华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金更新的招募说明书摘要

2008年第2号

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
基金类型：契约型开放式

日　　期：2008年12月

一、基金合同的生效日期

经华安上证180指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决通过，并经中国证监会证监基金字[2006]8号文核准，华安上证180指数增强型证券投资基金于2006年1月9日变更为华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金。华安上证180指数增强型证券投资基金经中国证监会2002年9月26日证监基金字[2002]70号文件《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》批准发起设立，基金合同于2002年11月8日正式生效。

二、重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为2008年11月8日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年9月30日（未经审计）。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

1.名称：华安基金管理有限公司

2.住所：上海浦东新区浦东南路360号，新上海国际大厦38楼

3.设立日期：1998年6月4日

4.法定代表人：俞妙根

5.办公地址：上海浦东新区浦东南路360号，新上海国际大厦2楼、37楼、38楼

6.联系电话：(021)38969999

7.联系人：冯颖

8.注册资本：1.5亿元人民币

9.股权结构：

上海电气（集团）总公司持股20%、上海国际信托有限公司持股20%、上海工业投资（集团）有限公司持股20%、上海沸点投资发展有限公司持股20%、上海锦江国际投资管理有限公司持股20%。

（二）主要人员情况

1.董事、监事及高级管理人员

（1）董事会：

徐建国先生，研究生学历，高级经济师及上海财经大学兼职教授。历任上海日用化学工业公司副经理，上海市轻工业局局长助理、副局长、党委书记，上海市经济委员会副主任，上海市宝山区区长，上海市黄浦区区长，上海市人民政府副秘书长、上海市经济委员会主任，现任上海电气（集团）总公司董事长。

俞妙根先生，大学学历，高级经济师。历任上海国际信托投资公司驻德国汉堡办事处总代表、AIT公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理，上海国际信托投资有限公司副总经理。2006年11月加入华安基金管理有限公司，并主持公司日常经营工作，现任华安基金管理有限公司总裁，副董事长。

宰昌基先生，大专学历，高级工程师。历任上海合成纤维研究所副科长，中石化上海石化总厂涤纶厂总工程师、厂长助理，中石化上海石化股份公司副总经理，中石化上海金山实业公司总经理，上海市经委副主任，现任上海工业投资（集团）有限公司董事长。

万才华先生，大专学历，经济师。历任中国农业银行上海市分行川沙支行营业部职员，浦东花木信用社信贷组长，浦东洋泾信用社副主任，中国农业银行上海市分行陆家嘴支行营业部副行长，中国农业银行上海市分行金桥支行副行长，兴业银行上海分行浦东支行行长，现任上海国际信托投资有限公司副总经理。

马名驹先生，大学学历，高级会计师。历任上海凤凰自行车股份有限公司副董事长兼总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，上海锦江国际投资管理有限公司董事兼总经理，锦江国际（集团）有限公司副总裁及计划财务部经理、金融事业部总经理，上海锦沧文华大酒店董事长、锦江麦德龙现购自运有限公司副董事长、北京昆仑饭店董事、上海锦江国际旅馆投资有限公司董事、锦江之星旅馆有限公司董事、锦江国际集团财务有限责任公司董事兼财务总监。

独立董事：

萧灼基先生，研究生学历，教授。现任全国政协委员，政协经济委员会委员，北京大学经济学院教授，博士生导师，北京市、云南省、吉林省、成都市，武汉市等省市专家顾问，北京市场经济研究所所长，《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生，研究生学历，教授。历任上海财经大学科研处处长，上海财经大学南德管理学院院长，上海财经大学常务副校长，现任上海国家会计学院院长、党委书记，APEC金融与发展项目执行秘书处秘书长，兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

（2）监事会：

谢伟民先生，研究生学历，副教授。历任上海市城建沪南工务所干部，空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师，上海市计委直属机关党委干事，中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员（副处级）、副处长，中共上海市金融工作党委组织处（宣传处）副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记（正处级）。

陈涵女士，研究生学历，经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长，现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生，研究生学历，高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长，上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长，现任上海电气（集团）总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

徐丹女士，研究生学历，高级会计师，中国注册税务师。历任上海石化总厂计财处会计、财务副科长，中石化上海金山实业公司财务处副处长，上海金山实业投资发展有限公司总会计师兼财务部主任，上海金山区财政局副局长，中石化上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实华经济发展公司财务部经理，现任上海工业投资（集团）有限公司总会计师。

李梅清女士，大专学历，会计师。历任上海新亚（集团）股份有限公司财务部副经理、上海新亚（集团）有限公司财务部副经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部副经理及上市公司部副经理，上海锦江国际投资管理有限公司财务总监、金融事业部财务总监。

蒋位先生，研究生学历，经济师。曾在上海财经大学任讲师，上海市发展计划委员会工作，现任上海沸点投资发展有限公司投资部高级经理。

赵敏先生，研究生学历，助理研究员。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现任华安基金管理有限公司客户服务与电子商务部总经理。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监助理，现任华安基金管理有限公司集中交易部总经理。

（3）高级管理人员：

俞妙根先生，大学学历，高级经济师。历任上海国际信托投资公司驻德国汉堡办事处总代表、AIT公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理，上海国际信托投资有限公司副总经理。2006年11月加入华安基金管理有限公司，并主持公司日常经营工作，现任华安基金管理有限公司总裁，副董事长。

邵杰军先生，研究生学历，14年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理总部总经理助理，现任华安基金管理有限公司常务副总裁。

韩勇先生，研究生学历。先后在中国人民大学、中国人民银行总行研究生部、北京大学学习，分别获经济学学士、金融学硕士和经济学博士学位，美国杜克大学访问学者。15年证券、期货、基金从业经验。曾在君安证券有限公司和华夏证券有限公司从事投资银行工作；在中国证券监督管理委员会从事监管工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司副总裁。

李炳旺先生，研究生学历，22年基金业工作经验。曾任国际证券投资信托公司信息技术部暨注册登记部主管、怡富证券投资信托公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

章国富先生，研究生学历，21年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹（集团）有限公司财务部副部长（主持工作）、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监，现任华安基金管理有限公司督察长。

2.基金经理介绍

现任基金经理：

许之彦先生，理学博士，5年证券、基金从业经验。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，现任研究发展部数量策略分析师。2008年4月25日起担任本基金基金经理。

刘璎女士，管理学硕士，7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，2005年10月转入基金投资部协助基金经理日常工作。2007年3月至今担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2008年4月25日起担任本基金基金经理。

历任基金经理：

刘新勇先生：2002年11月8日--2003年9月18日担任本基金基金经理。

殷觅智先生(Mr. Ian Midgley)：2002年11月8日--2003年9月18日担任本基金基金经理。

王国卫先生：2003年9月18日--2005年5月25日担任本基金基金经理。

刘光华先生：2005年5月25日--2008年10月11日担任本基金基金经理。

3.本公司采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

俞妙根先生，总裁

王国卫先生，首席投资官

尚志民先生，基金投资部总经理

宋　磊先生，研究发展部总经理

诸　慧女士，集中交易部总经理

上述人员之间均不存在近亲属关系。

四、基金托管人

（一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币334,018,850,026元

联系电话：010-66105799

联系人：蒋松云

（二）主要人员情况

截至2008年9月末，中国工商银行资产托管部共有员工118人，平均年龄30岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

（三）基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2008年9月，托管证券投资基金98只，其中封闭式10只，开放式88只。托管资产规模年均递增超过90%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、履约类产品、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2008年初，中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财资》、《证券时报》和《上海证券报》等国际国内媒体评选为2007年度“中国最佳托管银行”，自2004年以来，工商银行托管服务获得的该类奖项累计已经达到12项。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1.直销机构：

(1)华安基金管理有限公司上海投资理财中心

地址：上海市浦东新区浦东南路360号新上海国际大厦2楼

电话：(021)38969997

传真：(021)68863223

联系人：陆文佳

(2)华安基金管理有限公司北京投资理财中心

地址：北京市西城区金融街23号平安大厦106室

电话：(010)66219999

传真：(010)66214060

联系人：刘彦竹

(3)华安基金管理有限公司广州投资理财中心

地址：广州市天河区天河路228号广晟大厦2202室

电话：(020)38350158转88分机

传真：(020)38350259

联系人：程安至

(4)华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

华安电子交易手机网站：wap.huaan.com.cn

华安电子交易热线：40088-50099、(021)68604666

传真：(021)68863549

联系人：韩晓华

2.代销机构：

(1)中国工商银行股份有限公司

住所：北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人：姜建清

电话：(010)66107911

传真：(010)66107914

联系人：田耕

客户服务电话：95588

网址：www.icbc.com.cn

(2)交通银行股份有限公司

住所：上海市银城中路188号

法定代表人：蒋超良

电话：(021)58781234

传真：(021)58408842

联系人：曹榕

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(3)中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街1号

法定代表人：肖钢

电话：(010)66594909

传真：(010)66594853

联系人：王娟

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(4)中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼（长安兴融中心）

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(5)招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道7088号

办公地址：深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人：秦晓

电话：(0755)83195834、83195771

传真：(0755)83195049

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(6)中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：孔丹

传真：(010)65541281

客户服务电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(7)中国光大银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦

法定代表人：唐双宁

传真：(010)68560661

客户服务电话：95595

网址：www.cebbank.com

(8) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址：北京市西城区宣武门西大街131号

办公地址：北京市西城区宣武门西大街131号

法定代表人：刘安东

客户服务电话：11185

联系人：陈春林

传真：(010)66415194

网址：www.psbc.com

(9)上海银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东二路585号

法定代表人：陈辛

传真：(021)63370777

客户服务电话：(021)962888

网址：www.bankofshanghai.com

(10)深圳发展银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南东路5047号

法定代表人：法兰克纪曼

传真：(0755)82080714

客户服务电话：95501

网址：www.sdb.com.cn

(11) 中国民生银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区正义路甲4号

办公地址：北京市东城区正义路甲4号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

传真：(010)58560794

联系人：吴杰

网址：www.cmbc.com.cn

(12)北京银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融街丙17号

法定代表人：闫冰竹

传真：(0755)82080714

客户服务电话：(010)96169

网址：www.bankofbeijing.com.cn

(13)深圳平安银行股份有限公司

注册地址：深圳市深南中路1099号平安银行大厦

法定代表人：黄立哲

电话：(0755)25859591

传真：(0755)25878304

客户服务电话：40066-99999

网址：www.18ebank.com

(14) 广东发展银行股份有限公司

注册地址：广州市农林下路83号

法定代表人：李若虹

传真：(020)87311780

客户服务电话：(020)38322974或(020)38322542

网址：ebank.gdb.com.cn

(15)国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：祝幼一

电话：(021)62580818

传真：(021)62583439

联系人：芮敏祺

客户服务电话：800-820-6888

网址：www.gtja.com

(16)中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：黎晓宏

电话：(010)65183888

客户服务电话：400-8888-108

传真：(010)65182261

网址：www.csc108.com

(17)国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市红岭中路1012号国信证券大厦16-26层

法定代表人：何如

联系人：林建闽

电话：(0755)82130833转2181

传真：(0755)82133302

客户服务电话：800-810-8868

网址：www.guosen.com.cn

(18)招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38—45层

法定代表人：宫少林

电话：(0755)82943511

传真：(0755)82943237

联系人：黄健

客户服务电话：400-8888-111、(0755)26951111

网址：www.newone.com.cn

(19)广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路183号大都会广场36楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

客户服务电话：(020)87555888

传真：(020)87557985

网址：www.gf.com.cn

(20)中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区湖贝路1030号海龙王大厦

办公地址：北京市新源南路6号京城大厦3楼

法定代表人：王东明

电话：(010)84864818

客户服务电话：010-84868330

传真：(010)84865560

联系人：陈忠

网址：www.ecitic.com

(21)中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：朱利

电话：(010)66568888

传真：(010)66568536

联系人：郭京华

客户服务电话：800-820-1868

网址：www.chinastock.com.cn

(22)海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路98号

法定代表人：王开国

电话：(021)53858553

传真：(021)53830756

联系人：金芸、李笑鸣

客户服务电话：400-8888-001、(021)962503

网址：www.htsec.com

(23)申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路171号

法定代表人：丁国荣

电话：(021)54033888

传真：(021)54035333

联系人：王序微

客户服务电话：(021)962505

网址：www.sw2000.com.cn

(24)兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路99号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：(021)68419974

传真：(021)68419867

联系人：杨盛芳

客户服务电话：(021)68419974

网址：www.xyzq.com.cn

(25)长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：4008888999

传真：027-85481900

联系人：李良

网址：www.cjsc.com.cn

(26)安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路4018号

法定代表人：牛冠兴

电话：0755-82825555

传真：518026

联系人：李国瑞

网址：www.essences.com.cn

(27)中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

办公地址：浙江省杭州市中河南路11号万凯庭院商务楼A座

法定代表人：刘军

联系人：王勤

联系电话：(0571)85783715

传真：(0571)85783771

客户服务电话：(0571)96598

网址：www.bigsun.com.cn

(28)湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼

办公地点：上海市浦东陆家嘴环路958号华能联合大厦5楼

法定代表人：陈学荣

电话：(021)68634518

传真：(021)68865938

联系人：陈伟

客户服务电话：(021)68865020

网址：www.xcsc.com

(29)国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：凤良志

电话：(0551)2207114

客户服务电话：4008-888-777

网址：www.gyzq.com.cn

(30)渤海证券有限责任公司

注册地址：天津市经济技术开发区第一大街29号

法定代表人：张志军

电话：(022)28451861

传真：(022)28451892

联系人：王兆权

客户服务电话：(022)28451883

网址：www.ewww.com.cn

(31)华泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：(025)84457777

联系人：樊昊

客户服务电话：(025)95597

网址：www.htsc.com.cn

(32)中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区香港东路316号

办公地址：青岛市东海西路28号

法定代表人：史洁民

电话：(0532)85022026

传真：(0532)85022026

联系人：丁韶燕

客户服务电话：(0532)96577

网址：www.zxwt.com.cn

(33)东方证券有限责任公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

办公地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

联系人：盛云

电话：(021)63325888

传真：(021)63326173

客户服务电话：(021)962506、400-8888-506

网址：www.dfzq.com.cn

(34)长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦16、17层

办公地址：深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：魏云鹏

电话：(0755)83516094

传真：(0755)83516199

联系人：高峰

客户服务电话：(0755)82288968

网址：www.cc168.com.cn

(35)光大证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东南路528号证券大厦南塔15-17楼

办公地址：上海市浦东南路528号证券大厦南塔14楼

法定代表人：王明权

电话：(021)68816000-1876

传真：(021)68815009

联系人：刘晨

客户服务电话：10108998

网址：www.ebscn.com

(36)广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路69号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴志明

电话：(020)87322668

传真：(020)87325036

客户服务电话：961303

网址：www.gzs.com.cn

(37)东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

电话：(0431)85096709

传真：(0431)85096795

客户服务电话：(0431)96688

网址：www.nesc.cn

(38)上海证券有限责任公司

注册地址：上海市九江路111号

法定代表人：蒋元真

电话：(021)62470304

传真：(021)65213164

联系人：王伟力

客户服务电话：800-6200-071

网址：www.962518.com

(39)国联证券股份有限责任公司

注册地址：无锡市县前东街168号国联大厦

法定代表人：范炎

电话：(0510)82831662

传真：(0510)82830162

客户服务电话：400-888-5288

网址：www.gjsc.com.cn

(40)平安证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区八卦三路平安大厦

法定代表人：陈敬达

电话：(0755)82450826

传真：(0755)82433794

联系人：袁月

客户服务电话：95511

网址：www.PA18.com

(41)华安证券有限责任公司

注册地址：安徽省合肥市长江中路357号

法定代表人：李工

电话：(0551)5161666

传真：(0551)5161600

联系人：唐泳

客户服务电话：(0551)5161671

网址：www.hazq.com

(42)国海证券有限责任公司

注册地址：广西南宁市滨湖路46号

法定代表人：张雅锋

联系人：覃清芳

电话：(0771)5539262

传真：(0771)5539033

客户服务电话：(全国)400-8888-100（广西)96100

网址：www.ghzq.com.cn

(43)财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层

法定代表人：蒋永明

电话：(0731)4403343

传真：(0731)4403439

联系人：张治平

客户服务电话：（0731）4403343

网址：www.cfzq.com

(44)东莞证券有限责任公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路1号金源中心30楼

法定代表人：游锦辉

电话：(0769)22119351

传真：(0769)22119423

联系人：罗绍辉

客户服务电话：961130

网址：www.dgzq.com.cn

(45)中原证券股份有限公司

注册地址：许昌市南关大街38号

办公地址：郑州市经三路15号广汇国贸11楼

法定代表人：张建刚

客户服务电话：(0371)967218

传真：(0371)65585670

联系人：陈利民

电话：(0371)65585670

网址：www.ccnew.com

(46)国都证券有限责任公司

住所：北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

办公地址：北京市东城区安外大街2号安贞大厦3层

法定代表人：王少华

电话：(010)64482828-390

传真：(010)64482090

联系人：马泽承

客户服务电话：800-810-8809

网址：www.guodu.com

(47)中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F

电话：(021)68604866

传真：(021)58883554

客户服务电话：4006208888

网址：www.bocichina.com

(48)宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐建设路2号

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲43号金运大厦B座6层

法定代表人：汤世生

电话：(010)62267799

传真：(010)62294470

客户服务电话：(0991)96562、(010)62294600

网址：www.ehongyuan.com

(49)齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路128号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

传真：(0531)81283735

网址：www.qlzq.com.cn

(50)世纪证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼

法定代表人：段强

电话：(0755)83199511

传真：(0755)83199545

联系人：童磊、刘军辉

客户服务电话：（0755）83199511

网址：www.csco.com.cn

(51)德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼

法定代表人：王军

电话：(021)68761616

传真：(021)68767981

联系人：罗芳

客户服务电话：(021)68761616-8125

网址：www.tebon.com.cn

(52)西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东新街232号陕西信托大厦16—17层

法定代表人：刘建武

电话：(029)87406172

客户服务电话：96708

网址：www.westsecu.com.cn

(53)瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

电话：(010)59226788

传真：(010)59226799

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(54)中山证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦B座15层

法定代表人：吴泳良

电话：(0755)82943755

传真：(0755)82940511

客户服务电话：(0755)82943750

网址：www.zszq.com.cn

(二)基金注册与过户登记人

名称：华安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路360号，新上海国际大厦38楼

法定代表人：俞妙根

电话：(021)38969999

传真：(021)68862332

联系人：朱永红

客户服务中心电话：40088-50099、(021)68604666

(三)律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼

负责人：韩炯

电话：(021)68818100

传真：(021)68816880

经办律师：韩炯、秦悦民

(四)会计师事务所和经办注册会计师

名称：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(200120)

办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼(200021)

法定代表人：杨绍信

电话：(021)63863388

传真：(021)63863300

联系人：陈尚伟

经办注册会计师：薛竞、汪棣

六、基金的名称

本基金名称：华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金。

七、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

八、基金的投资目标

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股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。

九、基金的投资方向

本基金资产主要投资于标的指数成份股。具体的投资范围为：

1、投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%，本基金投资MSCI中国A股指数成份股的比重在50个交易日内不持续低于组合中股票市值的80%。

2、参与股票一级市场的市值配售以及MSCI中国A股指数成份股的增发和配股。

3、在成份股之外的股票投资，仅限于未售出的申购新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强性投资中替代成份股的其他个股。

4、在目前的法律法规限制下，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

5、经中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具。

十、基金的投资决策

（一）投资策略

1.投资组合原则及选择标准

（1）投资组合的基本原则

1）资产分配原则：本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下，可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况，适当调整基金资产分配比例。

2）股票投资原则：本基金以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将参与一级市场的新股申购、股票增发等。

3）其他投资原则：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其他金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的收益。

（2）投资组合构建

1）股票指数化投资组合构建：

本基金的指数化投资方式将采用复制法来实现对MSCI中国A股指数的跟踪，具体过程如下：

①以MSCI中国A股指数成份股构成及其权重为基础拟定标准权重的指数化投资组合方案；

②根据增强性投资选择标准，对标准权重的指数化投资组合进行调整，形成指数增强型投资组合方案；

③根据拟定的指数增强型投资组合方案，通过指数化投资组合交易系统进行买卖；

④基金经理根据建仓过程中的买卖情况、申购赎回情况等，对投资组合进行动态调整，以保证完成指数化投资组合的构建。

2）增强性投资选择标准：

本基金的增强性投资，是指在基于研究员和基金经理对行业及上市公司的深入研究和调查的基础上，由基金经理根据股票市场的具体情况，对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整。对于以下成份股，本基金将考虑予以剔除或降低权重：

①由于公司经营状况、财务状况严重恶化或其他基本面发生重大变化而导致其投资价值严重降低的个股；

②因流动性太差而导致无法按照指数标准权重建仓的个股；

③存在重大违规嫌疑，被监管部门调查的个股；

④基金经理在充分调研的基础上，判断预期收益将远低于成份股中同类股票或指数平均水平的个股；

⑤其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

对于以下个股，本基金将考虑纳入组合或增加投资权重：

①新股配售而得到的非成份股以及因增发配售而超出指数标准权重的成份股，本基金将在新股上市后1个月以内择机卖出此类股票；

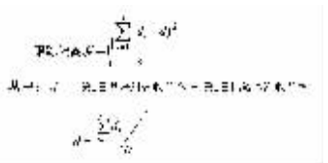
②由于其他成份股的建仓困难而被选择作为替代的个股；

③基金经理在充分调研的基础上，判断预期收益将远高于成份股中同类股票或指数平均水平的个股；

④其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股等。

（3）指数化增强性投资管理的限度和控制

本基金以指数化投资为主，增强性投资为辅，为控制因增强型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，对积极投资行为予以约束，以控制基金相对指数的偏离风险。



n为计算区间，本基金选定为30个交易日

本基金以日跟踪偏离度为测算基础，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）。如该指标接近或超过0.5%(相应折算的年跟踪偏离度约为7.75%)，则基金经理必须通过归因分析，找出造成跟踪偏离的来源，如是源于积极投资的操作，则在适当时机行使必要的组合调整，降低增强性投资力度，以使跟踪偏离度回归到最大容忍值以下。当跟踪偏离度在最大容忍值以下时，由基金经理对最佳偏离度的选择作出判断。当本基金运作发展到一定阶段后，本基金可能会将测算基础转为代表相同风险度的周或月跟踪偏离度，具体变化将另行公告。

除此之外，本基金对增强性投资的其他限制包括：

①在本基金成立之日起的合理期间后，投资组合中持有的MSCI中国A股指数成份股的数量不低于指数成份股总个数的70%；

②在本基金成立之日起的合理期间后，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70%；

2.投资管理的基本程序

（1）投资决策程序

1）投资决策委员会定期召开会议，对阶段性的投资组合资产分配比例和行业权重相对指数的偏离度作出检讨和决议；

2）金融工程小组利用集成市场预测模型和风险控制模型对行业、个股和市场的预期收益进行测算，研究部门从基本面分析对行业、个股和市场走势提出研究报告，开放式基金注册部门提供申购、赎回的动态情况，供基金经理参考；

3）基金经理小组根据对以上因素的判断，初步决定投资组合，包括股票、现金以及其他投资品种的比例，行业、个股和整体投资组合相对指数的偏离度，以及新股配售等一级市场操作的参与力度；

4）基金经理小组根据交易情况的反馈报告，对组合进行适度调整，对于需调整的个股，研究部事先提供备选的其他股票；

5）风险分析小组对基金投资组合偏离风险进行评估，并提出偏离的归因分析报告，在组合跟踪偏离度超过0.5%时提出预警；

6）监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

（2）投资操作程序

1）基金经理根据指数的标准构成，在设定的调整范围内定出组合中各个股票的比例关系，输入交易系统；

2）需买入股票时，交易员启动组合交易系统，系统按事先设定的个股权重统一下单买入，需卖出股票时，系统统一下单卖出；

3）对于需调整或组合交易出现困难的个股，基金经理可独立发出指令，交易员可在交易时间内进行单个品种操作；

4）投资部定期对指数化投资组合进行跟踪偏离度的测算，若跟踪偏离度超过允许的范围，则对组合进行调整；

5）当发生新股申购和MSCI中国A股指数成份股的增发时，研究部提供拟发行新股企业和增发企业的研究报告；投资部根据研究报告进行新股申购和增发；

6）本基金建仓期为3个月。

（二）投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金。

本基金投资组合应遵循下列规定：

（1）本基金持有1家上市公司的股票，其市值不超过本基金资产净值的10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外；

（2）本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有1家公司发行的证券的总和，不超过该证券的10%，但完全按照标的指数的构成比例进行投资的情形除外；

（3）法律法规和中国证监会的其他比例限制。

禁止用本基金资产从事以下行为：

（1）投资于其他证券投资基金；

（2）以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；

（3）以基金资产进行房地产投资；

（4）从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

（5）将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

（6）当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

十一、基金的业绩比较基准

本基金采用由权威机构发布的，代表中国A股市场的成份指数作为衡量基金投资操作水平的比较基准，目前这一指数为MSCI中国A股指数。衡量本基金整体业绩的比较基准为：

本基金整体业绩比较基准 = 95% * MSCI中国A股指数收益率+ 5% * 金融同业存款利率

如果MSCI公司变更或停止MSCI中国A股指数的编制及发布、或MSCI中国A股指数由其他指数替代、或由于指数编制方法等重大变更导致MSCI中国A股指数不宜继续作为标的指数时，本基金管理人有权依据维护投资者合法权益的原则，变更本基金的标的指数并相应变更本基金的名称。

十二、基金的风险收益特征

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，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。

十三、基金的投资组合报告（未经审计）

（一）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、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定，于2008年10月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告所载数据截至2008年9月30日，本报告中所列财务数据未经审计。

（二）基金投资组合报告(未经审计)

（1）基金资产组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,140,283,366.11	85.10
	其中：股票	4,140,283,366.11	85.10
2	固定收益投资	307,965,000.00	6.33
	其中：债券	307,965,000.00	6.33
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	1,378,921.50	0.03
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	317,401,728.22	6.52
6	其他资产	98,343,193.78	2.02
7	合计	4,865,372,209.61	100.00

（2）股票投资组合

①指数投资按行业分类的股票