华安上证180交易型开放式指数证券投资基金 2008年年度报告摘要

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3月26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3月23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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2008年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	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	197,022,674.00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

2.4信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2008年	2007年	2006年4月13日-2006年12月31日
本期已实现收益	-555,993,757.32	474,843,317.22	164,970,904.01
本期利润	-1,210,037,899.73	616,638,203.86	312,986,078.21
加权平均基金份额本期利润	-0.8765	0.5376	2.1205
本期基金份额净值增长率	-64.55%	146.39%	81.63%
3.1.2 期末数据和指标	2008年	2007年	2006年4月13日-2006年12月31日
期末可供分配基金份额利润	1.5231	6.2433	0.9741
期末基金资产净值	828,737,582.44	1,522,737,921.57	399,827,256.44
期末基金份额净值	4.206	11.866	4.816

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)

4、本基金基金合同生效日为2006年4月13日,合同生效日当年的主要会计数据和财务指标按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算

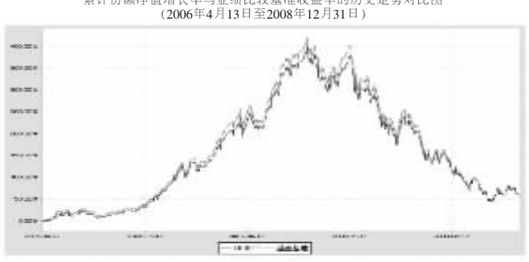
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	-19.55%	3.00%	-20.18%	3.12%	0.63%	-0.12%
过去六个月	-33.44%	2.93%	-35.39%	3.07%	1.95%	-0.14%
过去一年	-64.55%	2.96%	-66.34%	3.07%	1.79%	-0.11%
自基金合同生效起至今	58.63%	2.40%	58.63%	2.47%	0.00%	-0.07%

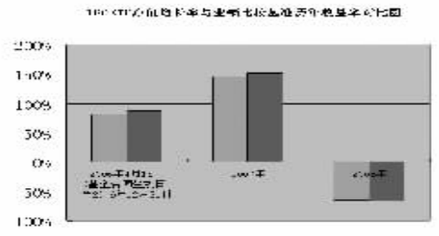
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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的历史走势对比图
(2006年4月13日至2008年12月31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,本基金已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。

3.2.3自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金基金合同生效日为2006年4月13日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2008年	-	-	-	-	-
2007年	-	-	-	-	-
2006年	0.450	3,790,022.28	-	3,790,022.28	-
合计	0.450	3,790,022.28	-	3,790,022.28	-

§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2008年12月31日,公司旗下共管理了基金安信、基金安顺2只封闭式证券投资基金,华安创新、华安中国A股、华安富利、华安宝利、上证180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等11只开放式基金,管理资产规模达到694.94亿人民币,0.97亿美元。

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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
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。
刘璎	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、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 管理人对投告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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,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2008年12月31日,本基金份额净值为4.206元。本报告期(2008年1月1日至2008年12月31日)基金净值增长-64.55%,同期上证180指数下跌-66.34%,基金净值表现好于同期标的指数;本基金收益率与上证180指数同期收益率的跟踪误差为0.155%,累计跟踪偏离度为1.79%,与上证180指数同期收益率的相关系数为99.95%。

自2008年2月1日起,上海证券交易所和中证指数有限公司调整了自由流通量实施规则,以进一步提高上证180指数可投资性。相应的,我们将本基金指数跟踪方法也进行了变更,由过去的抽样复制改为全复制。上证180指数依照惯例于2008年7月1日及2009年1月5日进行了两次指数成分股调整,根据基金相关法律法规,我们以平稳过渡为原则对本基金投资组合进行了相应调整。

由于受到全球金融危机的影响,2008年国内外经济形势异常严峻。面对国内股市的大幅下挫以及外围经济形势持续低迷,投资者信心遭受较大打击,上市公司盈利预期不断下调的情况,在本基金的投资策略上,我们在满足指数基金法律法规和基金合同的前提下,相应的持续采取了谨慎保守的投资策略,以尽可能降低市场下跌对基金投资组合所造成的冲击。

截至12月31日,本基金仓位为96.08%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场方面,我们认为对2009年的中国经济不应过分悲观,后续应继续观察信贷及宏观经济的相关数据,以及经济刺激政策和产业振兴规划的进一步深入和细化,同时也应该对市场短期大幅冲高保持一定的谨慎,避免盲目乐观。

对于2009年经济形势,我们维持U型底部震荡的判断,但密切关注在市场的宽幅震荡中存在的投资机会,关注从流动性推动、估值进入相对低点带来的股市反弹,关注去库存接近尾声、成本持续下降带来的实体经济盈利逐渐企稳,关注经济刺激计划背景下的产业机会、在经济转型过程中的行业内整合。我们也同样重视新能源、节能减排、基建、医药、农业等主题投资行情。

作为指数基金,本基金将紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化,并在此前提下适当提高组合的防御性和灵活性。我们将密切关注政策的动向以及各类数据的变化,充分利用上证180指数编制规则的优势,积极把握在中国经济振兴与转型中出现的投资机会。规范运作、勤勉尽责,认真努力地为广大投资者创造长期、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:

对于通过组合证券申购、赎回的上证180交易型开放式指数证券投资基金,暂执行原估值方法。

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:

不适用。

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:

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,12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,现任华安富利基金的基金经理、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核查的责任。

(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

基金当年未出现满足分红条件的情况,不进行收益分配。

§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、利润分配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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3托管人对本年度报告/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 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师薛竞、金毅签字出具了普华永道中天审字(2009)第20107号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1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:2008年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资产:		
银行存款	28,959,168.80	30,829,034.85
结算备付金	191,661.79	451,095.03
存出保证金	-	-
交易性金融资产	796,242,317.13	1,478,569,742.99
其中:股票投资	796,242,317.13	1,478,114,530.99
基金投资	-	-
债券投资	-	455,212.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	207,372.02
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	4,131,291.53	13,921,235.29
应收利息	6,013.80	9,293.75
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	829,530,453.05	1,523,987,773.93
负债和所有者权益	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
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	381,190.08	599,576.78
应付托管费	76,238.03	119,915.36
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	227,392.50	267,786.62
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	108,050.00	262,573.60
负债合计	792,870.61	1,249,852.36
所有者权益:		
实收基金	528,660,062.97	344,321,146.04
未分配利润	300,077,519.47	1,178,416,775.53
所有者权益合计	828,737,582.44	1,522,737,921.57
负债和所有者权益总计	829,530,453.05	1,523,987,773.93

注:报告截止日2008年12月31日,基金份额净值4.206元,基金份额总额197,022,674.00份。

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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

7.2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:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31日
一、收入	-1,200,413,710.56	624,502,402.76
1.利息收入	428,699.11	86,972.01
其中:存款利息收入	425,801.58	86,713.92
债券利息收入	2,897.53	258.09
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)	-547,650,537.93	482,417,854.71
其中:股票投资收益	-561,597,432.26	475,776,860.10
基金投资收益	-	-
债券投资收益	43,936.22	95,546.43
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	872,915.40	1,449,731.25
股利收益	13,030,042.71	5,095,716.93
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-654,044,142.41	141,794,886.64
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	852,270.67	202,689.40
二、费用(以"-"号填列)	-9,624,189.17	-7,864,198.90
1.管理人报酬	-6,005,609.56	-4,303,370.15
2.托管费	-1,201,121.98	-860,674.05
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	-2,016,575.63	-2,329,672.20
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	-400,882.00	- 370,482.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-1,210,037,899.73	616,638,203.86
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-1,210,037,899.73	616,638,203.86

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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

7.3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:2008年1月1日至2008年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12月31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)	-	-1,210,037,899.73	-1,210,037,899.73
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)	184,338,916.93	331,698,643.67	516,037,560.60
其中:1.基金申购款	985,287,486.00	1,385,820,235.63	2,371,107,721.63
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-800,948,569.07	-1,054,121,591.96	-1,855,070,161.03
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)	528,660,062.97	300,077,519.47	828,737,582.44

项目	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12月31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)	222,770,157.11	177,057,099.33	399,827,256.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	616,638,203.86	616,638,203.86
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)	121,550,988.93	384,721,472.34	506,272,461.27
其中:1.基金申购款	422,611,054.03	1,117,633,520.25	1,540,244,574.28
2.基金赎回款	-301,060,065.10	-732,912,047.91	-1,033,972,113.01
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)	344,321,146.04	1,178,416,775.53	1,522,737,921.57

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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

7.4报表附注

7.4.1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。

7.4.2关联方关系

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
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.3本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1股票交易

本报告期通过关联人交易单元的股票成交量:无。

上年度通过关联人交易单元的股票成交量:无。

7.4.3.1.2权证交易

本报告期通过关联人交易单元的权证成交量:无。

上年度通过关联人交易单元的权证成交量:无。

7.4.3.1.3应支付关联方的佣金

本报告期应支付关联方的佣金:无。

上年度应支付关联方的佣金:无。

7.4.3.2关联方报酬

7.4.3.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期(2008年1月1日至2008年12月31日)	上年度可比期间(2007年1月1日至2007年12月31日)
当期应支付的管理费	6,005,609.56	4,303,370.15
其中:当期已支付	5,624,419.48	3,703,793.37
期末未支付	381,190.08	599,576.78

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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期(2008年1月1日至2008年12月31日)	上年度可比期间(2007年1月1日至2007年12月31日)
当期应支付的托管费	1,201,121.98	860,674.05
其中:当期已支付	1,124,883.95	740,758.69
期末未支付	76,238.03	119,915.36

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。

7.4.3.3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。

上年度与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易:无。

7.4.3.4各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1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。

上年度基金管理人运用固有资金投资本基金的情况:无。

7.4.3.4.2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。

上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况:无。

7.4.3.5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(2008年1月1日至2008年12月31日)		上年度可比期间(2007年1月1日至2007年12月31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	28,959,168.80	418,951.71	30,829,034.85	82,103.00

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2008年12月31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(2007年12月31日;同)。

7.4.3.6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。

7.4.4期末(2008年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1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2008年12月31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。

7.4.4.2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
600900	长江电力	2008年5月8日	公告重大事项	14.35	未知	未知	2,301,388.00	34,736,316.64	33,024,917.80
600886	国投电力	2008年12月9日	公告重大事项	9.13	2009年3月4日	10.04	304,309.00	2,705,253.51	2,778,341.17
601918	国投新集	2008年12月9日	公告重大事项	7.55	2009年2月27日	8.31	138,000.00	991,357.94	1,041,900.00

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末2008年12月31日止,本基金无正回购余额。

§8 投资组合报告

8.1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	796,242,317.13	95.99
	其中:股票	796,242,317.13	95.99
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	29,150,830.59	3.51
6	其他资产	4,137,305.33	0.50
7	合计	829,530,453.05	100.00

8.2期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,854,168.57	0.71
B	采掘业	90,767,141.30	10.95
C	制造业	154,559,398.16	18.65
C0	食品、饮料	30,027,134.02	3.62
C1	纺织、服装、皮毛	7,256,679.03	0.88
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	641,451.00	0.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	9,037,772.97	1.09
C5	电子	3,459,188.20	0.42
C6	金属、非金属	49,806,025.02	6.01
C7	机械、设备、仪表	36,616,847.48	4.42
C8	医药、生物制品	14,432,433.16	1.74
C99	其他制造业	3,281,867.28	0.40
D	电力、煤气及水的生产和供应业	68,261,164.85	8.24
E	建筑业	16,462,875.41	1.99
F	交通运输、仓储业	61,510,681.46	7.42
G	信息技术业	29,094,027.92	3.51
H	批发和零售贸易	19,241,705.60	2.32
I	金融、保险业	280,652,328.86	33.87
J	房地产业	29,610,478.64	3.57
K	社会服务业	8,542,914.25	1.03
L	传播与文化产业	2,758,135.64	0.33
M	综合类	21,122,496.47	2.55
	合计	788,437,517.13	95.14

8.2.2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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	576,000.00	0.07
C	制造业	-	-
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	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,228,800.00	0.87
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
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	7,804,800.00	0.94

8.3期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的积极投资、指数投资前五名股票投资明细

8.3.1积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601186	中国铁建	720,000	7,228,800.00	0.87
2	601899	紫金矿业	120,000	576,000.00	0.07
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

注:投资者欲了解本报告期末基金积极投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.huaan.com.cn网站的年度报告正文

8.3.2指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	3,899,123	47,413,335.68	5.72
2	600030	中信证券	2,329,080	41,853,567.60	5.05
3	600900	长江电力	2,301,388	33,024,917.80	3.98
4	601318	中国平安	1,233,437	32,797,089.83	3.96
5	600000	浦发银行	2,127,466	28,188,924.50	3.40

注:投资者欲了解本报告期末基金指数投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.huaan.com.cn网站的年度报告正文

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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	601088	中国神华	41,648,636.07	2.74
2	600036	招商银行	27,895,180.36	1.83
3	601318	中国平安	27,596,917.20	1.81
4	601166	兴业银行	22,302,730.55	1.46
5	601390	中国中铁	11,489,388.57	0.75
6	601601	中国太保	10,796,632.00	0.71
7	601919	中国远洋	10,262,745.03	0.67
8	601006	大秦铁路	7,625,029.37	0.50
9	601808	中海油服	7,596,404.47	0.50
10	600030	中信证券	7,195,021.16	0.47
11	601398	工商银行	7,082,260.91	0.47
12	601186	中国铁建	6,934,999.00	0.46
13	601169	北京银行	6,530,626.00	0.43
14	601857	中国石油	5,291,913.34	0.35
15	600585	海螺水泥	5,167,790.38