本报告。

本基金的管理人、托管人愿就本报告中所载资料的真实性、准确性、完整性负责。本报告书中的内容由基金管理人负责解释。

一、基金简介

(一) 基金名称: 华安上证 180 指数增强型证券投资基金
(简称: 华安 180)

交易代码: 040002
深交所行情代码: 160402
基金发起人: 华安基金管理有限公司
基金发行日期: 2002 年 10 月 15 日
基金成立日期: 2002 年 11 月 8 日
首次募集总份额: 3,094,001,262 份
基金类型: 契约型开放式
基金存续期: 无限期

(二) 基金管理人: 华安基金管理有限公司
注册及办公地址: 上海市浦东南路 360 号
新上海国际大厦 38 楼
(邮编: 200120)

法定代表人: 杜建国
总经理: 韩方河
信息披露负责人: 冯 颖
电 话: 021-58881111
传 真: 021-58406138
客户服务热线: 021-68604666
国际互联网网址: <http://www.huaan.com.cn>

(三) 基金托管人: 中国工商银行
注册及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号
(邮编: 100032)

法定代表人: 姜建清
托管部负责人: 周月秋
信息披露负责人: 庄 为
电 话: 010-66107333
传 真: 010-66106904

(四) 会计师事务所: 普华永道中天会计师事务所有限公司
 注册地址: 上海市浦东新区东昌路 568 号
 (邮编: 200120)
 办公地址: 上海市淮海中路 333 号瑞安广场 12 楼
 (邮编: 200021)
 法定代表人: Kent Watson
 经办注册会计师: 肖峰、陈玲

二. 主要财务指标

项目	2002 年 11 月 8 日-2003 年 6 月 30 日
基金本期净收益	95,221,816.97 元
单位基金本期净收益	0.0745 元
基金可分配净收益	9,998,182.69 元
单位基金可分配净收益	0.0078 元
期末基金资产总值	1,413,893,101.33 元
期末基金资产净值	1,288,419,906.69 元
期末单位基金资产净值	1.008 元
基金资产净值收益率	3.08%
本期基金资产净值增长率	5.62%
累计资产净值增长率	5.62%

上述部分指标计算公式:

1. 基金可分配净收益 = 期末基金未分配收益+MIN[0, 期末未实现利得]
2. 基金资产净值收益率 = 本期净收益 / 调整后期初基金资产净值
3. 本期基金资产净值增长率 = (分红前单位净值 / 期初单位净值) * (期末单位净值 / 分红后单位净值) -1
4. 累计资产净值增长率 = (第 1 年度净值增长率+1) * (第 2 年度净值增长率+1) * ... * (上年度净值增长率+1) * (本期净值增长率+1) -1

三. 基金管理人报告

本基金业绩表现

截止 2003 年 6 月 30 日, 本基金单位资产净值为 1.008 元, 累计单位净值 1.058 元, 比 2002 年末增长了 7.44%。本期华安 180 每份基金单位实现分红 0.05 元。

华安 180 是指数增强型基金, 基金业绩比较基准=75%×上证 180 指数收益率

+ 25%×中信国债指数收益率。

从 2002 年 11 月 8 日成立至 2003 年 6 月 30 日（成立以来），超越比较基准 6.67%。原因是基金成立后恰好遇上市场下跌，建仓平均成本较低。

从 2003 年 1 月 1 日至 2003 年 6 月 30 日（今年以来），落后比较基准 1.29%。原因是今年 1.14 行情时，华安 180 正处于建仓期（3 个月建仓期），建仓没有完毕。

从 2003 年 2 月 10 日（建仓完成）至 2003 年 6 月 30 日，超越比较基准 1.68%。原因是基金正式建仓完毕，进入正常管理时期，通过适度增强获得超额收益。

2003 年 6 月 30 日，华安 180 跟踪偏离度为 0.08%。

基金经理简介

刘新勇先生，35 岁，研究生学历，6 年证券从业经历。曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999 年 5 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，从事研究工作 3 年。现任华安 180 的基金经理。

殷觅智先生（Mr. Ian Midgley），34 岁，研究生学历，CFA，12 年证券从业经历，英国国籍。曾在英国培基基金管理（伦敦）有限公司担任研究部分析师，瑞士银行投资管理（纽约分行、伦敦分行）担任研究助理，宝源投资管理（香港）有限公司担任策划员，并是资产分配委员会的成员之一。2001 年加入华安基金管理有限公司后，曾在战略策划部、研究发展部工作，从事基金业绩评估、新产品开发及基金专题研究。现任华安 180 的基金经理。

（一）基金经理工作报告

上半年回顾

由于 2001 年及 2002 年市场较大程度地释放了系统性风险，2003 年上半年的证券市场，在宏观经济高速增长，上市公司业绩明显好转的基础上，开始了恢复性上涨。4 月份“非典”爆发后，市场回落，但上半年上证指数仍上涨 9.46%。个股及行业表现出现较大分化，景气度高的行业及相关大盘蓝筹股表现十分出色，市场表现出局部牛市特征。以蓝筹股为成份股的上证 180 指数半年涨幅达 11.12%，远超过上证指数的涨幅。

针对华安 180 成立后市场的变化，我们采取平均建仓策略，较好地控制了建仓成本，大部分回避了 2002 年底市场大幅下跌的风险。在建仓完毕后，股票仓位始终维持在 75%左右，较好地跟踪上比较基准，跟踪偏离度严格控制在基金契约规定的范围内。在此基础上，通过适度提高冶金、电力、交通运输、金融等行业蓝筹股的投资权重，较好地获得超越比较基准的收益。在 2003 年 1 月 1 日和 2003 年 7 月 1 日两次成份股调整前，较好地做出预测，预测准确率达到 75%（预测结果见《中国证券报》2003 年 6 月 12 日）。并在成份股调整前提前完成组合结构调整，将调整成本降低到最低水平。

下半年展望

我们认为，下半年证券市场的运行环境将比较平稳。国民经济的平稳增长和上

上市公司业绩持续改善是证券市场发展的基石，而货币政策适度收紧及央行 5 号令等规范措施将使部分资金流出市场，加速扩容也使资金面不容乐观。因此，短期来看市场有一定压力，但中长期来看，随着上市公司业绩持续不断向好，市场投资价值将越来越高。我们仍对中国证券市场中长期发展持乐观态度。

下半年，华安 180 仍将严格按照基金契约的要求，在跟踪上比较基准的基础上，通过适度增强力争全年超越比较基准。

（二） 内部监察报告

基金运作合规性声明

本报告期间，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理暂行办法》及其各项实施准则、《开放式证券投资基金试点办法》、《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，遵循“忠诚理财、智慧回报”的公司理念，在严格控制风险的基础上，为持有人谋求最大利益，无损害基金持有人利益的行为存在。

内部监察工作报告

本报告期内，本基金管理人在内部监察工作方面本着合规运作、保障投资者利益的原则，遵照有关法律法规、基金契约和公司内部规章进行了持续的内部监察稽核工作，对于发现的问题及时向有关部门进行反馈，并对整改情况进行跟踪复查。

本报告期内，我们对以下方面着重实施了监察和稽核工作：

一、对华安180基金日常投资运作合法性、合规性的检查

在合规的框架下获取投资收益，是公司秉承的一贯风格。为加强对投资交易行为的监控，我们坚持严格按照有关法律法规、基金契约及其他规定，通过系统设置，自动禁止违规交易。对于基金投资比例、新股申购、交易行为、席位交易量分配等我们进行了实时监控和检查，并在发现问题的第一时间及时通报基金经理和公司管理层，采取措施加以妥善解决。

二、落实内部控制指导意见，完善公司各项业务规范

2002年年底，中国证监会颁布实施了《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》，这为我公司全面建设与完善内部控制体系指明了方向。监察稽核部与各部门一起对现有各类规章制度开展深入讨论、整理和修订，完善了内部控制大纲、基本管理制度、部门业务规章和业务流程、岗位职责相结合的制度体系。

三、全面开展风险自我评估，对公司业务风险点进行梳理与管控

根据2003年上半年中国证监会在基金管理公司中开展风险控制自我评估的要求，本基金管理人除认真完成所要求的人力资源、投资交易和关联方交易的风险评估外，还完成了与开放式基金关系最为密切的基金注册业务的风险评估。目前，我们在公司内部分阶段推进其他业务环节的风险点确认、风险评估、风险自查和讨论改进措施的工作。通过风险自我评估，各业务部门深入检查内部控制中存在的隐患和存在的风险点，有重点地制定和执行各项风险管控及改进措施，努力使风险管理工作开展更为扎实有效。

四、进行各系统恢复备份演习，提高灾难应变恢复能力

为防范系统风险，信息技术部对公司各大系统均进行了系统和数据库备份。为检验备份工作的真实有效，公司监察稽核部会同信息技术部和相关业务部门开展了对重要数据库的恢复备份演习，模拟灾难发生时的情景，在尽可能短的时间内恢复系统正常运行与业务开展。通过恢复备份演习，发现了在日常备份工作中存在的不足，使公司能及时填补完善备份缺陷，提高面对灾难时的公司紧急应变与恢复正常营运的能力。

五、加强对各项业务的提前介入，将风险化解于萌芽之中

为做好监察工作，更好地了解新产品、新业务，公司监察人员积极参与业务部门的事前讨论，包括新产品、新业务的开发讨论，新业务、新品种推出前的风险评估等，了解其中隐含的风险点，以有针对性地采取预防措施，化解风险或减少风险可能造成的损失。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制与风险管理理念，进一步完善内控制度，提高监察稽核工作水平，充分保障基金持有人的合法权益。

四. 基金年度中期财务报告

(一) 基金会计报告书（未经审计）

华安上证 180 指数增强型证券投资基金

资产负债表

2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2003 年 6 月 30 日
银行存款		117,659,935.69
清算备付金		13,196,968.20
交易保证金	3(1)	250,000.00
应收证券清算款		-
应收股利		138,278.81
应收利息	3(2)	1,476,539.81
应收申购款		4,857,350.84
其他应收款		-
股票投资市值	1(4)	971,757,531.83
其中：股票投资成本	1(4)	933,933,653.53
债券投资市值	1(5)	303,994,808.30
其中：债券投资成本	1(5)	308,026,974.20
配股权证		-
买入返售证券		-

待摊费用	3(3)	561,687.85
其他资产		-
资产总计		1,413,893,101.33
应付证券清算款		105,573,672.59
应付赎回款		1,976,013.82
应付赎回费		-
应付管理人报酬		1,064,031.57
应付托管费		212,806.33
应付佣金		1,153,683.26
应付利息		-
应付收益		-
其他应付款	3(4)	250,000.00
卖出回购证券款		15,000,000.00
预提费用	3(5)	242,987.07
其他负债		-
负债合计		125,473,194.64
实收基金	1(10) 3(6)	1,278,421,724.00
未实现利得	1(11) 3(7)	-7,139,319.35
未分配收益		17,137,502.04
持有人权益合计		1,288,419,906.69
负债及持有人权益总计		1,413,893,101.33

华安上证 180 指数增强型证券投资基金

经营业绩表

2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 11 月 8 日-2003 年 6 月 30 日
一、收入		112,389,076.99
1、股票差价收入	1(4)	78,909,929.76
2、债券差价收入	1(5)	11,033,885.20
3、债券利息收入	1(6)	5,844,597.77
4、存款利息收入	1(6)	7,650,201.18
5、股利收入	1(6)	7,047,412.16
6、买入返售证券收入	1(6)	1,391,014.00
7、其他收入	3(8)	512,036.92

二、费用		17,167,260.02
1、基金管理人报酬	1(7)	12,702,817.54
2、基金托管费	1(8)	2,540,563.43
3、卖出回购证券支出	1(9)	629,752.00
4、利息支出		-
5、其他费用	3(9)	1,294,127.05
其中：信息披露费		1,032,663.06
审计费用		96,917.91
三、基金净收益		95,221,816.97
加：未实现经营利得	1(4) 1(5)	33,791,712.40
四、基金经营业绩		129,013,529.37

华安上证 180 指数增强型证券投资基金
收益分配表

2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 11 月 8 日-2003 年 6 月 30 日
本期基金净收益		95,221,816.97
加：期初基金净收益		-
加：本期损益平准金	1(12)	-15,403,697.98
可供分配基金净收益		79,818,118.99
减：本期已分配基金净收益	1(13)	62,680,616.95
期末未分配净收益		17,137,502.04

华安上证 180 指数增强型证券投资基金
净值变动表

2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注	2002 年 11 月 8 日- 2003 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		3,094,001,258.61
二、本期经营活动：		
基金净收益		95,221,816.97
未实现经营利得变动数	1(11)	33,791,712.40
经营活动产生的基金净值变动数		129,013,529.37
三、本期基金单位交易		

基金申购款	494,851,585.96
基金赎回款	2,366,765,850.30
基金单位交易产生的基金净值变动数	-1,871,914,264.34
四、本期向持有人分配收益:	
向持有人分配收益产生的基金净值变动数	-62,680,616.95
五、期末基金净值	1,288,419,906.69

(二) 会计报告书附注

1、主要会计政策

(1) 会计年度: 公历 1 月 1 日至 12 月 31 日。本会计期间为 2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日。

(2) 记账原则和计价基础: 本基金的会计核算以权责发生制为记账原则, 除股票投资和债券投资按市值计价外, 其余均以历史成本为计价基础。

(3) 记账本位币: 人民币; 记账单位: 元。

(4) 股票投资:

买入股票于成交日确认为股票投资, 股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。

卖出股票于成交日确认股票差价收入, 出售股票的成本按移动加权平均法逐日结转。

股票包括上市交易股票和未上市交易股票。上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值; 估值日无交易的, 以最近交易日的市场交易收盘价估值。首次公开发行但未上市的股票, 按成本估值; 由于配股和增发形成的未上市股票, 按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

(5) 债券投资:

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资; 买入银行同业间市场交易的债券于实际支付价款时确认为债券投资。债券投资按成交日应支付的全部价款入账, 其中所包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 作为应收利息单独核算, 不构成债券投资成本。

卖出证券交易所交易的债券于成交日确认债券差价收入; 卖出银行同业间市场交易的债券于实际收到全部价款时确认债券差价收入。出售债券的成本按移动加权平均法逐日结转。

上市流通债券按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值; 估值日无交易的, 以最近交易日的市场交易收盘价估值。未上市流通债券按成本估值。实际成本与估值的差异计入“未实现利得”科目。

（6）收入确认：

① 股票差价收入于卖出股票成交日按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额确认。

② 证券交易所交易的债券差价收入于卖出成交日、银行同业间市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

③ 债券利息收入于债券实际持有期内按债券票面价值与票面利率逐日计提。

④ 存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提。

⑤ 股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额确认。

⑥ 买入返售证券收入按融出资金额及约定利率，在返售期限内采用直线法逐日计提。

（7）基金管理人报酬

基金管理人报酬为按《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》的规定计提的基金管理人的管理费。基金管理人报酬按前一日基金资产净值的 1%年费率逐日计提，按月支付。

（8）基金托管费

基金托管费为按《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》的规定计提的基金托管人的托管费。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.2%年费率逐日计提，按月支付。

（9）卖出回购证券支出

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

（10）实收基金

实收基金为对外发行的基金单位总额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

（11）未实现利得/（损失）

未实现利得包括因投资估值而产生的未实现估值增值/（减值）和未实现利得/（损失）平准金。

未实现利得平准金指在申购或赎回基金单位时，申购或赎回款项中包含的按未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现利得平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列。

（12）损益平准金

损益平准金指在申购或赎回基金单位时，申购或赎回款项中包含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额。损益平准金于基金申购确认日及基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配收益。

（13）基金的收益分配原则

① 本基金收益以现金形式分配，但投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金单位净值自动转为基金单位进行再投资；

② 基金收益分配每年至少一次，成立不满 3 个月，收益不分配；

③ 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；基金投资当年出现净亏损，则不进行收益分配；

④ 基金收益分配后，每基金单位净值不能低于面值；

⑤ 每一基金单位享有同等分配权；

⑥ 红利分配时所发生的银行转账或其他手续费由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册与过户登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金单位净值自动转为基金单位，不足一份基金单位的，四舍五入。

(14) 主要税项

根据财政部、国家税务总局财税字[1998]55 号文及[2001] 61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》，以及财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，主要税项规定如下：

① 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。

② 基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，在 2003 年年底暂免征收营业税和企业所得税。

③ 基金从证券市场中取得的其他收入包括股票的股息、红利收入、债券的利息收入、储蓄存款利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

④ 基金买卖股票按成交额的 0.2% 缴纳证券（股票）交易印花税。

2、关联交易

(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	基金发起人 基金管理人 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

(2) 通过关联人席位交易情况：

① 本基金通过关联人席位 2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日的股票交易情况：

关 联 人	股票成交量	占成交总量比例	佣金	占佣金总量比例	平均佣金比率
申银万国证券股份有限公司	415,317,168.21	13.46%	336,784.48	13.64%	0.08%

②本基金通过关联人席位 2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日的债券及回购交易情况:

关 联 人	债券成交量	占成交总量 比例	回购成交量	占成交总量 比例
申银万国证券股份有限公司	433,975,623.80	11.07%	-	-

(3) 本基金与关联人 2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日未进行银行间市场债券买卖交易和银行间市场债券回购交易。

(4) 管理人或托管人收取的报酬的计算标准及金额:

①基金管理费

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。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 12,702,817.54 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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 2,540,563.43 元。

3、主要报表项目说明 (单位: 人民币元)

(1) 交易保证金:

明细项目	期末数
中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司交易保证金	250,000.00

(2) 应收利息:

明细项目	期末数
银行存款和清算备付金利息	25,588.42
债券利息	1,450,951.39
合计	<u>1,476,539.81</u>

(3) 待摊费用：本基金设立募集所发生的法定信息披露费、律师费及会计师费等费用共计1,577,050.00元，列入待摊费用并从本基金成立日起，在一年内逐日摊销。本期末该项目尚未摊销余额为561,687.85元。

明细项目	期末数
信息披露费	477,990.25
审计费	12,465.85
律师费	<u>71,231.75</u>
合计	<u>561,687.85</u>

(4) 其他应付款：

明细项目	期末数
券商代垫交易保证金	250,000.00

(5) 预提费用：

明细项目	期末数
信息披露费	168,603.31
审计费	<u>74,383.76</u>
合计	<u>242,987.07</u>

(6) 实收基金：

明细项目	本期数
期初数	3,094,001,262.00
加：本期申购	479,301,580.00
减：本期赎回	2,294,881,118.00
期末数	<u>1,278,421,724.00</u>

(7) 未实现利得：

明细项目	本期数
期初未实现利得	-
加：本期未实现估值增值变动数	33,791,712.40
加：本期申购基金单位的未实现利得平准金	6,288,572.13
减：本期赎回基金单位的未实现利得平准金	47,219,603.88
期末未实现利得	<u>-7,139,319.35</u>

(8) 其他收入：

明细项目	本期数
新股手续费返还	160,536.20
配股手续费返还	10,042.62
发行期利息	288,958.10
其他	<u>52,500.00</u>
合计	<u>512,036.92</u>

(9) 其他费用：

明细项目	本期数
------	-----

返售与回购交易费用	27,549.28
律师费	128,768.25
审计费	96,917.91
信息披露费	1,032,663.06
其他	8,228.55
合计	<u>1,294,127.05</u>

（三）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。

2003 年 6 月 30 日估值时，已上市但流通受限的基金资产估值增值额为 52,016.14 元。

1、流通受限的新股

序号	股票名称	申购 确认日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	三一重工	03-06-23	03-07-03	54,000	840,240.00	840,240.00	上市日起流通
2	北方天鸟	03-06-24	03-07-04	18,000	172,800.00	172,800.00	上市日起流通
3	瑞贝卡	03-06-30	03-07-10	7,000	72,800.00	72,800.00	上市日起流通
合 计					<u>1,085,840.00</u>	<u>1,085,840.00</u>	

2、流通受限的配股

序号	股票名称	配股 确认日期	上市日期	数量	成本	市值	流通受限期
1	亚泰集团	03-06-26	03-07-08	83,897	400,188.69	452,204.83	上市日起流通

（四）基金投资组合

1、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	869,308,536.31	67.47%
(2)	非成分股增强性投资*	102,448,995.52	7.95%

*注：由于 2003 年 7 月 1 日上证 180 指数调整样本股，上述非成分股增强性投资市值的 73.90% 已于 2003 年 7 月 1 日计入指数型投资。

2、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	6,000,887.62	0.47%

B	采掘业	35,727,357.78	2.77%
C	制造业	396,415,753.51	30.77%
C0	其中：食品、饮料	33,154,251.40	2.57%
C1	纺织、服装、皮毛	18,985,694.77	1.47%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,866,764.34	0.14%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	31,196,406.62	2.42%
C5	电子	43,244,937.66	3.36%
C6	金属、非金属	117,626,971.29	9.13%
C7	机械、设备、仪表	84,969,892.59	6.60%
C8	医药、生物制品	60,585,477.84	4.70%
C99	其他	4,785,357.00	0.37%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	74,249,993.76	5.76%
E	建筑业	17,743,444.98	1.38%
F	交通运输、仓储业	105,086,900.21	8.16%
G	信息技术业	82,124,886.69	6.37%
H	批发和零售贸易	17,686,365.55	1.37%
I	金融、保险业	124,832,247.94	9.69%
J	房地产业	21,131,957.25	1.64%
K	社会服务业	36,695,333.50	2.85%
L	传播与文化产业	7,352,358.80	0.57%
M	综合类	46,710,044.24	3.63%
	合 计	<u>971,757,531.83</u>	<u>75.42%</u>

3、债券（不包括国债）合计

截止 2003 年 6 月 30 日，基金持有债券（不含应收利息）38,246,517.30 元，占基金资产净值的 2.97%。

4、国债、货币资金合计

截止 2003 年 6 月 30 日，基金持有的国债（不含应收利息）及货币资金合计为 291,031,522.30 元，占基金资产净值的 22.59%。

5、基金投资股票明细

1) 指数型投资

序号	名 称	数量（股）	市值（元）	占净值比例
1	招商银行	4,361,621	49,373,549.72	3.83%
2	宝钢股份	6,994,206	35,740,392.66	2.77%
3	浦发银行	2,903,488	33,883,704.96	2.63%
4	上海汽车	2,849,486	33,880,388.54	2.63%
5	中国石化	6,975,410	26,088,033.40	2.02%
6	上港集箱	2,058,787	24,520,153.17	1.90%
7	民生银行	2,449,300	24,419,521.00	1.90%
8	申能股份	1,843,029	21,821,463.36	1.69%

9	上海机场	2,023,163	21,526,454.32	1.67%
10	国电电力	1,562,112	15,261,834.24	1.18%
11	华能国际	996,837	14,803,029.45	1.15%
12	方正科技	1,153,542	13,842,504.00	1.07%
13	哈药集团	603,175	13,149,215.00	1.02%
14	天津港	1,148,040	12,685,842.00	0.98%
15	东方明珠	551,184	11,486,674.56	0.89%
16	上海石化	2,613,770	11,291,486.40	0.88%
17	东风汽车	878,066	11,204,122.16	0.87%
18	原水股份	1,487,186	11,124,151.28	0.86%
19	同仁堂	532,775	10,495,667.50	0.81%
20	广电电子	1,042,926	10,116,382.20	0.79%
21	马钢股份	2,460,111	10,111,056.21	0.78%
22	首创股份	942,808	10,088,045.60	0.78%
23	四川长虹	1,382,010	9,356,207.70	0.73%
24	伊利股份	407,494	9,241,963.92	0.72%
25	华北制药	1,413,422	8,862,155.94	0.69%
26	清华同方	569,123	8,644,978.37	0.67%
27	山东基建	1,720,384	7,913,766.40	0.61%
28	青岛海尔	800,532	7,500,984.84	0.58%
29	烟台万华	640,880	7,447,025.60	0.58%
30	上海电气	702,395	7,438,363.05	0.58%
31	梅雁股份	1,965,647	7,430,145.66	0.58%
32	安阳钢铁	1,119,637	7,423,193.31	0.58%
33	陆家嘴	568,141	7,414,240.05	0.58%
34	生益科技	825,842	7,292,184.86	0.57%
35	外运发展	373,725	7,179,257.25	0.56%
36	雅戈尔	690,291	7,047,871.11	0.55%
37	贵州茅台	281,153	7,017,578.88	0.54%
38	大众公用	884,094	6,931,296.96	0.54%
39	双鹤药业	450,913	6,741,149.35	0.52%
40	广电信息	552,582	6,691,768.02	0.52%
41	福耀玻璃	556,541	6,678,492.00	0.52%
42	上海建工	853,894	6,617,678.50	0.51%
43	上海医药	742,338	6,577,114.68	0.51%
44	歌华有线	312,640	6,540,428.80	0.51%
45	爱建股份	587,412	6,514,399.08	0.51%
46	武钢股份	1,376,794	6,305,716.52	0.49%
47	邯郸钢铁	1,105,270	6,078,985.00	0.47%
48	北大荒	982,142	6,000,887.62	0.47%
49	山东铝业	519,949	5,989,812.48	0.46%
50	太太药业	309,363	5,760,339.06	0.45%
51	青岛啤酒	650,571	5,568,887.76	0.43%
52	中海发展	994,557	5,480,009.07	0.43%
53	海螺水泥	673,781	5,235,278.37	0.41%

54	中化国际	605,651	5,196,485.58	0.40%
55	兖州煤业	570,158	5,091,510.94	0.40%
56	江西铜业	990,763	5,052,891.30	0.39%
57	中远发展	534,516	4,874,785.92	0.38%
58	齐鲁石化	907,572	4,855,510.20	0.38%
59	紫江企业	357,650	4,785,357.00	0.37%
60	海欣股份	392,523	4,780,930.14	0.37%
61	广州控股	443,671	4,742,842.99	0.37%
62	上海贝岭	427,066	4,684,914.02	0.36%
63	北亚集团	690,215	4,679,657.70	0.36%
64	内蒙华电	823,554	4,661,315.64	0.36%
65	张江高科	743,958	4,605,100.02	0.36%
66	南钢股份	536,387	4,532,470.15	0.35%
67	海信电器	600,774	4,475,766.30	0.35%
68	莱钢股份	605,874	4,295,646.66	0.33%
69	第一百货	614,442	4,288,805.16	0.33%
70	复星实业	381,475	4,268,705.25	0.33%
71	东方集团	755,371	4,252,738.73	0.33%
72	安彩高科	449,194	4,235,899.42	0.33%
73	乐凯胶片	320,148	4,197,140.28	0.33%
74	隧道股份	607,340	4,135,985.40	0.32%
75	强生控股	480,898	3,751,004.40	0.29%
76	上海能源	332,780	3,740,447.20	0.29%
77	北京城建	397,405	3,719,710.80	0.29%
78	东软股份	309,995	3,676,540.70	0.29%
79	巴士股份	704,127	3,668,501.67	0.28%
80	钢联股份	703,872	3,463,050.24	0.27%
81	福建高速	413,565	3,407,775.60	0.26%
82	中青旅	366,654	3,406,215.66	0.26%
83	浙江广厦	603,334	3,270,070.28	0.25%
84	中华企业	509,663	3,236,360.05	0.25%
85	酒钢宏兴	506,718	3,222,726.48	0.25%
86	杭钢股份	398,294	3,214,232.58	0.25%
87	鞍山信托	472,023	3,143,673.18	0.24%
88	用友软件	59,804	3,077,513.84	0.24%
89	烽火通信	258,145	2,940,271.55	0.23%
90	龙腾科技	285,110	2,862,504.40	0.22%
91	浦东金桥	280,189	2,821,503.23	0.22%
92	星湖科技	346,762	2,819,175.06	0.22%
93	金地集团	194,760	2,785,068.00	0.22%
94	东北高速	598,592	2,777,466.88	0.22%
95	春兰股份	382,665	2,617,428.60	0.20%
96	悦达投资	385,700	2,588,047.00	0.20%
97	广钢股份	370,277	2,554,911.30	0.20%
98	上实发展	301,231	2,433,946.48	0.19%

99	航天机电	303,939	2,425,433.22	0.19%
100	复旦复华	289,490	2,411,451.70	0.19%
101	大唐电信	212,657	2,354,112.99	0.18%
102	稀土高科	265,565	2,302,448.55	0.18%
103	海南航空	408,766	2,293,177.26	0.18%
104	中远航运	284,738	2,292,140.90	0.18%
105	东方航空	490,113	2,097,683.64	0.16%
106	首旅股份	164,801	1,956,187.87	0.15%
107	宝钛股份	152,300	1,943,348.00	0.15%
108	莲花味精	278,336	1,934,435.20	0.15%
109	青鸟华光	228,198	1,912,299.24	0.15%
110	华源发展	221,498	1,898,237.86	0.15%
111	华联商厦	266,865	1,881,398.25	0.15%
112	综艺股份	159,789	1,872,727.08	0.15%
113	昌河股份	197,389	1,871,247.72	0.15%
114	青山纸业	493,853	1,866,764.34	0.14%
115	申达股份	242,683	1,866,232.27	0.14%
116	上海梅林	201,078	1,866,003.84	0.14%
117	友好集团	293,803	1,836,268.75	0.14%
118	京能热电	191,183	1,835,356.80	0.14%
119	茉 织 华	189,029	1,797,665.79	0.14%
120	云大科技	248,356	1,785,679.64	0.14%
121	上海九百	283,871	1,620,903.41	0.13%
122	亚星化学	190,537	1,619,564.50	0.13%
123	凯诺科技	156,580	1,521,957.60	0.12%
124	中国国贸	213,685	1,397,499.90	0.11%
125	沪昌特钢	141,100	1,048,373.00	0.08%
126	中视传媒	82,850	811,930.00	0.06%
127	兰花科创	92,376	807,366.24	0.06%
128	亚泰集团	83,897	452,204.83	0.04%
	合 计		869,308,536.31	67.47%

2) 非成分股增强性投资

序号	名 称	数量 (股)	市值 (元)	占净值比例
1	中国联通	14,185,300	45,676,666.00	3.55%
2	白云机场	1,784,410	15,506,522.90	1.20%
3	光明乳业	575,335	7,525,381.80	0.58%
4	中信证券	986,500	7,497,400.00	0.58%
5	威孚高科	572,158	6,465,385.40	0.50%
6	桂冠电力	376,176	4,514,112.00	0.35%
7	长电科技	300,000	3,684,000.00	0.29%
8	皖通高速	645,952	3,675,466.88	0.29%
9	福田汽车	234,965	3,261,314.20	0.25%
10	天 士 力	154,190	1,911,956.00	0.15%

11	上海航空	216,726	1,644,950.34	0.13%
12	三一重工	54,000	840,240.00	0.07%
13	北方天鸟	18,000	172,800.00	0.01%
14	瑞贝卡	7,000	72,800.00	0.01%
	合 计		102,448,995.52	7.95%

6、报告附注

(1) 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。

(2) 本基金不存在购入成本已超过基金资产净值 10%的股票。

(3)截止 2003 年 6 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 12,615,664.74 元。股票市值 971,757,531.83 元、债券市值（不含国债）38,246,517.30 元、国债及货币资金 291,031,522.30 元合计与其相减后等于基金净值。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、卖出回购证券款以及预提费用。

(4) 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 2003 年 6 月 30 日，本基金前 30 个交易日的日跟踪偏离度为 0.08%。

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 2003 年 6 月 30 日，本基金投资组合中持有的上证 180 指数成份股数量为 128 只（本基金非成份股增强性投资中的 8 只股票已于 7 月 1 日调入上证 180 指数成份股）；
- 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 2003 年 6 月 30 日，本基金投资组合中投资的股票资产占基金资产净值的 75.42%。

(五) 本期新增股票

序号	股票名称	本期新增			本期卖出
		一级市场申购	二级市场买入	其他	
1	威孚高科	0	1,250,804	0	678,646
2	浦发银行	0	6,163,727	1,326,128	4,586,367

3	邯钢钢铁	0	2,319,947	0	1,214,677
4	齐鲁石化	0	1,551,219	0	643,647
5	东北高速	0	1,613,837	0	1,015,245
6	白云机场	565,000	1,384,410	0	165,000
7	武钢股份	0	1,990,399	197,980	811,585
8	东风汽车	0	1,629,733	0	751,667
9	中国国贸	0	793,660	0	579,975
10	首创股份	0	1,859,360	0	916,552
11	上海机场	0	3,538,326	0	1,515,163
12	钢联股份	0	1,623,019	0	919,147
13	华能国际	0	1,639,797	0	642,960
14	皖通高速	212,000	645,952	0	212,000
15	民生银行	0	4,764,101	700,406	3,015,207
16	上港集箱	0	2,049,407	1,349,957	1,340,577
17	宝钢股份	0	13,786,509	0	6,792,303
18	中海发展	0	1,809,937	0	815,380
19	中国石化	0	13,909,994	0	6,934,584
20	中信证券	1,078,000	986,500	0	1,078,000
21	三一重工	54,000	0	0	0
22	福建高速	0	916,672	110,441	613,548
23	招商银行	0	8,585,989	0	4,224,368
24	歌华有线	0	577,285	0	264,645
25	中国联通	0	15,505,934	0	1,320,634
26	浙江广厦	0	1,096,175	0	492,841
27	龙腾科技	0	579,550	94,461	388,901
28	海信电器	0	1,224,476	0	623,702
29	双鹤药业	0	804,527	0	353,614
30	上海梅林	0	460,345	0	259,267
31	青鸟华光	0	489,420	0	261,222
32	同仁堂	0	855,703	0	322,928
33	中视传媒	0	87,550	0	4,700
34	广州控股	0	917,740	0	474,069
35	清华同方	0	1,241,516	0	672,393
36	莱钢股份	0	1,536,328	0	930,454
37	青山纸业	0	1,621,418	0	1,127,565
38	上海汽车	0	6,828,963	0	3,979,477
39	稀土高科	0	895,678	0	630,113
40	东方航空	0	1,715,468	0	1,225,355
41	兰花科创	0	478,330	0	385,954
42	杭钢股份	0	887,613	0	489,319
43	乐凯胶片	0	612,865	0	292,717
44	青旅控股	0	677,857	0	311,203
45	航天机电	0	564,624	0	260,685
46	福田汽车	0	234,965	0	0
47	上海建工	0	2,060,623	0	1,206,729

48	上海贝岭	0	993,169	0	566,103
49	雅 戈 尔	0	1,442,575	0	752,284
50	云大科技	0	432,022	0	183,666
51	生益科技	0	1,387,948	0	562,106
52	莲花味精	0	1,159,265	0	880,929
53	兖州煤业	0	1,011,995	0	441,837
54	复星实业	0	702,815	0	321,340
55	大唐电信	0	673,622	0	460,965
56	山东铝业	0	925,349	0	405,400
57	安彩高科	0	884,263	0	435,069
58	紫江企业	0	988,755	0	631,105
59	海南航空	0	949,765	0	540,999
60	桂冠电力	0	376,176	0	0
61	首旅股份	0	386,828	0	222,027
62	北京城建	0	1,124,835	0	727,430
63	外运发展	0	664,339	0	290,614
64	南钢股份	0	775,687	0	239,300
65	酒钢宏兴	0	519,601	0	12,883
66	烟台万华	0	988,310	0	347,430
67	亚星化学	0	364,110	0	173,573
68	山东基建	0	3,074,175	0	1,353,791
69	江西铜业	0	1,768,549	0	777,786
70	昌河股份	0	278,013	0	80,624
71	太太药业	0	597,708	0	288,345
72	金地集团	0	417,392	0	222,632
73	凯诺科技	0	257,001	0	100,421
74	中远航运	0	578,070	0	293,332
75	北方天鸟	18,000	0	0	0
76	瑞 贝 卡	7,000	0	0	0
77	宝钛股份	0	152,300	0	0
78	烽火通信	0	602,174	0	344,029
79	中化国际	0	1,267,099	0	661,448
80	上海能源	0	624,828	0	292,048
81	贵州茅台	0	498,569	0	217,416
82	天 士 力	0	269,535	0	115,345
83	茉 织 华	0	477,583	0	288,554
84	安阳钢铁	0	1,964,174	0	844,537
85	京能热电	0	217,900	0	26,717
86	长电科技	31,000	400,000	0	131,000
87	海螺水泥	0	1,156,190	0	482,409
88	用友软件	0	135,272	0	75,468
89	上海航空	0	659,126	0	442,400
90	光明乳业	0	1,051,857	0	476,522
91	北 大 荒	0	1,690,112	0	707,970
92	青岛啤酒	0	1,303,423	0	652,852

93	方正科技	0	1,625,200	0	471,658
94	广电电子	0	2,099,710	0	1,056,784
95	复旦复华	0	778,038	0	488,548
96	申达股份	0	846,165	0	603,482
97	第一百货	0	1,169,896	0	555,454
98	华联商厦	0	725,935	0	459,070
99	大众科创	0	1,704,272	0	820,178
100	广电信息	0	1,309,750	0	757,168
101	浦东金桥	0	662,586	0	382,397
102	中远发展	0	1,009,624	0	475,108
103	申能股份	0	3,297,471	0	1,454,442
104	爱建股份	0	1,423,432	0	836,020
105	原水股份	0	2,701,870	0	1,214,684
106	福耀玻璃	0	772,559	0	216,018
107	强生控股	0	1,142,676	0	661,778
108	陆家嘴	0	991,139	0	422,998
109	哈药集团	0	1,291,784	0	688,609
110	沪昌特钢	0	141,100	0	0
111	中华企业	0	1,630,011	0	1,120,348
112	上海石化	0	4,817,889	0	2,204,119
113	青岛海尔	0	1,708,588	0	908,056
114	北亚集团	0	1,746,162	0	1,055,947
115	天津港	0	1,956,878	0	808,838
116	东软股份	0	677,644	0	367,649
117	巴士股份	0	1,900,065	0	1,195,938
118	上实发展	0	301,231	0	0
119	华源发展	0	506,815	0	285,317
120	综艺股份	0	441,312	0	281,523
121	友好集团	0	723,862	0	430,059
122	国电电力	0	2,380,139	0	818,027
123	悦达投资	0	794,566	0	408,866
124	马钢股份	0	4,175,697	0	1,715,586
125	东方集团	0	2,328,209	0	1,572,838
126	华北制药	0	2,911,843	0	1,498,421
127	鞍山信托	0	538,200	0	66,177
128	隧道股份	0	1,081,971	0	474,631
129	东方明珠	0	1,181,370	0	630,186
130	上海电气	0	1,010,745	107,221	415,571
131	上海九百	0	329,591	0	45,720
132	四川长虹	0	3,580,104	0	2,198,094
133	上海医药	0	997,566	255,517	510,745
134	海欣股份	0	858,728	0	466,205
135	春兰股份	0	1,164,462	0	781,797
136	内蒙华电	0	992,685	566,351	735,482
137	星湖科技	0	1,070,061	0	723,299

138	梅雁股份	0	4,337,673	103,253	2,475,279
139	亚泰集团	0	1,334,696	83,897	1,334,696
140	伊利股份	0	785,161	0	377,667
141	广钢股份	0	804,770	0	434,493
142	张江高科	0	1,488,996	256,367	1,001,405

新增股票附注：本表中“其他”项目包括“配转送增”。

(六) 本期剔除股票

序号	股票名称	期初结存	本期增加	本期卖出
1	中兴通讯	0	58,788	58,788
2	中联重科	0	379,310	379,310
3	海虹控股	0	26,511	26,511
4	TCL 通讯	0	221,319	221,319
5	格力电器	0	564,639	564,639
6	唐钢股份	0	729,555	729,555
7	韶钢松山	0	497,328	497,328
8	华东科技	0	1,603,150	1,603,150
9	四川路桥	0	123,000	123,000
10	南京高科	0	807,448	807,448
11	葛洲坝	0	224,184	224,184
12	多佳股份	0	60,600	60,600
13	云天化	0	444,732	444,732
14	亚盛集团	0	198,867	198,867
15	郑州煤电	0	18,000	18,000
16	宏图高科	0	37,001	37,001
17	波导股份	0	128,998	128,998
18	东湖高新	0	7,900	7,900
19	宁夏恒力	0	7,359	7,359
20	武汉控股	0	322,178	322,178
21	九发股份	0	4,900	4,900
22	锦州港	0	8,700	8,700
23	中牧股份	0	311,407	311,407
24	罗顿发展	0	803,000	803,000
25	万杰高科	0	160,909	160,909
26	冠农股份	0	21,000	21,000
27	路桥建设	0	74,200	74,200
28	海正药业	0	171,052	171,052
29	华芳纺织	0	93,000	93,000
30	大恒科技	0	196,772	196,772
31	星新材料	0	180,153	180,153
32	华泰股份	0	244,349	244,349
33	上海家化	0	311,851	311,851
34	天房发展	0	5,300	5,300

35	天通股份	0	20,700	20,700
36	广州药业	0	450,537	450,537
37	航天动力	0	54,000	54,000
38	长江通信	0	129,351	129,351
39	五洲交通	0	1,100	1,100
40	三房巷	0	38,000	38,000
41	星马汽车	0	21,000	21,000
42	宁沪高速	0	393,595	393,595
43	北京巴士	0	491,060	491,060
44	太工天成	0	6,000	6,000
45	盘江股份	0	644,620	644,620
46	安泰集团	0	61,000	61,000
47	三友化工	0	114,000	114,000
48	江汽股份	0	100,340	100,340
49	冠豪高新	0	62,000	62,000
50	片仔癀	0	25,000	25,000
51	时代新材	0	21,000	21,000
52	贵研铂业	0	21,000	21,000
53	士兰微	0	15,000	15,000
54	双良股份	0	84,000	84,000
55	中科合臣	0	6,000	6,000
56	安徽水利	0	54,000	54,000
57	腾达建设	0	56,000	56,000
58	联环药业	0	5,000	5,000
59	华海药业	0	19,000	19,000
60	中铁二局	0	543,015	543,015
61	海通集团	0	37,000	37,000
62	北海国发	0	42,000	42,000
63	深高速	0	1,221,753	1,221,753
64	高淳陶瓷	0	11,000	11,000
65	法拉电子	0	32,000	32,000
66	惠泉啤酒	0	43,000	43,000
67	芜湖港	0	32,000	32,000
68	庆丰股份	0	48,000	48,000
69	海油工程	0	211,804	211,804
70	龙头股份	0	1,021,692	1,021,692
71	新黄浦	0	143,948	143,948
72	联通国脉	0	31,606	31,606
73	飞乐音响	0	180,755	180,755
74	爱使股份	0	92,800	92,800
75	飞乐股份	0	124,032	124,032
76	青鸟天桥	0	356,383	356,383
77	尖峰集团	0	60,900	60,900
78	浙江中汇	0	7,300	7,300
79	鲁北化工	0	902,879	902,879

80	一汽四环	0	130,093	130,093
81	华银电力	0	1,177,071	1,177,071
82	东方通信	0	644,972	644,972
83	鲁抗医药	0	54,186	54,186
84	宁波海运	0	362,727	362,727
85	北京城乡	0	447,332	447,332
86	仪征化纤	0	214,600	214,600
87	中炬高新	0	173,515	173,515
88	创业环保	0	159,671	159,671
89	长春长铃	0	50,000	50,000
90	中海海盛	0	65,000	65,000

五. 重要事项揭示

1. 本基金管理人、托管人在本期内未发生任何诉讼事项；
2. 华安基金管理有限公司于 2002 年 9 月 26 日获中国证券监督管理委员会证监基金字[2002]70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立的批复》，同意由华安基金管理有限公司发起设立华安上证 180 指数增强型证券投资基金。本基金于 2002 年 10 月 15 日起向社会公众公开发行；
3. 本基金首次募集基金单位 3,094,001,262 份，于 2002 年 11 月 8 日正式成立，并由普华永道中天会计师事务所有限公司于 2002 年 11 月 8 日出具了《华安上证 180 指数增强型证券投资基金个人及机构投资者认购资金到位情况的审验报告》和《华安上证 180 指数增强型证券投资基金设立验资报告》，对本基金首次发行募集净资产予以验证；
4. 本基金经过 30 个工作日的闭锁期，于 2002 年 12 月 20 日起开始办理日常申购赎回业务；
5. 华安基金管理有限公司上海投资理财中心和北京投资理财中心已开通 10 万元（含 10 万元）人民币以上个人投资者的直销业务；
6. 本基金管理人自 2003 年 4 月 7 日起推出上海地区个人投资者“华安特快”基金电子交易业务，使用“银基通”作为基金电子交易的资金结算途径。详情请参阅 2003 年 4 月 7 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》。该业务推广期从 2003 年 4 月 7 日至 2003 年 10 月 7 日；
7. 本基金管理人自 2003 年 4 月 28 日起在“华安特快”基金电子交易业务中增加“银联通”资金结算方式。详情请参阅 2003 年 4 月 28 日的《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》；
8. 本基金于 2003 年 5 月 16 日公告实施分红：以 2003 年 5 月 14 日已实现的可分配收益为基准，每 10 份基金单位派发现金红利 0.50 元，除息日为 2003 年 5 月 26 日；
9. 本基金管理人自 2003 年 6 月 9 日起调低首次申购数额限制，投资者在交通

银行、中国银行、国泰君安证券股份有限公司、华夏证券股份有限公司等代销机构的网点首次申购华安 180 的最低金额从原人民币 5,000 元调整为人民币 1,000 元。在中国工商银行的网点进行首次申购的最低金额的调整日期，以中国工商银行网点公告为准；

10. 2002 年 11 月 8 日至 2003 年 6 月 30 日各券商股票、债券及回购交易情况和佣金情况如下：

①股票交易情况与佣金情况：

券 商	成交量	占成交总量 比例	佣金	占佣金总量 比例
中信证券股份有限公司	608,469,271.78	19.71%	489,804.31	19.84%
华夏证券股份有限公司	547,673,250.21	17.74%	441,918.16	17.90%
招商证券股份有限公司	477,379,719.55	15.47%	380,374.12	15.41%
国泰君安证券股份有限公司	432,981,709.82	14.03%	347,010.72	14.06%
申银万国证券股份有限公司	415,317,168.21	13.46%	336,784.48	13.64%
宏源证券股份有限公司	407,556,426.96	13.20%	330,580.25	13.39%
北方证券有限责任公司	197,290,652.02	6.39%	141,776.73	5.74%
合 计	<u>3,086,668,198.55</u>	<u>100.00%</u>	<u>2,468,248.77</u>	<u>100.00%</u>

②债券及回购交易情况：

券 商	债券成交量	占成交总量 比例	回购成交量	占成交总 量比例
招商证券股份有限公司	1,057,108,116.40	26.97%	145,000,000.00	5.07%
中信证券股份有限公司	690,552,208.10	17.62%	390,000,000.00	13.63%
国泰君安证券股份有限公司	667,872,258.60	17.04%	240,000,000.00	8.39%
华夏证券股份有限公司	553,419,442.60	14.12%	190,000,000.00	6.64%
申银万国证券股份有限公司	433,975,623.80	11.07%	-	0.00%
北方证券有限责任公司	327,137,688.80	8.35%	1,671,200,000.00	58.41%
宏源证券股份有限公司	189,079,165.90	4.82%	225,100,000.00	7.87%
合 计	<u>3,919,144,504.20</u>	<u>100.00%</u>	<u>2,861,300,000.00</u>	<u>100.00%</u>

六、 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开放式基金定期定额业务规则》。
5. 华安基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程。
6. 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。

华安基金管理有限公司

二零零三年八月二十九日