

DISCLOSURE  
信息披露

## 华安上证180交易型开放式指数证券投资基金

## 2009 第四季度报告

## § 4 管理人报告

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：二〇一〇年一月二十一日

## § 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、完整性承担责任个别及连带责任。  
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、净值表现、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。

本报告书内容未经审计。

报告日期自2009年10月1日起至12月31日止。

## § 1 基金产品概况

基金简称	华安上证180ETF
基金代码	510180
基金运作方式	交易型开放式(ETP)
基金合同生效日	2006年1月20日
报告期末基金份额总额	5,282,326,740.00份
报告期总份额变动情况	增加5,282,326,740.00份,净值回报度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要投资于股票型基金，完全按照标的指数的构成及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股的调整及时进行相应的调整。但因成份股停牌等原因导致不能调整时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的股票组合。
业绩比较基准	上证180指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险收益高于货币基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，完全复制标的指数，跟踪上证180指数，是股票基金中风险中等，收益中等的基金。
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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
1.本期已实现收益	247,051,252.32	700,175,171.41
2.本期利润	0.1222	0.1222
3.加权平均基金份额本期利润	4.069,342.04	4.069,342.04
4.期末基金份额净值	0.770	0.770

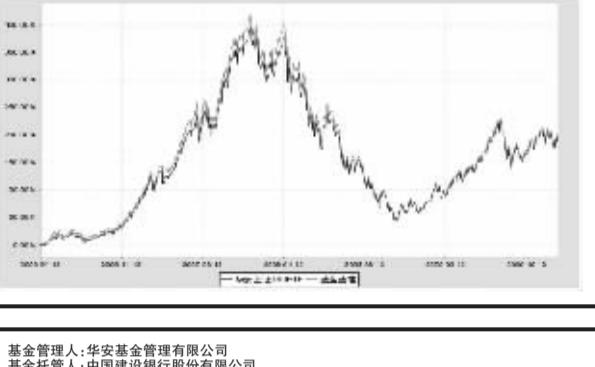
注：

1.所涉基金业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示数字。  
2.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扣除公允价值变动收益。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	净值增长(%)	净值增长基准(%)	业绩比较基准收益率(%)	收益差额(%)	(①-③)	②-④
过去3个月	17.02%	1.76%	17.50%	1.77%	-0.48%	-0.01%

3.2.2 基金合同生效以来基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：二〇一〇年一月二十一日

## § 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、准确性、完整性承担责任个别及连带责任。  
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、净值表现、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。

本报告书内容未经审计。

报告日期自2009年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华安上证180ETF联接
基金代码	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	999,473,437.49份

投资目标	通过本基金投资于华安上证180ETF，追求跟踪指数的长期投资收益。
本基金主要投资于股票型基金，完全按照标的指数的构成及其权重构建股票组合，并根据标的指数成份股的调整及时进行相应的调整。但因成份股停牌等原因导致不能调整时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的股票组合。	
投资策略	
本基金为股票型基金，风险收益高于货币基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数基金，完全复制标的指数，跟踪上证180指数，是股票基金中风险中等，收益中等的基金。	
基金管理人	

3.1 主要财务指标和基金净值表现	
单位：人民币元	
主要财务指标	
报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)	
1.本期已实现收益	48,041,977.31
2.本期利润	128,819,077.47
3.加权平均基金份额本期利润	0.1367
4.期末基金份额净值	1,066,421,818.62
5.期末基金份额净值	1,123

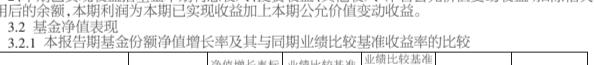
注：1.所涉基金业指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列示数字。  
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益扣除公允价值变动收益。

## 3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较						
阶段	净值增长(%)	净值增长基准(%)	业绩比较基准收益率(%)	收益差额(%)	(①-③)	②-④
过去3个月	12.41%	16.64%	1.80%	-4.23%	-0.15%	

3.2.2 基金合同生效以来基金累计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1日至2009年12月31日)

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1日至2009年12月31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：二〇一〇年一月二十一日

## § 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、准确性、完整性承担责任个别及连带责任。  
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、净值表现、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。

本报告书内容未经审计。

报告日期自2009年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	华安稳定收益债券
基金代码	040009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年1月30日
报告期末基金份额总额	400,490,250.27份

投资目标 在严格控制风险的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益及市场价格变动收益，以追求资产稳健的增值。

投资策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要的研究和分析，结合对利率走势的判断，综合考虑不同券种的收益率、期限、流动性、违约风险、信用等级等因素，制定合理的资产配置策略，积极寻找各种可能的溢价和价值增长的机会，以确保基金资产的分配比例。

业绩比较基准 本基金属于债券型基金中较低风险、低风险的品种，其预期的风险水平和预期收益水平半数以上基金，混合基金，低于货币市场基金。

基金管理人 华安基金管理有限公司

下属基金的基金简称 华安稳定收益债券 A

下属基金的基金代码 040009

下属基金的基金的份额总额 400,490,250.27份

报告期总份额变动情况 400,490,250.27份

报告期份额变动原因及比例 无

报告期份额变动原因及比例 无