

华安上证 180 指数增强型证券投资基金

投资组合公告

(2003 年第 3 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 2003 年 10 月 17 日复核了本公告。

截止 2003 年 9 月 30 日，华安上证 180 指数增强型证券投资基金资产净值为 1,506,726,937.19 元，基金份额为 1,576,872,513 份，单位基金净值为 0.956 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	1,081,373,856.10	71.77%
2	非成分股增强性投资	59,365,593.52	3.94%

(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	8,399,158.65	0.56%
B	采掘业	44,531,805.73	2.96%
C	制造业	482,730,911.88	32.04%
C0	其中：食品、饮料	44,597,198.01	2.96%
C1	纺织、服装、皮毛	18,585,244.67	1.23%
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	10,319,978.66	0.69%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	38,277,254.56	2.54%
C5	电子	69,493,078.14	4.61%
C6	金属、非金属	136,843,144.30	9.08%
C7	机械、设备、仪表	94,633,819.49	6.28%
C8	医药、生物制品	64,888,253.89	4.31%
C99	其他	5,092,940.16	0.34%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	77,261,024.63	5.13%
E	建筑业	17,072,356.83	1.13%
F	交通运输、仓储业	125,623,987.15	8.34%
G	信息技术业	113,566,944.20	7.54%

H	批发和零售贸易	16,104,856.16	1.07%
I	金融、保险业	115,006,485.55	7.63%
J	房地产业	26,832,262.19	1.78%
K	社会服务业	39,670,974.03	2.63%
L	传播与文化产业	7,947,071.16	0.53%
M	综合类	65,991,611.46	4.38%
	合 计	<u>1,140,739,449.62</u>	<u>75.71%</u>

（三）债券（不包括国债）合计

截止 2003 年 9 月 30 日，基金持有债券（不含应收利息）48,248,249.50 元，占基金资产净值的 3.20%。

（四）国债、货币资金合计

截止 2003 年 9 月 30 日，基金持有的国债（不含应收利息）及货币资金合计为 361,762,412.88 元，占基金资产净值的 24.01%。

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	55,470,544.40	3.68%
2	宝钢股份	44,243,414.25	2.94%
3	招商银行	43,503,764.64	2.89%
4	上海汽车	33,979,989.33	2.26%
5	中国石化	33,663,299.92	2.23%
6	浦发银行	30,155,054.72	2.00%
7	上港集箱	27,377,400.00	1.82%
8	上海机场	21,009,613.88	1.39%
9	申能股份	20,993,535.75	1.39%
10	哈药集团	20,817,474.32	1.38%

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	白云机场	14,798,425.50	0.98%
2	华泰股份	7,083,506.12	0.47%
3	华夏银行	6,657,384.00	0.44%
4	威孚高科	6,191,186.40	0.41%
5	中原高速	4,111,380.00	0.27%

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 2003 年 9 月 30 日，本基金其他应收应付款项为贷方余额 44,023,174.81 元。股票市值 1,140,739,449.62 元、债券市值（不含国债）48,248,249.50 元、国债及货币资金 361,762,412.88 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、应付回购利息、其他应付款、卖出回购证券款以及预提费用。

（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 2003 年 9 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 9 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 157 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 2003 年 9 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 75.71%。

华安基金管理有限公司

2003 年 10 月 25 日