# 华安创新证券投资基金

## 2011 半年度 报告摘要

2011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:交通银行股份有限公司**
**报告送出日期:二〇一一年八月二十九日**

### §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2011年1月1日起至2011年6月30日止。

### 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金简称 | 华安创新混合 | |
| 基金主代码 | 040001 | |
| 交易代码 | 040001(前端) | 041001(后端) |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2001年9月21日 | |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 10,052,796,499.86份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极追求投资收益的稳定增长为目标,以诚信原则及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。<br>这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。<br>高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域,包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。<br>传统产业类型的上市公司中,如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。<br>本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素:公司创新能力强,主营业务市场空间大,财务状况良好,具有相当竞争优势等。<br>本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产,如国债和现金,从而保持基金资产良好的流动性。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为中信标普300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。 |
| 风险收益特征 | 无 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 冯颖 | 张咏东 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-32169999 |
| | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn | zhangyd@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95559 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-62701216 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 上海市浦东南路360号新上海国际大厦38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(2011年1月1日至2011年6月30日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 256,323,700.83 |
| 本期利润 | -521,086,379.00 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0514 |
| 本期基金份额净值增长率 | -6.50% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2011年6月30日) |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3808 |
| 期末基金资产净值 | 7,285,618,761.52 |
| 期末基金份额净值 | 0.725 |

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(例如:封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),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 | 5.22% | 1.01% | 0.96% | 1.10% | 4.26% | -0.09% |
| 过去三个月 | -6.09% | 0.98% | -4.12% | 0.90% | -1.97% | 0.08% |
| 过去六个月 | -6.50% | 1.10% | -2.27% | 0.96% | -4.23% | 0.14% |
| 过去一年 | 18.28% | 1.19% | 14.00% | 1.06% | 4.28% | 0.13% |
| 过去三年 | 13.18% | 1.32% | 10.71% | 1.50% | 2.47% | -0.18% |
| 自基金成立起至今 | 298.01% | 1.20% | 91.92% | 1.36% | 206.09% | -0.16% |

注:本基金的业绩比较基准为中信标普300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。

根据本基金合同的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。

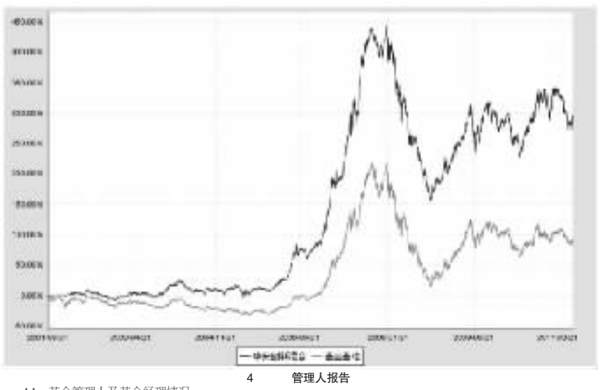
截至2011年6月30日,本基金投资于股票等权益资产占基金净资产66.35%,权证投资比例为0.00%,投资于国债和政策性金融债占基金净资产20.44%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

华安创新证券投资基金

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

(2001年9月21日至2011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2011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、华安上证180ETF、上证180ETF联接基金、华安安利股票、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、华安上证龙头ETF、上证龙头ETF联接基金、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安大中华升级股票等22只开放式基金,管理资产规模达到755.14亿人民币。

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 | | |
| 汪光成 | 本基金的基金经理 | 2009-03-27 | - | 9年 | 管理学博士,持有基金从业资格证书,9年证券、基金行业从业经历。2002年1月加入华安基金管理有限公司后,曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月至2009年3月担任安顺证券投资基金和华安安利股票型证券投资基金的基金经理,2009年3月起担任本基金的基金经理。 |

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《华安创新证券投资基金基金合同》、《华安创新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《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易,公司《交易端公平交易管理办法-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",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,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《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金(账户)参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范,执行情况良好,未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

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

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度A股市场震荡上涨,行业和板块呈现快速轮动的态势,主要表现为低估值传统产业的不断上涨和高估值新兴产业的不断下跌,以及大股票强于小股票的特征。二季度,通货膨胀率不断上升、自然灾害、欧债危机、国际局势动荡等诸多不利因素交织在一起,A股市场呈现连续下跌趋势。因控制通货膨胀而不断实施的紧缩政策等,引发了投资者对未来中国经济出现下滑的担心,市场一度出现明显的恐慌气氛,其中许多业绩不达预期或高估值的股票,出现了较大幅度的幅度,市场整体估值水平出现了系统性下移。

本报告期内,本基金重点配置于汽车、化工、装备制造业、技术类新兴产业等。在组合风格上,以成长性风格为主,在市场趋势下跌的情况下,波动幅度比较大,且由于持有的个别成长性股票业绩和经营情况不达预期,下跌幅度比较大,对组合造成较大的负面影响。在操作上,对于经营情况不达预期的股票予以清理,但对于符合预期,只是由于市场下跌而下跌的股票进行增持,使得组合集中度不断提高,在配置方向上仍然以成长性和估值比较合理的周期类股为主,适当增加防御类股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,本基金份额净值为0.725元,本报告期份额净值增长率为-6.50%,同期业绩比较基准增长率为-2.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年的市场环境与去年有点类似,但今年的环境比去年更为复杂。进入下半年,由于自然灾害等的影响,通胀环比走高,压力未减,虽然市场预期通胀将在三季度阶段性见顶回落,经济预期阶段性改善,但总体上市场缺乏明确利好,紧缩政策最多只是进入稳定期、观察期,不会出现明显的放松。另外,目前外部局势也比较复杂,美国经济、欧债危机,以及中国周边局势等,为市场增添了一些变数。一方面,经过上半年市场的调整,整体估值水平已经比较低,许多股票已经进入价值投资区间,即使经微但积极的经济或政策信号,都将支持市场反弹;另一方面,由于高房价、高通胀和其他经济、社会结构矛盾叠加,下半年政策偏紧的大基调难改变,制约行情的发展,负面因素的出现也有可能被市场情绪所放大。在总体上,市场将仍然呈现结构性的宽幅震荡格局。

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本报告期损益的影响

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、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、金融工程部总经理、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。

李炳旺先生,研究生学历,24年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、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。

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,研究发展部总经理。

黄勤,固定收益部总经理,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、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦,金融工程部总经理,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联接的基金经理,金融工程部总经理。

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

1.2010年度在本报告期内实施的利润分配:

本基金的基金管理人于2011年1月13日宣告分红,向截至2011年1月18日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.20元。

2.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

2011年上半年度,基金托管人在华安创新证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011年上半年度,华安基金管理有限公司在华安创新证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。本报告期内本基金进行了1次收益分配,分配金额为202,077,452.21元。

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

2011年上半年度,由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安创新证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

### 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:华安创新证券投资基金

报告截止日:2011年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 本期末 2011年6月30日 | 上年度末 2010年12月31日 |
|---|---|---|
| 资 产: | | |
| 银行存款 | 717,145,336.66 | 437,395,666.46 |
| 结算备付金 | 69,813,024.34 | 21,782,945.13 |
| 存出保证金 | 3,676,991.72 | 4,677,311.84 |
| 交易性金融资产 | 6,490,616,066.25 | 7,582,399,884.95 |
| 其中:股票投资 | 4,833,655,935.55 | 5,886,348,035.75 |
| 基金投资 | - | - |
| 债券投资 | 1,656,960,130.70 | 1,696,051,849.20 |
| 资产支持证券投资 | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - |
| 应收证券清算款 | - | 19,939,097.97 |
| 应收利息 | 23,990,305.48 | 43,633,000.81 |
| 应收股利 | - | - |
| 应收申购款 | 560,947.55 | 1,698,279.78 |
| 递延所得税资产 | - | - |
| 其他资产 | - | - |
| 资产总计 | 7,305,802,672.00 | 8,111,526,186.94 |
| 负债和所有者权益 | 本期末 2011年6月30日 | 上年度末 2010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 | 826,779.09 | 9,858,435.14 |
| 应付赎回款 | 3,806,219.56 | 2,301,750.08 |
| 应付管理人报酬 | 8,688,615.64 | 10,362,523.24 |
| 应付托管费 | 1,448,102.59 | 1,727,087.20 |
| 应付销售服务费 | - | - |
| 应付交易费用 | 4,277,891.36 | 8,629,857.34 |
| 应交税费 | - | - |
| 应付利息 | - | - |
| 应付利润 | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - |
| 其他负债 | 1,136,302.24 | 1,306,610.73 |
| 负债合计 | 20,183,910.48 | 34,186,263.73 |
| 所有者权益: | | |
| 实收基金 | 2,339,282,389.76 | 2,359,280,337.05 |
| 未分配利润 | 4,946,336,371.76 | 5,718,059,586.16 |
| 所有者权益合计 | 7,285,618,761.52 | 8,077,339,923.21 |
| 负债和所有者权益总计 | 7,305,802,672.00 | 8,111,526,186.94 |

注:报告截止日2011年6月30日,基金份额净值0.725元,基金份额总额10,052,796,499.86份。

6.2 利润表

会计主体:华安创新证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 一、收入 | -434,077,536.96 | -1,306,240,115.93 |
| 1.利息收入 | 33,649,063.08 | 37,124,252.26 |
| 其中:存款利息收入 | 2,986,729.01 | 3,669,223.49 |
| 债券利息收入 | 28,387,364.08 | 33,126,232.92 |
| 资产支持证券利息收入 | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | 2,274,969.99 | 328,795.85 |
| 其他利息收入 | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | 309,450,408.74 | 11,230,616.13 |
| 其中:股票投资收益 | 299,406,335.19 | -9,804,985.00 |
| 基金投资收益 | - | - |
| 债券投资收益 | -17,005,655.76 | -80,199.50 |
| 资产支持证券投资收益 | - | - |
| 衍生工具收益 | - | - |
| 股利收益 | 27,049,729.31 | 21,115,800.63 |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | -777,410,079.83 | -1,354,980,977.71 |
| 4.汇兑收益(损失以"-"号填列) | - | - |
| 5.其他收入(损失以"-"号填列) | 233,071.05 | 385,993.39 |
| 减:二、费用 | 87,008,842.04 | 82,348,528.50 |
| 1.管理人报酬 | 56,706,086.18 | 56,968,786.15 |
| 2.托管费 | 9,451,014.37 | 9,494,797.71 |
| 3.销售服务费 | - | - |
| 4.交易费用 | 19,330,838.32 | 15,653,466.28 |
| 5.利息支出 | 1,289,682.87 | - |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | 1,289,682.87 | - |
| 6.其他费用 | 231,220.30 | 231,478.36 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | -521,086,379.00 | -1,388,588,644.43 |
| 减:所得税费用 | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | -521,086,379.00 | -1,388,588,644.43 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安创新证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

单位:人民币元

| 项目 | 本期 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) | 2,359,280,337.05 | 5,718,059,586.16 | 8,077,339,923.21 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -521,086,379.00 | -521,086,379.00 |
| 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) | -19,997,947.29 | -48,559,383.19 | -68,557,330.48 |
| 其中:1.基金申购款 | 113,159,125.74 | 258,111,876.04 | 371,271,001.78 |
| 2.基金赎回款 | -133,157,073.03 | -306,671,259.23 | -439,828,332.26 |
| 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) | - | -202,077,452.21 | -202,077,452.21 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,339,282,389.76 | 4,946,336,371.76 | 7,285,618,761.52 |
| 项目 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010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) | 2,527,152,392.50 | 5,936,837,585.36 | 8,463,989,977.86 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,388,588,644.43 | -1,388,588,644.43 |
| 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) | -44,510,342.97 | -92,597,005.47 | -137,107,348.44 |
| 其中:1.基金申购款 | 51,545,767.99 | 109,958,448.04 | 161,504,216.03 |
| 2.基金赎回款 | -96,056,110.96 | -202,555,453.51 | -298,611,564.47 |
| 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) | - | -216,421,279.79 | -216,421,279.79 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 2,482,642,049.53 | 4,239,230,655.67 | 6,721,872,705.20 |

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:李劲,主管会计工作负责人:李炳旺,会计机构负责人:陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安创新证券投资基金(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[2001]第33号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》信更名为《华安创新证券投资基金基金合同》及起,并于2001年9月21日募集成立。本基金为契约型开放式,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5,000,001,124.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字[2001]第84号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华安创新证券投资基金招募说明书》和《华安创新证券投资基金基金份额拆分公告》的有关规定,本基金于2007年10月26日进行了基金份额拆分,拆分比例为1:4.297369516,并于2007年10月29日进行了份额变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创新证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。本基金的业绩比较基准为中信标普300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。

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2011年08月26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》、《华安创新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2011年上半年度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2011年06月30日的财务状况以及2011年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

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]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、[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 关联方关系

6.4.7.1 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

无。

6.4.7.2 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 | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 交通银行股份有限公司("交通银行") | 基金托管人、基金代销机构 |

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)和上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)和上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)和上年度可比期间(2010年1月1日至2010年6月30日)均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 56,706,086.18 | 56,968,786.15 |
| 其中:支付销售机构的客户维护费 | 6,354,589.73 | 6,193,798.59 |

注:支付基金管理人华安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%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:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 9,451,014.37 | 9,494,797.71 |

注:支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%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:

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

| 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 交通银行 | - | - | 99,000,000.00 | 311,375.34 | - | - |
| 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 交通银行 | 153,905,225.34 | - | - | - | - | - |

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 项目 | 本期 2011年1月1日至2011年6月30日 | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 |
|---|---|---|
| 期初持有的基金份额 | 23,059,300.68 | 22,457,230.17 |
| 期间申购/买入总份额 | 624,913.29 | 602,070.51 |
| 期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减:期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 期末持有的基金份额 | 23,684,213.97 | 23,059,300.68 |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.24% | 0.22% |

注:本期增加份额系红利转再投资。

6.4.8.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末(2011年6月30日)和上年度末(2010年12月31日)均无投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2011年1月1日至2011年6月30日 | | 上年度可比期间 2010年1月1日至2010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 |
| 交通银行 | 717,145,336.66 | 922,605.93 | 379,539,875.29 | 861,201.03 |

注:本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管,按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过"交通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,按约定利率计息。于2011年06月30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(2010年06月30日:同)。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内(2011年1月1日至2011年6月30日)和上年度可比期间内(2010年1月1日至2010年6月30日)均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2011年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末2011年6月30日止,本基金无持有的暂时停牌股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末2011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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2011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。

6.4.10 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 | 4,833,655,935.55 | 66.16 |
| | 其中:股票 | 4,833,655,935.55 | 66.16 |
| 2 | 固定收益投资 | 1,656,960,130.70 | 22.68 |
| | 其中:债券 | 1,656,960,130.70 | 22.68 |
| | 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 | 786,958,361.00 | 10.77 |
| 6 | 其他各项资产 | 28,228,244.75 | 0.39 |
| 7 | 合计 | 7,305,802,672.00 | 100.00 |

7.2 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 | - | - |
| B | 采掘业 | 196,987,356.34 | 2.70 |
| C | 制造业 | 3,768,946,491.89 | 51.73 |
| C0 | 食品、饮料 | - | - |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 168,514,365.39 | 2.31 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 12,408,758.25 | 0.17 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 1,063,492,095.89 | 14.60 |
| C5 | 电子 | 164,050,538.36 | 2.25 |
| C6 | 金属、非金属 | 809,514,681.49 | 11.11 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,416,537,373.80 | 19.44 |
| C8 | 医药、生物制品 | 134,428,678.71 | 1.85 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 197,930,452.61 | 2.72 |
| F | 交通运输、仓储业 | 70,584,609.76 | 0.97 |
| G | 信息技术业 | 425,582,853.75 | 5.84 |
| H | 批发和零售贸易 | 128,066,371.20 | 1.76 |
| I | 金融、保险业 | 13,434,000.00 | 0.18 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 32,123,800.00 | 0.44 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 4,833,655,935.55 | 66.35 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名投资明细

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(%) |
|---