

**华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2012 年半年度报告**  
**2012 年 6 月 30 日**

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

报告送出日期：二〇一二年八月二十七日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
3	主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
4	管理人报告.....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1	资产负债表.....	14
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	34
7.1	期末基金资产组合情况.....	34
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	35
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	36
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	42
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	42
7.8	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.....	43
7.9	投资组合报告附注.....	43
8	基金份额持有人信息.....	43
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
9	开放式基金份额变动.....	45

10	重大事件揭示.....	45
10.1	基金份额持有人大会决议.....	45
10.2	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.....	45
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4	基金投资策略的改变.....	46
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	46
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8	其他重大事件.....	47
11	影响投资者决策的其他重要信息.....	48
12	备查文件目录.....	48
12.1	备查文件目录.....	48
12.2	存放地点.....	48
12.3	查阅方式.....	49

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安上证180交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证180ETF
基金主代码	510180
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
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
报告期末基金份额总额	17,747,226,740.00份
基金合同存续期	不定期
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	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.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833
注册地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		李劼	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

本期已实现收益	-106,209,092.45
本期利润	654,878,471.20
加权平均基金份额本期利润	0.0359
本期加权平均净值利润率	6.53%
本期基金份额净值增长率	6.55%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
期末可供分配利润	4,315,377,035.14
期末可供分配基金份额利润	0.2432
期末基金资产净值	9,531,469,216.89
期末基金份额净值	0.537
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	107.78%

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）。

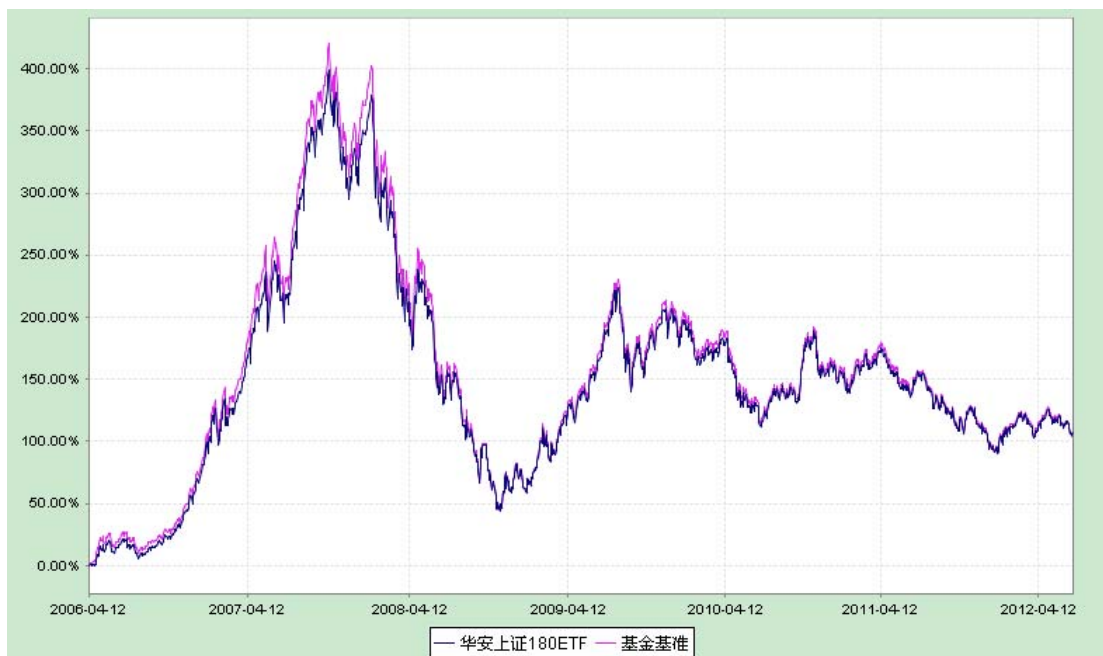
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	-5.29%	1.10%	-6.25%	1.10%	0.96%	0.00%
过去三个月	1.70%	1.09%	0.33%	1.10%	1.37%	-0.01%
过去六个月	6.55%	1.28%	5.40%	1.28%	1.15%	0.00%
过去一年	-16.61%	1.33%	-17.60%	1.33%	0.99%	0.00%
过去三年	-23.72%	1.55%	-25.36%	1.56%	1.64%	-0.01%
自基金合同生效起至今	107.78%	2.00%	106.90%	2.04%	0.88%	-0.04%

#### 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  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2006 年 4 月 13 日至 2012 年 6 月 30 日)



## 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国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2012 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300



指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级等 29 只开放式基金，管理资产规模达到 854.82 亿人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
许之彦	本基金的基金经理	2009-09-05	-	8 年	理学博士，8 年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。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，2008 年 4 月起担任华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任本基金及华安上证 180ETF 联接基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。
牛勇	本基金的	2010-06-18	-	7 年	复旦大学经济学硕

	<p>基金经理</p>			<p>士，FRM（金融风险 管理师），7 年证券金 融从业经历，曾在泰 康人寿保险股份有 限公司从事研究工 作。2008 年 5 月加入 华安基金管理有限 公司后任风险管理 与金融工程部高级 金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任华安中国 A 股 增强指数基金的基 金经理助理，2010 年 6 月起同时担任本 基金的基金经理。 2010 年 9 月起同时 担任华安 A 股增强指 数基金的基金经理。 2010 年 11 月起担任 华安上证龙头企业 交易型开放式指数 证券投资基金和华 安上证龙头企业交 易型开放式指数证 券投资基金联接基 金的基金经理。2012 年 6 月起同时担任华 安沪深 300 指数分级 证券投资基金的基 金经理。</p>
--	-------------	--	--	---

注：1、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。  
2、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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》、《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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 MSN 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风

险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 2 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，全球经济增长相对疲弱，欧债危机爆发，国内经济增长放缓，尽管央行两次出台降息政策，但国内 A 股市场依然呈现出先扬后抑态势，周期性行业以及制造业面临的压力较大，医药、食品饮料等消费行业表现较为突出。本基金采用严格的跟踪误差技术进行管理，基金表现好于基准的主要原因是由于成分股分红因素造成的。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内上证 180ETF 基金份额净值增长率为 6.55%，同期业绩比较基准增长率为 5.40%，基金净值表现领先比较基准 1.15%，上半年日跟踪误差为 0.09%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，随着国内通胀下行，国内货币政策还存在一定的调整空间，经济层面的

压力会逐步减弱，美国经济依然处在复苏的轨道上。随着国内经济增长的转型以及制度性红利释放，我们对国内中长期持续的经济增长并不担心。

作为上证 180ETF 的管理人，我们将继续秉承既定的投资目标与策略，规范运作、勤勉尽责，充分拟合指数，减少跟踪误差，为投资者提供优质的上证 180 指数投资工具。

#### 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

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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：

尚志民，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，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司首席投资官。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任投资研究部总监。

宋磊，投资研究部联席总监，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有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、投资研究部联席总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。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有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。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 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理，指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，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的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## （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

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

### 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

本报告期不进行收益分配。

### 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关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

#### 5.3 托管人对本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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	52,976,802.75	30,313,142.35
结算备付金		1,013,510.26	686,618.32
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	9,452,556,691.47	8,970,702,452.35
其中：股票投资		9,429,582,427.47	8,965,583,135.35
基金投资		-	-
债券投资		22,974,264.00	5,119,317.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		6,331,433.83	5,472,795.19
应收利息	6.4.7.5	16,506.86	17,110.94
应收股利		24,948,960.35	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		9,537,843,905.52	9,007,192,119.15
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2012 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2011 年 12 月 31 日</b>
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		212,850.10	80,343.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,949,972.13	3,814,861.13
应付托管费		789,994.42	762,972.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	776,300.57	459,960.30
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	645,571.41	850,922.84
负债合计		6,374,688.63	5,969,059.81
所有者权益：			



实收基金	6.4.7.9	4,762,015,390.64	4,795,019,303.30
未分配利润	6.4.7.1 0	4,769,453,826.25	4,206,203,756.04
所有者权益合计		9,531,469,216.89	9,001,223,059.34
负债和所有者权益总计		9,537,843,905.52	9,007,192,119.15

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.537 元，基金份额总额 17,747,226,740.00 份。

## 6.2 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>687,387,888.98</b>	<b>-69,130,698.44</b>
1. 利息收入		147,278.65	167,912.21
其中：存款利息收入	6.4.7.1 1	138,438.30	163,109.71
债券利息收入		8,840.35	4,802.50
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）		-74,215,674.57	13,230,364.21
其中：股票投资收益	6.4.7.1 2	-208,857,349.00	-57,081,621.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.1 3	353,808.26	1,614,962.47
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	134,287,866.17	68,697,022.99
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	761,087,563.65	-82,524,047.35

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	368,721.25	-4,927.51
<b>减：二、费用</b>		<b>32,509,417.78</b>	<b>19,959,162.74</b>
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	25,003,473.09	14,995,369.25
2. 托管费	6.4.10. 2.2	5,000,694.63	2,999,073.84
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	2,283,714.41	1,750,880.23
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	221,535.65	213,839.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>654,878,471.20</b>	<b>-89,089,861.18</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>654,878,471.20</b>	<b>-89,089,861.18</b>

### 6.3 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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）	4,795,019,303.30	4,206,203,756.04	9,001,223,059.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	654,878,471.20	654,878,471.20
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）	-33,003,912.66	-91,628,400.99	-124,632,313.65
其中：1. 基金申购款	4,915,972,800.61	5,115,030,186.02	10,031,002,986.6

			3
2. 基金赎回款	-4, 948, 976, 713. 27	-5, 206, 658, 587. 01	-10, 155, 635, 300. 28
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)	4, 762, 015, 390. 64	4, 769, 453, 826. 25	9, 531, 469, 216. 89
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	2, 463, 011, 238. 75	3, 515, 376, 227. 60	5, 978, 387, 466. 35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-89, 089, 861. 18	-89, 089, 861. 18
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)	368, 677, 838. 27	534, 142, 219. 43	902, 820, 057. 70
其中：1. 基金申购款	5, 758, 779, 985. 26	8, 421, 212, 366. 49	14, 179, 992, 351. 75
2. 基金赎回款	-5, 390, 102, 146. 99	-7, 887, 070, 147. 06	-13, 277, 172, 294. 05
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)	2, 831, 689, 077. 02	3, 960, 428, 585. 85	6, 792, 117, 662. 87

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勃，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

上证 180 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监

督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]第 30 号《关于同意上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,072,807,826.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 35 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,072,822,105.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,279.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

为了与上证 180 指数进行对比,根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,华安基金管理有限公司确定 2006 年 5 月 10 日为本基金的基金份额折算日。当日上证 180 指数收盘值为 2,919.214 点,本基金资产净值为 1,167,168,017.51 元,折算前基金份额总额为 1,072,822,105.00 份,折算前基金份额净值为 1.088 元。根据基金份额折算公式,基金份额折算比例为 0.37268313,折算后基金份额总额为 399,822,674.00 份,折算后基金份额净值为 2.919 元。华安基金管理有限公司已根据上述折算比例,对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算,并由基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司于 2006 年 5 月 11 日进行了变更登记。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证债字[2006]第 39 号文审核同意,本基金 399,822,674.00 份基金份额于 2006 年 5 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》和《关于华安上证 180ETF 实施份额拆分和修改基金合同的公告》的有关规定,本基金于 2009 年 5 月 19 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 10:1,并于 2009 年 5 月 19 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的主要投资范围为标的指数上证 180 指数的成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的 95%;同时为更好地实现

投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：上证 180 指数。

华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“上证 180ETF 联接基金”)。上证 180ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2012 年 8 月 24 日批准报出。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **6.4.4 本报告期所采取的会计政策、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。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

无。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	52,976,802.75
定期存款	-
其他存款	-

合计	52,976,802.75
----	---------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,862,813,130.63	9,429,582,427.47	-433,230,703.16
债券	交易所市场	22,006,000.00	22,974,264.00	968,264.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	22,006,000.00	22,974,264.00	968,264.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		9,884,819,130.63	9,452,556,691.47	-432,262,439.16

注：本报告期末股票公允价值包括可退替代款估值增值 47,173.00 元。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	9,585.01
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	410.49
应收债券利息	6,511.36
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	-
合计	16,506.86

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	776,300.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	776,300.57

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付后端申购费	-
预提费用	220,786.02
可退替代款	397,935.80
应付替代款	26,849.59
合计	645,571.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,870,226,740.00	4,795,019,303.30
本期申购	18,321,000,000.00	4,915,972,800.61
本期赎回（以“-”号填列）	-18,444,000,000.00	-4,948,976,713.27
本期末	17,747,226,740.00	4,762,015,390.64

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,443,333,446.46	-237,129,690.42	4,206,203,756.04
本期利润	-106,209,092.45	761,087,563.65	654,878,471.20
本期基金份额交易产生的变动数	-21,747,318.87	-69,881,082.12	-91,628,400.99
其中：基金申购款	4,405,046,096.96	709,984,089.06	5,115,030,186.02



基金赎回款	-4,426,793,415.83	-779,865,171.18	-5,206,658,587.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,315,377,035.14	454,076,791.11	4,769,453,826.25

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	125,300.55
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	13,137.75
其他	-
合计	138,438.30

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-68,102,618.90
股票投资收益——赎回差价收入	-140,754,730.10
合计	-208,857,349.00

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	621,846,365.18
减：卖出股票成本总额	689,948,984.08
买卖股票差价收入	-68,102,618.90

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	10,155,635,300.28
减：现金支付赎回款总额	57,804,721.28
减：赎回股票成本总额	10,238,585,309.10
赎回差价收入	-140,754,730.10

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,193,283.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,830,000.00
减：应收利息总额	9,474.74
债券投资收益	353,808.26

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	134,287,866.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	134,287,866.17

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	761,087,563.65
——股票投资	760,408,616.65
——债券投资	678,947.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	761,087,563.65

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	368,721.25
合计	368,721.25

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	2,283,714.41
银行间市场交易费用	-
合计	2,283,714.41

### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	61,661.60
信息披露费	129,289.16
上市年费	29,835.26
银行汇划费用	749.63
合计	221,535.65

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

无。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

### 6.4.9 关联方关系

#### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
华安上证180交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“上证180ETF联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,003,473.09	14,995,369.25
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华安基金管理有限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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,000,694.63	2,999,073.84

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末

	2012 年 6 月 30 日		2011 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
上证 180ETF 联接基金	2, 226, 788, 450. 00	12. 55%	1, 595, 191, 061. 00	8. 93%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同及招募说明书的规定确定，符合公允性要求。

#### 6. 4. 10. 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	52, 976, 802. 75	125, 300. 55	62, 526, 970. 55	148, 892. 62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6. 4. 10. 6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6. 4. 10. 7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6. 4. 11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6. 4. 12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6. 4. 12. 1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6. 4. 12. 2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6. 4. 12. 3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6. 4. 12. 3. 1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6. 4. 12. 3. 2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6. 4. 13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证 180 指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。本基金投资的金融工具主要为股票投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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）导致无法获得股票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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部和风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.24%（2011 年 12 月 31 日，本基金持有的信用类债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.06%），因此信用风险的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持证券在证券交易所上市，因此除列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金将不高于基金资产净值 5% 的资产投资于交易所交易的固定收益品种，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存	52,976,802.7	-	-	-	52,976,802.75

款	5				
结算备付金	1,013,510.26	-	-	-	1,013,510.26
交易性金融资产	-	-	22,974,264.00	9,429,582,427.47	9,452,556,691.47
应收利息	-	-	-	16,506.86	16,506.86
应收股利	-	-	-	24,948,960.35	24,948,960.35
应收证券清算款	-	-	-	6,331,433.83	6,331,433.83
资产总计	53,990,313.01	-	22,974,264.00	9,460,879,328.51	9,537,843,905.52
负债					
应付证券清算款	-	-	-	212,850.10	212,850.10
应付管理人报酬	-	-	-	3,949,972.13	3,949,972.13
应付托管费	-	-	-	789,994.42	789,994.42
应付交易费用	-	-	-	776,300.57	776,300.57
其他负债	-	-	-	645,571.41	645,571.41
负债总计	-	-	-	6,374,688.63	6,374,688.63
利率敏感度缺口	53,990,313.01	-	22,974,264.00	9,454,504,639.88	9,531,469,216.89
上年度末2011	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计



年12月 31日					
资产					
银行存款	30,313,142.35	-	-	-	30,313,142.35
结算备付金	686,618.32	-	-	-	686,618.32
交易性金融资产	-	-	5,119,317.00	8,965,583,135.35	8,970,702,452.35
应收利息	-	-	-	17,110.94	17,110.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	5,472,795.19	5,472,795.19
资产总计	30,999,760.67	-	5,119,317.00	8,971,073,041.48	9,007,192,119.15
负债					
应付证券清算款	-	-	-	80,343.33	80,343.33
应付管理人报酬	-	-	-	3,814,861.13	3,814,861.13
应付托管费	-	-	-	762,972.21	762,972.21
应付交易费用	-	-	-	459,960.30	459,960.30
其他负债	-	-	-	850,922.84	850,922.84
负债总计	-	-	-	5,969,059.81	5,969,059.81
利率敏	30,999,760.6	-	5,119,317.00	8,965,103,981.67	9,001,223,059.34

感度缺口	7				
------	---	--	--	--	--

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.24%（2011 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.06%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。根据标的指数，结合研究报告，基金经理以完全复制标的指数成分股权重方法构建组合。基金经理将跟踪标的指数变动，结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果，对投资组合进行监控和调整，密切跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，上证 180 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 95%，新股、债券及其它金融工具投资比例不高于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,429,582,427.47	98.93	8,965,583,135.35	99.60
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	9,429,582,427.47	98.93	8,965,583,135.35	99.60

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降5%	减少约47,577.00万元	减少约44,990.00万元
	业绩比较基准上升5%	增加约47,577.00万元	增加约44,990.00万元

### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	9,429,582,427.47	98.86
	其中：股票	9,429,582,427.47	98.86
2	固定收益投资	22,974,264.00	0.24
	其中：债券	22,974,264.00	0.24
	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	53,990,313.01	0.57
6	其他各项资产	31,296,901.04	0.33
7	合计	9,537,843,905.52	100.00

注：此处股票投资含可退替代款估值增值 47,173.00 元。

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 指数投资期末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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	48,669,922.41	0.51
B	采掘业	1,093,696,570.21	11.47
C	制造业	2,366,842,508.94	24.83
C0	食品、饮料	467,081,517.66	4.90
C1	纺织、服装、皮毛	38,540,115.92	0.40
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	116,517,450.50	1.22
C5	电子	102,641,969.94	1.08
C6	金属、非金属	571,512,257.59	6.00
C7	机械、设备、仪表	768,347,938.62	8.06
C8	医药、生物制品	302,201,258.71	3.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	310,938,424.44	3.26
E	建筑业	346,595,189.01	3.64
F	交通运输、仓储业	304,038,810.52	3.19
G	信息技术业	256,561,233.85	2.69
H	批发和零售贸易	110,700,119.49	1.16
I	金融、保险业	3,914,198,025.64	41.07
J	房地产业	503,643,048.05	5.28
K	社会服务业	45,616,521.54	0.48
L	传播与文化产业	21,347,720.48	0.22
M	综合类	106,687,159.89	1.12
	合计	9,429,535,254.47	98.93

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 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	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	9,457,134	432,569,309.16	4.54
2	600016	民生银行	63,108,723	378,021,250.77	3.97
3	600036	招商银行	34,487,679	376,605,454.68	3.95
4	601328	交通银行	63,469,272	288,150,494.88	3.02
5	600519	贵州茅台	1,153,653	275,896,114.95	2.89
6	601166	兴业银行	21,071,910	273,513,391.80	2.87
7	601398	工商银行	68,024,396	268,696,364.20	2.82
8	600000	浦发银行	31,171,804	253,426,766.52	2.66
9	600030	中信证券	19,155,740	241,936,996.20	2.54
10	600837	海通证券	22,444,056	216,136,259.28	2.27
11	601088	中国神华	9,213,493	207,119,322.64	2.17
12	601601	中国太保	8,752,325	194,126,568.50	2.04
13	600111	包钢稀土	4,052,498	159,911,571.08	1.68
14	601288	农业银行	57,585,797	149,147,214.23	1.56
15	601668	中国建筑	41,720,408	139,346,162.72	1.46
16	600048	保利地产	11,956,196	135,583,262.64	1.42
17	601169	北京银行	12,127,390	118,484,600.30	1.24
18	600031	三一重工	8,482,202	118,072,251.84	1.24
19	601006	大秦铁路	16,594,242	116,657,521.26	1.22
20	601818	光大银行	33,740,072	95,821,804.48	1.01
21	600900	长江电力	13,757,932	93,553,937.60	0.98
22	600887	伊利股份	4,440,826	91,392,199.08	0.96
23	600015	华夏银行	9,531,979	90,267,841.13	0.95
24	601857	中国石油	9,851,164	89,153,034.20	0.94
25	600050	中国联通	23,458,224	87,264,593.28	0.92
26	600104	上汽集团	6,058,214	86,571,878.06	0.91
27	601899	紫金矿业	21,937,860	85,118,896.80	0.89
28	600585	海螺水泥	5,481,118	81,230,168.76	0.85
29	600383	金地集团	12,433,030	80,566,034.40	0.85
30	600256	广汇能源	5,867,129	79,030,227.63	0.83

31	600999	招商证券	6,584,369	76,444,524.09	0.80
32	601628	中国人寿	4,170,331	76,317,057.30	0.80
33	600028	中国石化	11,850,770	74,659,851.00	0.78
34	600518	康美药业	4,278,529	65,974,917.18	0.69
35	600547	山东黄金	1,978,572	64,976,304.48	0.68
36	601989	中国重工	12,214,097	63,391,163.43	0.67
37	600019	宝钢股份	14,642,117	63,253,945.44	0.66
38	600739	辽宁成大	3,782,883	59,012,974.80	0.62
39	600489	中金黄金	2,718,518	58,502,507.36	0.61
40	600795	国电电力	21,488,066	58,017,778.20	0.61
41	600362	江西铜业	2,306,433	55,146,813.03	0.58
42	601988	中国银行	19,446,709	54,839,719.38	0.58
43	601699	潞安环能	2,577,004	53,447,062.96	0.56
44	600690	青岛海尔	4,479,212	52,496,364.64	0.55
45	600348	阳泉煤业	3,356,759	51,358,412.70	0.54
46	600011	华能国际	7,862,186	50,711,099.70	0.53
47	601009	南京银行	5,841,126	49,766,393.52	0.52
48	601788	光大证券	3,774,650	49,712,140.50	0.52
49	600406	国电南瑞	2,654,215	49,607,278.35	0.52
50	600089	特变电工	7,318,945	49,549,257.65	0.52
51	601600	中国铝业	7,982,794	49,253,838.98	0.52
52	600276	恒瑞医药	1,695,115	48,666,751.65	0.51
53	601688	华泰证券	4,628,869	48,603,124.50	0.51
54	601299	中国北车	11,564,326	46,372,947.26	0.49
55	601168	西部矿业	5,387,990	46,121,194.40	0.48
56	601669	中国水电	10,376,750	45,346,397.50	0.48
57	601766	中国南车	9,803,951	44,706,016.56	0.47
58	600309	烟台万华	3,033,459	40,496,677.65	0.42
59	601898	中煤能源	5,085,284	39,360,098.16	0.41
60	600068	葛洲坝	5,864,947	38,298,103.91	0.40
61	601186	中国铁建	8,475,823	37,717,412.35	0.40
62	601390	中国中铁	14,518,839	37,313,416.23	0.39
63	600100	同方股份	4,411,243	37,142,666.06	0.39
64	600535	天士力	848,649	37,102,934.28	0.39
65	600600	青岛啤酒	966,469	36,909,451.11	0.39
66	600642	申能股份	7,853,512	36,204,690.32	0.38
67	600150	中国船舶	1,532,076	35,191,785.72	0.37
68	600010	包钢股份	7,175,285	35,015,390.80	0.37
69	600009	上海机场	2,715,646	34,597,330.04	0.36
70	601958	金钼股份	2,685,665	34,027,375.55	0.36
71	600123	兰花科创	1,881,662	33,982,815.72	0.36

72	600875	东方电气	1,889,749	33,864,302.08	0.36
73	601618	中国中冶	13,595,014	33,715,634.72	0.35
74	601666	平煤股份	3,299,220	33,388,106.40	0.35
75	600583	海油工程	5,421,440	33,016,569.60	0.35
76	600196	复星医药	3,201,474	33,007,196.94	0.35
77	600549	厦门钨业	740,237	32,503,806.67	0.34
78	600177	雅戈尔	3,718,302	31,568,383.98	0.33
79	601117	中国化学	5,450,410	31,448,865.70	0.33
80	600188	兖州煤业	1,646,353	31,247,779.94	0.33
81	600085	同仁堂	1,788,402	31,207,614.90	0.33
82	601919	中国远洋	6,541,157	30,350,968.48	0.32
83	600005	武钢股份	11,238,409	30,231,320.21	0.32
84	600143	金发科技	5,034,675	30,057,009.75	0.32
85	601998	中信银行	7,495,375	29,981,500.00	0.31
86	600415	小商品城	3,826,254	29,844,781.20	0.31
87	601111	中国国航	4,807,595	29,566,709.25	0.31
88	600271	航天信息	1,552,587	29,359,420.17	0.31
89	600166	福田汽车	4,103,132	29,337,393.80	0.31
90	600369	西南证券	2,539,495	28,721,688.45	0.30
91	600029	南方航空	6,050,907	27,894,681.27	0.29
92	600376	首开股份	2,072,911	27,445,341.64	0.29
93	601808	中海油服	1,662,282	27,444,275.82	0.29
94	600115	东方航空	6,451,667	26,967,968.06	0.28
95	600252	中恒集团	2,445,353	26,801,068.88	0.28
96	600058	五矿发展	1,192,609	26,630,958.97	0.28
97	600497	驰宏锌锗	1,873,368	26,358,287.76	0.28
98	600809	山西汾酒	698,745	26,335,699.05	0.28
99	600741	华域汽车	2,875,475	25,793,010.75	0.27
100	601901	方正证券	4,993,862	25,368,818.96	0.27
101	600655	豫园商城	3,179,719	25,056,185.72	0.26
102	600395	盘江股份	903,481	24,285,569.28	0.25
103	601106	中国一重	7,597,995	24,009,664.20	0.25
104	600060	海信电器	1,412,587	23,745,587.47	0.25
105	600703	三安光电	1,715,823	23,352,351.03	0.25
106	600649	城投控股	3,221,147	23,256,681.34	0.24
107	601607	上海医药	2,167,769	23,130,095.23	0.24
108	601717	郑煤机	1,947,460	22,590,536.00	0.24
109	600259	广晟有色	332,451	21,918,494.43	0.23
110	600804	鹏博士	3,629,891	21,561,552.54	0.23
111	600219	南山铝业	3,215,425	21,543,347.50	0.23
112	600208	新潮中宝	5,182,227	21,402,597.51	0.22

113	600839	四川长虹	10,113,790	21,340,096.90	0.22
114	600125	铁龙物流	2,510,655	21,290,354.40	0.22
115	600366	宁波韵升	982,669	20,400,208.44	0.21
116	601179	中国西电	5,101,480	20,303,890.40	0.21
117	600811	东方集团	3,690,989	20,226,619.72	0.21
118	601001	大同煤业	1,826,871	20,004,237.45	0.21
119	600266	北京城建	1,285,707	19,529,889.33	0.20
120	601633	长城汽车	1,093,513	19,464,531.40	0.20
121	600643	爱建股份	2,356,800	19,443,600.00	0.20
122	600895	张江高科	2,267,659	19,433,837.63	0.20
123	600893	航空动力	1,490,743	19,394,566.43	0.20
124	601101	昊华能源	1,122,192	19,211,927.04	0.20
125	600971	恒源煤电	1,363,564	18,994,446.52	0.20
126	600674	川投能源	2,716,279	18,796,650.68	0.20
127	600108	亚盛集团	3,802,191	18,744,801.63	0.20
128	600216	浙江医药	742,227	18,667,009.05	0.20
129	601928	凤凰传媒	2,091,838	17,989,806.80	0.19
130	600340	华夏幸福	977,505	17,683,065.45	0.19
131	600664	哈药股份	2,677,340	17,643,670.60	0.19
132	600132	重庆啤酒	806,767	17,418,099.53	0.18
133	600331	宏达股份	2,145,261	17,247,898.44	0.18
134	601158	重庆水务	2,841,906	16,738,826.34	0.18
135	600221	海南航空	3,424,852	16,713,277.76	0.18
136	600550	天威保变	1,903,543	16,617,930.39	0.17
137	600863	内蒙华电	2,102,728	16,611,551.20	0.17
138	600352	浙江龙盛	2,870,290	16,446,761.70	0.17
139	600498	烽火通信	607,526	16,105,514.26	0.17
140	600160	巨化股份	1,568,098	15,837,789.80	0.17
141	600325	华发股份	1,838,037	15,660,075.24	0.16
142	600118	中国卫星	1,232,741	15,520,209.19	0.16
143	600316	洪都航空	1,179,417	15,367,803.51	0.16
144	600598	北大荒	2,047,056	15,250,567.20	0.16
145	600675	中华企业	3,176,332	14,865,233.76	0.16
146	600970	中材国际	1,287,527	14,858,061.58	0.16
147	600663	陆家嘴	1,208,774	14,831,656.98	0.16
148	600516	方大炭素	1,734,617	14,813,629.18	0.16
149	600816	安信信托	890,650	14,802,603.00	0.16
150	601336	新华保险	431,571	14,776,991.04	0.16
151	600169	太原重工	4,205,715	14,762,059.65	0.15
152	601118	海南橡胶	2,136,034	14,674,553.58	0.15
153	601555	东吴证券	1,628,898	14,399,458.32	0.15



154	600072	中船股份	807,752	14,345,675.52	0.15
155	600158	中体产业	1,847,152	14,167,655.84	0.15
156	600239	云南城投	1,646,725	13,980,695.25	0.15
157	600770	综艺股份	1,213,000	13,925,240.00	0.15
158	600747	大连控股	2,955,830	13,803,726.10	0.14
159	600636	三爱富	706,936	13,679,211.60	0.14
160	601377	兴业证券	1,283,082	13,446,699.36	0.14
161	600418	江淮汽车	2,424,387	13,115,933.67	0.14
162	600109	国金证券	852,921	12,273,533.19	0.13
163	601992	金隅股份	1,708,350	11,360,527.50	0.12
164	601002	晋亿实业	1,008,706	10,793,154.20	0.11
165	600823	世茂股份	964,173	10,586,619.54	0.11
166	600736	苏州高新	1,775,029	10,046,664.14	0.11
167	600873	梅花集团	1,480,643	9,994,340.25	0.10
168	600251	冠农股份	487,753	9,135,613.69	0.10
169	600614	鼎立股份	610,494	9,102,465.54	0.10
170	600503	华丽家族	1,868,774	8,596,360.40	0.09
171	601099	太平洋	1,216,791	8,395,857.90	0.09
172	600151	航天机电	1,255,186	8,121,053.42	0.09
173	600773	西藏城投	632,077	7,989,453.28	0.08
174	601233	桐昆股份	797,681	6,971,731.94	0.07
175	600759	正和股份	1,013,696	5,615,875.84	0.06
176	600641	万业企业	1,198,039	5,582,861.74	0.06
177	600657	信达地产	1,251,618	5,544,667.74	0.06
178	601311	骆驼股份	475,636	4,418,658.44	0.05
179	600373	中文传媒	233,838	3,357,913.68	0.04

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 明细

本基金本报告期末未持有积极股票投资。

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 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	601818	光大银行	67,322,142.23	0.75
2	600011	华能国际	51,385,633.41	0.57
3	601669	中国水电	45,799,683.99	0.51

4	600535	天士力	37,265,880.06	0.41
5	601328	交通银行	32,589,720.57	0.36
6	600143	金发科技	29,749,032.91	0.33
7	601901	方正证券	24,808,380.10	0.28
8	600837	海通证券	24,540,692.16	0.27
9	601288	农业银行	24,417,152.65	0.27
10	600060	海信电器	23,638,610.02	0.26
11	600015	华夏银行	22,605,479.00	0.25
12	601398	工商银行	20,149,878.20	0.22
13	600971	恒源煤电	18,798,192.77	0.21
14	601633	长城汽车	18,504,376.44	0.21
15	601928	凤凰传媒	17,562,443.78	0.20
16	601166	兴业银行	17,524,857.36	0.19
17	600340	华夏幸福	17,437,790.20	0.19
18	600970	中材国际	14,952,999.87	0.17
19	601336	新华保险	14,374,586.64	0.16
20	601717	郑煤机	14,362,792.23	0.16

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

**7.4.2 累计卖出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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600660	福耀玻璃	34,916,879.15	0.39
2	600832	东方明珠	24,910,649.20	0.28
3	601888	中国国旅	20,899,967.75	0.23
4	600016	民生银行	18,379,739.32	0.20
5	601018	宁波港	17,844,015.18	0.20
6	601866	中海集运	17,417,665.31	0.19
7	600036	招商银行	17,137,850.96	0.19
8	600812	华北制药	15,228,001.49	0.17
9	600879	航天电子	14,924,337.22	0.17
10	600311	荣华实业	14,656,495.08	0.16
11	600432	吉恩镍业	14,617,666.00	0.16
12	600064	南京高科	12,749,890.15	0.14
13	600595	中孚实业	12,282,565.38	0.14
14	601328	交通银行	11,905,900.68	0.13
15	601166	兴业银行	11,692,374.74	0.13
16	600000	浦发银行	11,513,632.67	0.13
17	600837	海通证券	10,416,208.64	0.12
18	601718	际华集团	10,372,771.60	0.12

19	600030	中信证券	10,142,545.65	0.11
20	600884	杉杉股份	9,566,653.19	0.11

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	955,336,046.30
卖出股票的收入（成交）总额	621,846,365.18

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	22,974,264.00	0.24
8	其他	-	-
9	合计	22,974,264.00	0.24

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113003	重工转债	220,060	22,974,264.00	0.24

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	6,331,433.83
3	应收股利	24,948,960.35
4	应收利息	16,506.86
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,296,901.04

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份	持有份额	占总份

			额比例		额比例
59,224	299,662.75	13,924,763,382.00	78.46%	3,822,463,358.00	21.54%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	新华人寿保险股份有限公司	2,186,139,028	12.32%
2	中国人寿保险（集团）公司	1,222,344,678	6.89%
3	中国人寿保险股份有限公司	568,030,770	3.20%
4	中国人民人寿保险股份有限公司一分红一个险分红	494,747,618	2.79%
5	中国平安保险（集团）股份有限公司	469,728,937	2.65%
6	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	454,999,753	2.56%
7	中国人寿保险股份有限公司	380,431,762	2.14%
8	英大泰和人寿保险股份有限公司—传统保险产品	285,244,049	1.61%
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红一个人分红	253,664,099	1.43%
10	太平人寿保险有限公司	240,000,000	1.35%
11	中国建设银行股份有限公司—华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,226,788,450	12.55%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	-	-

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006 年 4 月 13 日）基金份额总额	1,072,822,105.00
本报告期期初基金份额总额	17,870,226,740.00
本报告期基金总申购份额	18,321,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,444,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	17,747,226,740.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2012 年 2 月 3 日，关于基金行业高级管理人员变更公告，尚志民先生任华安基金管理有限公司副总经理。尚志民先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

#### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

#### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	2	1,565,063,381.42	100.00%	1,347,848.29	100.00%	-

##### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	5,193,283.00	100.00%	-	-	-	-

注：1、本报告期内，本基金交易单元无变更情况。

2、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于华安上证180ETF新增财通证券为一级交易商的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2012-01-10
2	关于住所变更公告，住所变更为上海市	《上海证券报》、	2012-03-30



	浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层	《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	
3	关于电子直销平台开通“直销转托管”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2012-04-16
4	关于基金电子交易平台开展工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、 《证券时报》、 《中国证券报》 和公司网站	2012-05-02

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 [www.huaan.com.cn](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

2012年1月16日, 托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告, 自2012年1月16日起, 王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金合同》；
- 2、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《上证 180 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、《关于核准上证 180 交易型开放式指数证券投资基金募集申请的批复》；
- 5、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、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；

### 12.2 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>。

### 12.3 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免费查阅。

华安基金管理有限公司  
二〇一二年八月二十七日