\$1 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 行言数处子和不则及先辈表征。 和完整地走担外别及连带责任。 基金产管之金融作员始有增处。司根据本基金合同规定,于2010年1月18日复核了本报告中的财务指标。净值表现 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,勤勉灵始的规则管理和运用基金数产。但不保证基金一定盈利。基金的现象。 基金的过程业设计不代表其来来表现。投资者在中出投资改集的运行细阅读本基金的招募说明书。

资目标 资策略 - 112日 天平。 吳宇市收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定,具有良好分红能力 收益高于市场平均水平,预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。

3.1 主要财务指标 826,555,892.62

§3 主要财务指标和基金净值表现

91.4.66.3KU1890字值 1.3934 所述基金业债指标不包括特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 押投资费,基金转换费等),计人费用后3本或这水平要低于所列数字。 即已实现收益抗基金率期间起处,投资收益,其他收入 怀含公允价值变动收益 加除相关费用后的余额,本期 明己实现此益加上本期公允价值变动收益。

### 安顺证券投资基金

### 四季度报告

姓名	职务	任本基金的基	金经理期限	证券从	说明
XEAD	H/\75	任职日期	离任日期	业年限	19093
尚志民	本基金的 基金经 理,基金 投资部总 经理	2003-9-18	-	12年	□ 府管理硕士、12 年证券 基金从业经验。曾在上 前证券段研究所、上海证火投管理有限公司工 性,进人华安基金管理有限公司后曾先后担任公 可研究发展部高级研究员、1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理、2000 年 7 月至 2001 年 9 月間时担任安瑞证券投资基金的基金经理、2001 全 9 招任任安城证券投资基金处理,2003 年 9 月担 任 安位钢新证券投资基金的基金经理,2005 年 9 月起同时 即任本基金的基金经理、2006 年 9 月起同时 即任年安安本股票型工厂等及货基金的基金经理
陆从珍	本基金的 基金经理 助理	2009-5-16	-	9年	经济学硕士,9年证券,基金行业从业经历,历任 油市工商周职员,京华山一班多上海公司高级 研究员,中企东方资产管理公司高级研究员,东方 证券研究部资深研究员等限,2008年3月加入200 年5月16日起担任本基金和华安宏利股票型证 教投资基金的基金经期加票。

84 管理人报告

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

4.4.2 报告期内基金的业绩表现 载至 2009 年 12 月 31 日,本基金份额争值为 1.9394 元,本报告期份额净值增长率为 16.56%,同期上证综指上涨 116. 邓明始相 F 端 72 25%。

1%	,7米月100/1日	_EBK 22.25% o	资组合报告	
5.1	报告期末	基金资产组合情况 §5 投资	<b>页组百报百</b>	
	序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 %)
	1	权益投资	4,569,540,010.46	78.28
		其中:股票	4,569,540,010.46	78.28
Ì	2	固定收益投资	1,172,621,318.40	20.09
Ì		其中:债券	1,172,621,318.40	20.09
1		38e nhr - Lu Adis 2 on AM		

H							
3	金融位	5生品	投资			-	-
4	买人退	医售金	融资产			-	_
	其中:	买断云	(回购的买人返售	金融资产		-	-
5	银行有	F款和	结算备付金合计			41,985,812.96	0.72
6	其他资	产				53,407,875.22	0.91
7	合计					5,837,555,017.04	100.00
2 报告期	用末按行业	分类(	的股票投资组合				
H	门		行业类别			公允价值 (元)	占基金资产净值比例 %)
	A		木、牧、渔业			63,117,713.10	1.08
	В	采掘				342,829,432.00	5.89
	C	制造				1,804,672,267.02	31.02
(	CO		、饮料			415,227,092.00	7.14
(	C1	纺织	、服装、皮毛			-	-
(	C2	木材	、家具			-	-
(	C3	-	、印刷			179,195,498.58	3.08
(	C4	石油	、化学、塑胶、塑料			60,966,875.55	1.05
(	C5	电子				60,118,921.00	1.03
(	C6	金属	、非金属			167,570,578.20	2.88
(	C7	机械	、设备、仪表			626,740,625.86	10.77
(	C8	医药	、生物制品			294,852,675.83	5.07
C	299	其他	制造业			-	-
	D	电力	、煤气及水的生产	和供应业		-	-
	E	建筑	业			231,406,520.00	3.98
	F	交通	运输、仓储业			244,500.00	0.00
	G	信息	技术业			179,331,978.24	3.08
	Н	批发	和零售贸易			108,974,057.11	1.87
	I	金融	、保险业			1,096,892,386.00	18.85
	J	房地	远水			340,396,922.64	5.85
	K	社会	服务业			156,399,546.31	2.69
	L		与文化产业			53,858,061.04	0.93
	M	综合	类			191,416,627.00	3.29
		合计				4,569,540,010.46	78.54
3 报告期 序号	財末按公允 股票代					1十名股票投资明细	占基金资产净值比例 %)
1	60019		股票名称 复星医药	数量 化		公允价值 元 ) 293,548,219.13	白垄亚页广净阻比例 % )
2	60015		贵州茅台	1,599		271,542,180.00	4.67
3	60023		云南城投	10,500		239,295,000.00	4.07
4	600023		招商银行	13,199		238,258,195.00	4.10
5	60116		兴业银行	5,900		237,829,000.00	4.09
6	60131		中国平安	4,199		231,372,491.00	3.98
7	60166		中国建筑	48,990		231,232,800.00	3.97
8	60139	98	工商银行	40,000	,000	217,600,000.00	3.74

序号	债券	品种	公允价	値 (元)	占基金资产净值比例 66)
1	国家债券			176,029,118.40	3.03
2	央行票据			763,747,000.00	13.13
3	金融债券		:	232,845,200.00	4.00
	其中:政策性金	:融债	:	232,845,200.00	4.00
4	企业债券			-	-
5	企业短期融资	斧		-	-
6	可转债			-	-
7	其他			-	-
8	合计		- ,	172,621,318.40	20.15
	末按公允价值占基			T-1104 77 17 24 77 1711	To the Annual Control of the Annual Control
序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 ‰)
1	0901042	09央票 42	1,400,000	137,564,000.0	2.36
2	0901036	09央票 36	1,200,000	117,948,000.0	2.03
3	0801050	08央票 50	1,000,000	102,930,000.0	1.77
4	0801044	08央票 44	1,000,000	102,880,000.0	1.77
5	070401	07农发 01	700,000	70,049,000.0	1.20
基金本报 报告期 基金本报 投资组合	告期末未持有资 末按公允价值占基 告期末未持有权i 合报告附注	产支持证券。 法金资产净值比 E。	例大小排名的前	十名资产支持证券 五名权证投资明细 5.在被监管部门立场	

其他资产	产构成	
序号	名称	金额 (元 )
1	存出保证金	1,921,236.66
2	应收证券清算款	33,232,767.23
3	应收股利	-
4	应收利息	18,253,871.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,407,875.22

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明纸 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券 5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的该

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允 价值 (元)	占基金资产净 值比例 %)	流通受限情况说明
1	600239	云南城投	239,295,000.00	4.11	非公开发行股票未上市
		§6 基金管	·理人运用固有资金投资	本封闭式基金情况	<b>况</b> 单位: 份
报告期期	初管理人持有	[的封闭式基金	份额		11,633,800
报告期期	间买人总份额	ĺ			-
报告期期	间卖出总份额	į			-
报告期期	末管理人持有	[的封闭式基金	份额		11,633,800
报告期期	末持有的封闭	式基金份额占	基金总份额比例 %)		0.39
名杏立作	±0.00		§7 备查文件目	录	

72. 存取地点 基金管理人用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。 73. 查询方式 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 金托管人均办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司 二〇一〇年一月二十一日

## 华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

### 2009 第四季度报告

2009年 12 月 31 日

报宵这出日期:二〇一〇年一月二十一日 \$1 重要提示 法会管理人的意味会及董事保证本权告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述成重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及任告责任。 据金托官人中国工商银行设仿有限公司根据本基金合同规定,于2010年,月15日复核了本报告中的财务指标、净值规理和投资组合保营等内容、保证复据内存不存在虚假记载、误导性陈述成者重大遗漏。基金管积大规划。提供有18.则是分别的规管理相应引播金资产。但不保证基金。定盈利,基金的过程金研书不代表基本来表现。投资有规则,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。本报告中财务资料未签证计

基金简称	华安中国 A 股增强指数
基金主代码	040002
前端基金主代码	040002
后端基金主代码	041002
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
报告期末基金份额总额	5,991,712,872.20 份
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 MSCI 中国 A 股指 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, 增值的基础上,排机实现一定的收益和分配。
投资策略	4 內产配置。本基金投資干燥票的目标让例少基金资产等值的 95%。本基金前中国证券市场缺少规则的定,其的情况下。可以根据开放工基金运作的实规和时形的实际情况。适当调整基金资产分配比例。 2 股票投资。本基金以MGC中国 A股情效处形核成及其权重等指标必须必至规则或的股份的成分形成成及其权重等指标必须还是规则的股份的成分形成成分形成成分积极的实现分,是不是一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一
业绩比较基准	95% ×MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5%×金融同业存款利率
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 回报,属于中等风险、中等收益的投资产品。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

.本期已实现收益 255,426,717.28

1.014T
4.期末基金资产净值
5.733.841.768.20
5.期末基金份额净值
5.733.841.768.20
5.则未基金份额净值
5.935.841.768.20
9.957
注:1.所还基金业额指称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,开放式基金的申购费、红和用父亲收益指基金本职利息收入,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, 本期和为本期中显现收益加上本明公允价值变动收益,其他收入 (不含公允价值变动收益 ) 加除相关费用后的余额, 本期和为本期中显现收益加上本明公允价值变动收益,其他收入 (不含公允价值变动收益 ) 加除相关费用后的余额, 本期3.3人 本报告期基金价额净值增长率及其4与间期业债比较基准收益率的比较

3.2.1 本报告期基金	份额净值增长	、率及其与同期	业绩比较基准收益	5率的比较		
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
过去三个月	16.99%	1.61%	18.18%	1.65%	-1.19%	-0.04%
3.2.2 自基金合同生	pro- tri telegrami su	华安 MSCI 中国 頻净值增长率与	大率变动及其与同 A股指数增强型i p业绩比较基准收; B 日至 2009 年 1	E券投资基金 益率历史走势对比图		较

§4	管理人报告

4.	1 基金经	理 (成基金	经理小组 )简:	↑ 8°	1 日理ノ	<b>大</b> 报百
	姓名	职务	任本基金的基	<b>š</b> 金经理期限	证券从	说明
	XEAS	H/\55	任职日期	离任日期	业年限	10097
	许之彦	本基金的 基金经 理、金融 工程部负 责人	2008-4-25	-	6年	理学博士,6年证券,基金从业综验。CQF 個际数 議金融工程制,9曾在"发业等中山上学等公标中山 第金融工程制"的曾在"发业等中山上学等公司" 理学院博士后流边站从事金融工程工作。2005 年 加入华安基金管理有限公司。9年研究发展设 量第6分析师。2008 年 4 月起担任本基金的基金 经理、2009 年 9 月起間时担任上证 18 0 交易开 放式指数证券投资基金及年安上证 180ETF 联接 基金的基金经产品
	刘璎	本基金的 基金经理	2008-4-25	-	8年	管理學領土 8 年证券从业经历、管在交通银行工作、2001年的人华安基金管理有限公司,历任市场部高级投资项间。专户理财部客户主管、上证 180 交易型开放大清整证券投资基金是理助理。2007年3 月起闰任上证:180 交易型开放大清整证券投资基金的基金差理。2008年4月起同时担任本基金的基金差距。2008年4月起同时担任本基金的基金差距。2008年
	牛勇	本基金的 基金经理 助理	2009-7-3	_	5年	复旦大学经济学硕士, FRM 俭融风险管理师),5 年证券金融从业经历,曾在季康人寿保险股份有 限公司从事时死工作。2008 年 5 月加入华安基金 管理有限公司后任金融工程部高级金融工程师, 2009 年 7 月起担任本基金的基金经理助理。

本报告期內學安中国 A 股增强指数基金份额争值增长率为 16.99%, 同期业绩比较基准增长率为 18.18%, 基金净值表现落比较基准 1.19%, 截至 2009 年 12 月 31 日, 本基金过去 30 个交易日日均限緊偏腐度为 0.10% 較照基金合同和招募说明书规定 )。

序号	项目	金額 (元)	占基金总资产的比例 66)
1	权益投资	5,423,216,952.13	93.9
	其中:股票	5,423,216,952.13	93.9
2	固定收益投资	98,340,000.00	1.70
	其中:债券	98,340,000.00	1.70
	资产支持证券	-	
3	金融衍生品投资	-	
4	买人返售金融资产	-	
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	
5	银行存款和结算备付金合计	222,446,775.60	3.85
6	其他资产	27,370,579.76	0.47
7	合计	5,771,374,307.49	100.00

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	-	
В	采掘业	_	_
C	制造业	31,135.00	0.00
CO	食品、饮料	16,640.00	0.00
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	14,495.00	0.00
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	-	
F	交通运输、仓储业	-	
G	信息技术业	-	
Н	批发和零售贸易	-	
I	金融、保险业	-	
J	房地产业	-	
K	社会服务业	76,020.00	0.00
L	传播与文化产业	-	
M	综合类	- 108 155 00	-
2 458647139042	合计 行业分类的股票投资组合	107,155.00	0.00
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	27,086,442.25	
		.,,	
В	采掘业	512,253,844.78	8.93
B C	采掘业 制造业	512,253,844.78 1,964,742,164.40	8.93
C CO	采掘业 制造业 食品、饮料	512,253,844.78 1,964,742,164.40 231,180,384.77	8.93 34.27 4.03
B C C0	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、皮毛	512,253,844.78 1,964,742,164.40	8.93 34.27 4.03
B C C0 C1 C2	采	512,253,844.78 1.964.742.164.40 231,180,384.77 46.197.939.20	8.93 34.27 4.03 0.81
B C C0 C1 C2 C3	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、皮毛 木材、穿具 造纸、印刷	512,253,844.78 1.964.742.164.40 231,180,384.77 46.197.939.20 - 36.789.437.60	8.93 34.27 4.03 0.81 - 0.64
B C C0 C1 C2 C3	采烟业制造业 信品、饮料 幼织、服装、改毛 木材、家具 通纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料	512, 253, 844,78 1,964,742,164,40 231,180,384,77 46,197,939,20 - 36,789,437,60 147,234,295,01	8.93 34.27 4.03 0.81 - 0.64 2.57
B C C0 C1 C2 C3	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、皮毛 木材、穿具 造纸、印刷	512,253,844.78 1.964.742.164.40 231,180,384.77 46.197.939.20 - 36.789.437.60	8.93 34.27 4.03 0.81 - 0.64 2.57
B C CO C	采掘业 制造业 食品、饮料 纺纸、服装、皮毛 木材、家具 通纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属	512, 253, 844,78 1,964,742,164,40 231,180,384,77 46,197,939,20 - 36,789,437,60 147,234,295,01	8.93 34.22 4.03 0.81 
B C C0 C1 C2 C3 C4 C5	采揮业 制造业 食品、饮料 纺织 服裝, 皮毛 木材、家具 造纸、印刷 由. 化学、塑胶、塑料 电子	512, 253, 844.78 1.964.742.164.40 231, 180, 384.77 46.197.939.20 36.789.437.60 147, 234, 295.01 26.566.332.32	8.93 34.22 4.03 0.81 
B C CO C	采掘业 制造业 食品、饮料 纺纸、服装、皮毛 木材、家具 通纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属	512, 253, 844.78 1.964.742.164.40 231,180,384.77 46.197.939.20	8,93 34,27 4,03 0,81 0,046 2,57 0,46 8,20 12,97
B C CO C1 C2 C3 C4 C5 C6 C7	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、皮毛 木材、家具 五油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅表	512, 253, 844.78 1.964.742.164.40 231, 180, 384.77 46.197, 939.20 36.789.437.60 147, 234, 295.01 26.566.332.32 460, 988, 224.29 743.435.262.91	8.93 34.27 4.03 0.81 - 0.64 2.575 0.46 8.20 12.979 4.17
B C CO CO C1 C2 C3 C4 C5 C6 C7 C8	采揮业 制造业 食品、饮料 妨积,服装,皮毛 木材、家具 造纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅表 医药、生物制品	512, 253, 844.78 1.964, 742, 164.40 231, 180, 384.77 46, 197, 939, 20 36, 789, 437, 60 147, 234, 295, 01 26, 566, 332, 32 469, 988, 224, 29 743, 435, 262, 91 238, 888, 993, 12	8.93 34.27 4.03 0.81 0.64 2.25 0.46 8.20 12.97 4.17
B C C CO C1 C2 C3 C4 C5 C6 C7 C8 C99	采掘业 制造业 食品、饮料 贫好、服装、故毛 木材、家具 适纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅要 医属、生物制品 式他用的企业	512, 253, 844,78 1.964,742,164,40 231,180,384,77 46,197,939,20	8.93 34.27 4.03 0.81 0.646 2.57 0.46 8.2020 12.97 4.17 0.433 3.04
B C C CO C1 C2 C3 C4 C5 C6 C7 C8 C99 D	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、皮毛 木材、家具 造纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仪表 医药、生物制品 其化制度业 电力、煤气及水的生产和供应业	512, 253, 844.78 1.964.742.164.40 231,180,384.77 46.197.939.20 36.789.437.60 147, 234, 295.01 26.566.332.32 469.988.224.29 743.435.262.91 238,888.993.12 24.461.295.18	8.93 34.27 4.03 0.818 0.64 2.57 0.40 8.20 12.97 4.17 0.43 3.040
B C CD C1 C2 C3 C4 C5 C6 C7 C8 C99 D	采捆业 制造业 食品、饮料 贫品、限量、皮毛 木材、家具 造纸、印题 石油、化学、塑胶、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅表 医类 其他制造业 电力、统一及水的生产和供应业 建筑业	512, 253, 844.78 1.964, 742, 164.40 231, 180, 384, 77 46, 197, 939, 20 36, 789, 437, 60 147, 234, 295, 01 26, 566, 332, 23, 24 469, 988, 224, 29 743, 435, 262, 91 238, 888, 993, 12 24, 461, 295, 18 174, 142, 095, 21 165, 384, 220, 44	8.93 34.27 4.03 0.81 0.646 8.202 12.97 4.17 0.43 3.04 2.88 4.696
B C C0 C1 C2 C3 C4 C5 C6 C7 C8 C99 D E	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、故毛 木材、家具 通纸、印刷 石油、化学、即放、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅表 医药、生物制品 其他制造业 电力、煤气及水的生产和供应业 建筑业 交通或输、仓储业	512, 253, 844,78  1.964,742,164,40  231,180,384,77  46,197,939,20  36,789,437,60  147,234,295,01  26,566,332,32  469,988,224,29  743,435,262,29  238,888,93,12  24,461,295,18  174,142,095,21  165,384,220,44  269,141,165,40	8.93 34.27 4.03 0.81 0.646 2.57 0.46 8.2020 12.97 4.17 0.434 3.04 2.88 4.4690
B C C C C C C C C C C C C C C C C C C C	采掘业 制造业 食品、饮料 纺织、服装、皮毛 木材、家具 造纸、印刷 石油、化学、塑胶、塑料 电子 电子 电子 电子,使数、型料 电力、煤化及表 医药、生物制品 其化制造业 电力、煤化及水的生产和供应业 建筑业 位流或。仓储业 信息技术业	512, 253, 844.78 1.964.742.164.40 231.180,384.77 46.197.939.20 36.789.437.60 147, 234, 295.01 26.566.332.32 469.988.224.29 743.435.262.91 238,888,993.12 24.461.295.18 174.142.095.21 165,384,220.44 269.141.165,400 229,495,411.19	8.93 34.27 4.03 0.81
B C C CO	采掘业 制造业 有品 饮料 有品 饮料 有品 饮料 原裝 成毛 大材 深具 拉纸 印刷 石油 化学、塑胶、塑料 电子 金属 非金属 机械、设备、仅表 医药、生物制品 法他制造业 电力 域气及水的生产和供应业 建筑业 交通运输,仓储业 信息技术业 批发和零售贸易金融 保险业	512, 253, 844,78  1.964,742,164,40 231,180,384,77 46,197,939,20 36,789,437,60 147,234,295,01 26,566,332,32 469,988,224,29 243,435,262,29 243,461,295,18 174,142,095,21 165,384,220,44 269,141,165,40 229,495,411,19 221,222,010,33 1,308,126,751,96	8.93 34.27 4.03 0.81
B C C C C C C C C C C C C C C C C C C C	采掘业 制度型	512, 253, 844.78 1.964.742.164.40 231,180,384.77 46.197.939.20 36.789.437.60 147, 234, 295.01 26.566.332.32 469.988.224.295.01 238,888,993.12 24.461,295.18 174.142.095.21 165,384,220.44 269.141.165,40 229.495,411.19 221,222.001.33 1,308,126,751.96 333.459,399.95	8.93 34.27 4.03 0.81
B C C C C C C C C C C C C C C C C C C C	采捆业 制造业 有品、饮料 价品、饮料 价品、饮料 价品、饮料 价品、规划、皮毛 木材、家具 面纸、印刷 可由,化学、塑取、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅要 医动脉、进敏、电力、减一及水的生产和供应业 建筑业 交通运输。全储业 信息技术业 批发和零售贸易 金融、保险业 防护企业 社会服务业	512, 253, 844,78  1.964,742,164,40  231,180,384,77  46,197,939,20  36,789,437,6  147,234,295,01  245,868,931,22  244,461,295,18  174,142,095,21  258,888,993,12  24,461,295,18  174,142,095,21  259,495,411,19  221,282,483,133,133,133,133,133,133,133,133,135,133,133	8.93 34.27 4.03 0.81
B C C C C C C C C C C C C C C C C C C C	采掘业 制造业  食品、饮料  纺织、服装、皮毛 木材、溶具  适纸、印刷  石油、化学、塑胶、塑料  电子  起系、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、电影、	512, 253, 844,78  1.964,742,164,40  231,180,384,77  46,197,939,20  36,789,437,60  147,234,295,01  26,566,332,32,40  469,988,224,29  743,435,262,91  238,888,93,12  24,461,295,18  174,142,095,21  165,384,220,44  269,141,165,40  229,495,411,19  211,222,001,33  1,308,126,751,96  343,459,399,95  65,791,175,40  21,171,069,56	8.93 34.27 4.03 0.81
B C C C C C C C C C C C C C C C C C C C	采捆业 制造业 有品、饮料 价品、饮料 价品、饮料 价品、饮料 价品、规划、皮毛 木材、家具 面纸、印刷 可由,化学、塑取、塑料 电子 金属、非金属 机械、设备、仅要 医动脉、进敏、电力、减一及水的生产和供应业 建筑业 交通运输。全储业 信息技术业 批发和零售贸易 金融、保险业 防护企业 社会服务业	512, 253, 844,78  1.964,742,164,40  231,180,384,77  46,197,939,20  36,789,437,6  147,234,295,01  245,868,931,22  244,461,295,18  174,142,095,21  258,888,993,12  24,461,295,18  174,142,095,21  259,495,411,19  221,282,483,133,133,133,133,133,133,133,133,135,133,133	8.93 34.27 4.03 0.81

	(1×4×76)/1   ELL   46							
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	601117	中国化学		14,000		76,020.00		0.00
2	300037	新宙邦		500		14,495.00		0.00
3	002329	皇氏乳业		50	00	10,050.00		0.00
4	002330	得利斯		50	00	6,59	0.00	0.00
2 指数投资	接公允价值占基	金资产净值比例	大小	排序的盲	íí –	-名股票投资明	SHI .	
序号	股票代码	股票名称		量(股)	Ī			占基金资产净值比例 %)
1	600036	招商银行	10	,420,35	3	188,087,371.	65	3.28
2	601318	中国平安	3	3,353,40	00	184,738,806.	00	3.22
3	600030	中信证券	4,629,312			147,073,242.	24	2.57
4	600000	浦发银行	5,865,237			127,216,990.	53	2.22
5	601328	交通银行	12,524,544		14	117,104,486.40		2.04
6	600519	贵州茅台	673,977			114,454,774.14		2.00
7	601166	兴业银行	2	2,683,14	17	108,157,655.57		1.89
8	600016	民生银行	12	2,365,62	7	97,812,109.57		1.71
9	000002	万科A	7	,983,59	1	86,302,618.71		1.51
10	601088	中国神华	2	2,051,99	0	71,450,291.80		1.25
报告期末	按债券品种分类的	的债券投资组合						
序号		<b>券品种</b>		公	允	价值(元)	r.h	5基金资产净值比例 (%)
	国家债券					-		-
2	央行票据			98,340,000.00				1.72
	金融债券			-				_
	其中:政策性金融	h()		_				-
	企业债券		-				-	
-	企业短期融资券		-				-	
	可转债			-				-
	其他			-				-
8	合计					98,340,000.00		1.72
	按公允价值占基金	<b>应资产净值比例</b> ;	大小才	非名的前	£	名债券投资明纸	H	
序号 作	· 持	券名称 :	数量	(张)		公允价值 (元)	_	占基金资产净值比例 (%)

1 0901030 09块票30 1,000,000 98,340,000,000 財告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明基基金本报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细基金未按告期末未持令权证。 8. 投资组合报告附注 58.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的拨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在受到公开谴责,处罚的情况。 8.8.2 本准金投资前一名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

12,125,887.19 13,195,975.22 寺摊费用 27,370,579.76

1.3.2 1区ロ対1小内収1区区 利 ユイルスポート・エルル曲 スドバ 目 ULD 1 DU 7 1									
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公 允价值 (元 )	占基金资产净值 比例 %)	流通受限情况说明				
1	601117	中国化学	76,020.00	0.00	网上申购中签				
2	300037	新宙邦	14,495.00	0.00	网上申购中签				
3	002329	皇氏乳业	10,050.00	0.00	网上申购中签				
4	002330	得利斯	6,590.00	0.00	网上申购中签				
		§6	开放式基金份额变动		的分. A				

1,566,486,887.83 告期期间基金总赎回份**8** 告期期间基金拆分变动份额 (分额减少以""填列) 5,991,712,872.20 §7 备查文件目录

.2 存成电点 甚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。 7.3 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 453

# 华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

### 第四季度报告

2009年 12月 31日

3.1 主要财务指标

取西运项日期: 一〇一中一月一十一日 \$1 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、 船场归军8数地元和个别及海海市员 准确性和完整性承担个别及连带责任。 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 2010 年 1 月 18 日复核了本报告中的财务指标、 添值表现和设理合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人承诺立诚实信用,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。 基金的过程业龄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谈明书。 本报告中财务资料未经审计。 本报告明的 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。 82 基金产品概况

基金简称	华安上证 180ETF 联接				
基金主代码	040180				
基金运作方式	契约型开放式				
基金合同生效日	2009年 9 月 29 日				
报告期末基金份额总额	949,473,437.49 份				
投资目标	通过控制基金投资组合相对于标的指数的偏离度,实现对标的指数的有效跟踪 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	本基金主要通过投资干学安上证 180FF 以求比贵铝份货目标。当本基金申职票据 和宋美华安上证 180FF 政 基金自身的申职赎回本基金规则等标的指数的 果可能带来影响时,波南领则成份股发生则服务印成份股发生起限。增发,分红等行列,基金经现金对投资组合法产适当现路。陈规聚除发,本基金的本分种的指数的第二段 140年 140年 140年 140年 140年 140年 140年 140年				
业绩比较基准	95%×上证 180 指数收益率+5%×商业银行税后活期存款利率。				
风险收益特征	基金为华安上证 180ETF的联接基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其质险和预期收益均高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。				
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				
.1.1 目标基金产品概况					
基金名称	华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金				
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	2006-04-13				
基金份额上市的证券交易	上海证券交易所				
上市日期	2006-05-18				
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担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测整。但因转来错忍。例如应用关注眼解而无法买入标的数成份股等情况。P\$ 致无法获得成免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	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。				
基金管理人名称	华安基金管理有限公司				
基金托管人名称	中国建设银行股份有限公司				

报告期 2009年10月1日-2009年12月31日) 主要财务指标 128,819,859.7 3.加权平均基金份额本期利润 5.期末基金份额净值

单位:人民币元

1-Firit基金业绩指标不包括特有人认购成交易基金的各项费用,计人费用后实际收益水平要低于所列数字。 本期已实现收益指基金本期间现役人投资收益,其他收入、怀含公允价值变动收益,知除相关费用后的余额,本 均少事则全来现该盆加土率期公允价值变效收益。 3.2.1 本报告期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

2009年9月29日至2009年12月31日)

任: 本基金于2009年9月29日成立,截至报告期末本基金成立未满一年。 根据《存安上证180 交易现开族式指数证券投资基金联接基金基金合同)规定,本基金应自基金合同生效日起6个 月內健基金的投资组合比例符合基金合同第一二部分 C. 股党范围的有关规定。截至报告期末本基金基金合同生效未 满6个月,基金的投资组合比例尚末符合基金合同的有关规定。 84 管理人报告 4.1 基金经理 (成基金经理小组)简介

姓名 职务				证券从	说明				
处治	在职日期 富任日期 业年限		10099						
卢赤斌	本基金的基金经理	2009-9-29	2009-10-20	11年	商士学位、11 年率券从业65万,1998 年至 2004 年曾先后在美界任 管证券公司 仇告公司证券管理条件的股票基金管理器 工作、参与负债公司证券管理条件的股发和协助基金经理管理本 公司主要提票指数基金的运作。2004 年7 月加入华安基金管理程 股公司,在基金货票的成分是野水大街数准均换基金的现 发工作。2006 年4 月起担任学区上证 1800年 准金经理基金、2006 年9 月29 日运到中担任本基金管理				
许之彦	本基金的基金 经理金融工程 部负责人	2009-9-29	-	6年	理学博士。6年证券、基金从业经验、COF 包际政量金融工程师)。 曾在广波迎券和中山大学经济管理学院博士后成动坑从事金融工 程工作。2005年几个年级全营资讯报公司 曾任守发展课程 策略分析第、2008年 4 月起居任华安 MSCI 中国 A 最指数增强型 证券投资基金的基金经理。2009年 9 月起同时担任华安上证 180ETF 及本金的基金经理。2009年 9 月起同时担任华安上证				
章海默	本基金的基金经理助理	2009-12-26	-	6年	复旦大学管理学院工商管理硕士,复旦大学经济学学士,6 年基 金从业经历。管在安水华用会计师事务所工作。2003 年 9 月加入华 安基金管理有限公司,任基金运营部基金核算主管,2009 年 12 月 起担任本基金的基金经理助理。				

账户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 使易端公平交易管理办法,银行间业务 NJ 及 截金 帐户 )参与新股询价与申购业务管理 办法 对其选并规则,允许配及时,未出现异常情况。 4.32 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 本基金为上证 180FT 基金的银锭,其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前,华安旗下基金没有与 本基金风格相同的基金。

本基金风格相同的基金。 4.3. 异常交易行为的专项设用 本享度没有出现异常交易。 4.4 报告期内基金投资资策和运作分析 全期经济的平稳市上趋势明明化。使得市场在 2009 年四季度呈现了震荡上升的走势。本基金在基金成立初始即果 斯建仓、取得较好的效果。 2009 年下半年,国内经济已较快恢复增长,市场开始担心央行货币政策微调,以及经济增长的持续性,表现出宏观经济中各种因素存在相互对抗和制约。我们认为,短期内市场仍延续目前的震荡走势,并随着宏观经济内部的结构调

整、在實為中进行不同板块之间的轮动。同时,在美国经济复及确定性仍不明显。国内经济转型需要时间逐步开展的前提下,我们限期货币政策将根据实际情况进行灵活的数量化操作。但利率仍将建转转依块平。2010年,我们对国内经济增长并不担心。通常学年总体非特定可接受范围约、整体上对于市场相对乐观。国内经济正处在转破分关键部前,也速除他加工。特别投资和消费并重的内需的线。因此,元纪处经济增长的自身需求,还是从对原材料单位密度需求来看。资源以及原材料于进来来仍将维持权支撑气的状态。即时,由于支票民生等促进消费的长期联动版等。一出会,使特殊承承"格别路往散议重的原则,使得投资者得以充分分享后续经济增长所带水的收益。程2、2010年未来,12月31日,本基金份额净值为 1,123 元,本报告期份额净值增长来为 12.41%,同期业绩比较基准增长来为 16.44%。

序号			项目		金额 (元)			占基金总资产的比例 %)		
1	权益	<b>少</b> 资			1,003,931,239.82			93.33		
	其中:	:股票				1,003,931,23	9.82		93.33	
2	基金	<b>少</b> 资			1,771,000.00				0.16	
3	固定	收益投资			19,654,000.00				1.83	
	其中:	:债券				19,654,000.00			1.83	
	资产	支持证券					-		-	
4	金融	汀生品投资	ĈĘ.				-		-	
5	买人	<b>返售金融</b> 第	Epis E				-			
	其中:	:买断式回	购的买人返售	金融资产			-		-	
6	银行	存款和结算	\$备付金合计			41,589,46	5.11	3.8		
7	其他	各项资产			8,746,308.29		0.8			
8	合计				1,075,692,013.22		100.00			
.2 期末	投资目标。	甚金明细	1			1	_		books A Marchada	
序号	基金	名称	基金类型	运作方式		管理人		公允价值	占基金资产净 值比例 %)	
1	华安上证 易型开放 证券投资	式指数 基金	股票型	交易型开 式(ETF)	放	华安基金管 理有限公司		1,771,000.00	0.17	
		业分类的胜	2票投资组合							
f	<b>C码</b>		行业类别		- 1	公允价值 (元)		占基金资产	净值比例 %)	
	A	农、林、牧、渔业			5,719,741.00		_	0.5 12.9 18.1 2.4		
	В		采掘业			137,640,185.61				
	C	制造业 食品、饮料			193,952,235.32 25,942,267.23		-			
	CO						-			
	C1	纺织、服装、皮毛			6,160,840.00		0.5			
	C2	木材、家具			-					
	C3	造纸、印刷			-					
	C4	石油、化学、塑胶、塑料			15,436,194.58		1.4:			
	C5	电子			2,686,320.00		0.25			
	C6	金属、非金属			64,622,446.95		6.06			
	C7	机械、设备、仪表			58,396,030.56		-		5.48	
	C8	医药、生物制品 其他制造业			18,092,574.00		1.70			
(	299 D	× 1100-1111	<sup>到此</sup> 气及水的生产	En/H-ctz.lb	_	39,216,246	_	0.2		
	E	建筑业	· (X/A)的生产	THIPENER	_	, ., .	-	3.		
	F.	, , , , , , , , , ,			30,404,333.10		2.85			
		交通运输、仓储业					54,600,078.92			

L	L 传播与文化产业				2,480,412.00	0.23		
M	M 综合类					25,402,023.20	2.38	
合计					1,0	1,003,931,239.82		
报告期	末按公グ	心价值占基	金资产净值比例	大小排	序的前	十名股票投资明:	H	
序号	股系	票代码	股票名称	数量(段)		公允价值 (元)	占基金资产净值比例 %)	
1	600036 招商银行 2,90		02,915	52,397,615.	75 4.91			
2	60	601328 交通银行 4.6		4,6	54,100	43,515,835.	00 4.08	
3	60	1318	中国平安	70	06,646	38,929,128.	14 3.65	
4	60	600016 民生银行 4,7		96,300	37,938,733.	00 3.56		
5	60	0030	中信证券	1,1	53,500	36,646,695.	00 3.44	
6	60	1166	兴业银行	876,706		35,340,018.	86 3.31	
7	60	0000	浦发银行	1,334,400		28,943,136.	00 2.71	
8	60	1088	中国神华	824,331		28,703,205.	42 2.69	
9	60	1169	北京银行	1,219,444		23,584,046.	96 2.21	
10	60	1398	工商银行	4,200,000		22,848,000.	00 2.14	
报告期	末按债券	华品种分类	色的债券投资组合	ì				
robe tot		7:1	S MA ITI ELL		43	1-10 th C-1	Totality A. Marisha Mr. Alex L. 1991, Apr. 3	

26,511,662.6

47,453,849.3

4.45

序号	债	券品种	公允价值 (元 )	1	占基金资产	净值比例 %)
1	国家债券			-		
2	央行票据		19,654,0		1.8	
3	金融债券					
	其中:政策性金融	协债		-		
4	企业债券			-		
5	企业短期融资券			-		
6	可转债			-		
7	其他			-		
8	合计		19,654,000.00			
6 报告期2	卡按公允价值占基	金资产净值比例大小	非名的前五名债券投	资明组	H	
序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	2	允价值 (元)	占基金资产》(信比例 66.)

1 0901040 09央票 40 200.000 19.654.000.00 5.7 报告期未按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资用细 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券1 本基金本报告期末未持有资产支持证券。 5.8 报告期末状分公价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 按(强任管按告附注。 5.9.1 本指告期内,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存在受到公开谴责,处罚的情况。

序号	名称	金額 (元)
1	存出保证金	
2	应收证券清算款	4,693,041.
3	应收股利	
4	应收利息	123,753.
5	应收申购款	3,929,513.
6	其他应收款	
7	待摊费用	
8	其他	
0	V7T	9 746 209

9 合计 5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券间期 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 本基金本报告期末前十名股票中不存在途通受限情况。

《6 开放式基金份额要动	
	单位:份
报告期期初基金份额总额	1,124,533,978.56
报告期期间基金总申购份额	647,623,563.46
报告期期间基金总赎回份额	822,684,104.53
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以""填列)	_
报告期期末基金份额总额	949.473.437.49

87 各杏文件目录 7.1 备查文件目录 1. 《华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联卷基金基金合同》 2. 《华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联卷基金程泵设用书》 3. 《华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招管协议》

FUX电点 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

7.3 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 作品 华安基金管理有限公司 二〇一〇年一月二十一日