华安宏利股票型证券投资基金

2011 年度 报告摘要

2011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：二〇一二年三月二十九日

§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3月26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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2011年1月1日起至2011年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安宏利股票	
基金主代码	040005	
交易代码	040005（前端）	041005（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月6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	3,735,597,518.43份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益，以及分红所带来的红利收益，实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=中信标普300指数收益率×90%+同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的稳定增值。

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

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	187,051,002.50	398,925,347.93	1,496,935,997.67
本期利润	-2,128,574,788.03	-296,896,403.05	6,205,469,629.63
加权平均基金份额本期利润	-0.5915	-0.0634	1.2273
本期基金份额净值增长率	-22.49%	-1.30%	75.46%
3.1.2 期末数据和指标	**2011年末**	**2010年末**	**2009年末**
期末可供分配基金份额利润	0.5160	0.4483	0.3420
期末基金资产净值	7,546,645,842.67	9,402,282,246.09	14,544,303,777.30
期末基金份额净值	2.0202	2.6064	2.6406

注：1、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。

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加上本期公允价值变动收益。

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
过去三个月	-5.16%	1.21%	-7.91%	1.27%	2.75%	-0.06%
过去六个月	-17.75%	1.17%	-20.59%	1.22%	2.84%	-0.05%
过去一年	-22.49%	1.18%	-23.01%	1.17%	0.52%	0.01%
过去三年	34.24%	1.42%	26.23%	1.50%	8.01%	-0.08%
过去五年	84.46%	1.73%	17.50%	1.93%	66.96%	-0.20%
自基金合同生效起至今	157.80%	1.70%	71.31%	1.89%	86.49%	-0.19%

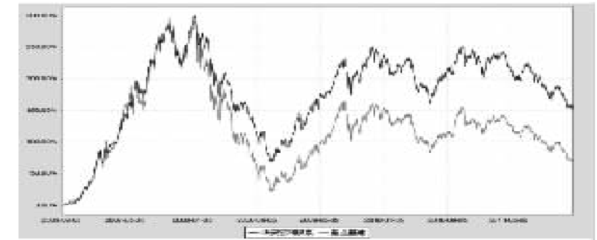
注：本基金的业绩比较基准为：中信标普300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%。

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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%以上。

截至2011年12月31日，本基金股票投资比例为基金资产净值的93.71%，债券的投资比例为基金资产净值的5.15%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的6.29%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

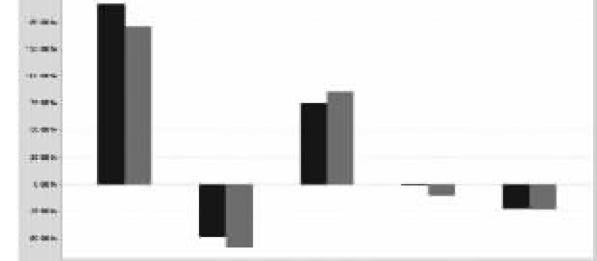
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安宏利股票型证券投资基金
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9月6日至2011年12月31日）



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安宏利股票型证券投资基金
过去五年净值增长率图



3.3过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	-	-	-	-	-
2010年	-	-	-	-	-
2009年	2.300	525,292,822.53	686,942,275.44	1,212,235,097.97	-
合计	2.300	525,292,822.53	686,942,275.44	1,212,235,097.97	-

§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12月31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、华安上证180ETF联接、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、华安动态灵活配置混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安深证300指数（LOF）、华安稳固收益债券、华安可转债债券、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安香港精选股票（QDII）、华安大中华升级股票（QDII）等24只开放式证券投资基金，管理资产规模达到 795.34亿元人民币。

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		
尚志民	本基金的基金经理，首席投资官	2006-09-06	-	15年	工商管理硕士，15年证券、基金从业经验，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，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月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003年9月至今担任安顺证券投资基金的基金经理，2006年9月起同时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《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》、《华安宏利股票型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、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执行情况良好，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，风险管理部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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2011年，A股市场延续2010年的调整行情。全年高溢价和高市盈率发行的新股IPO、定向增发、配股等融资总额超过7000亿元，虽然低于2010年的上万亿元，但整体仍处于历史较高水平，加上全流通的影响，市场供求关系仍受到较大影响，上证指数全年跌幅21.68%，继续位居全球股市跌幅前列。

从行业走势看，呈现全面下跌态势，表现相对较好的是食品饮料、金融服务和采掘业，而电子、有色金属、机械设备等2010年表现较好的板块在2011年跌幅较大。创业板、中小板新股“细分行业龙头”层出不穷，高成长预期和发行市场化造成的高估值，拉高了整体发行市盈率水平，但实际经营业绩上并未有超出主板公司的高增长表现。

本基金在2011年一直保持相对高的仓位运作，在2011年中，市场总体呈现出先小涨后持续大跌的格局。本基金仓位虽然大部分时间内高于85%左右，但在市场单边下跌中保持基准以下的仓位，取得了一定的正贡献。本基金主要超配于机械设备、采掘、交通运输等大盘蓝筹低估值品种上，在小股票和主题投资类股票参与较少，整体取得较好的相对收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2011年12月31日，本基金份额净值为2.0202元，本报告期份额净值增长率为-22.49%，同期业绩比较基准增长率为-23.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从上市公司业绩看，2011年第三季度业绩增速已出现明显下滑，预计11年第四季度和12年第一季度非金融类上市公司净利润同比增速会进一步下滑，业绩风险短期释放，预计二季度后企业盈利将有所回升。

展望2012年，经济增速下滑并且中国经济长期增速系统性下降是确定的，但通胀中枢下移、流动性边际性改善也是确定的，当前A股市场整体估值处于05年998点以来最低水平，股市单边下跌的情况有望结束，本基金将在仓位配置上保持相对积极的态度。

目前中小股票的估值仍大幅高于历史低位，大盘股尤其银行、公用事业、采掘、房地产等拉低了整体估值水平。大小盘股票PE估值两极化趋势明显，创业板和中小板的股票估值有回归的需求，大盘蓝筹的风险释放较为充分，本基金配置上以低估值的大盘蓝筹为主。随着市场流动性的逐步好转，市场估值有望提升，预计下半年上市公司盈利增长也将提高，有望走出较大的上涨行情。

中国经济面临结构转型，靠房地产投资拉动的增长模式难以持续，从调结构和保增长的投资方向中寻找交集，电网、电源、高铁、水利、保障房等的建设等是重点的投资方向。

而消费具有平稳性，2012年虽然名义增速会降低，但由于CPI的下降，预计实际消费增长处于稳中略升的态势，消费的稳定性特征较为明显。由于中国的人口基数庞大、城镇化趋势还将持续若干年，消费类行业仍有较大的投资价值，盈利增长的确定性可以抵御市场估值波动的影响。战略性新兴产业未来五年政府规划投资巨大，未来有较大的成长空间，但需要在其中精选有真正业绩支撑的个股进行投资。

本基金后期的投资思路上，将继续维持对分红率较高、增长稳定、估值较低的大盘蓝筹股票的持仓，布局符合产业政策、有中长期增长潜力的成长股和消费类股票。

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，2011年8月24日离职，离任前华安基金管理有限公司副总裁。

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、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，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，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

本基金的基金经理尚志民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 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师汪棣、金毅签字出具了普华永道中天审字（2012）第20648号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安宏利股票型证券投资基金
报告截止日：2011年12月31日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资 产：		
银行存款	98,493,333.22	129,966,283.78
结算备付金	12,570,922.18	11,183,944.82
存出保证金	1,254,405.74	689,380.89
交易性金融资产	7,460,801,723.85	9,298,845,639.31
其中：股票投资	7,071,982,473.85	8,819,387,329.71
基金投资	-	-
债券投资	388,819,250.00	479,458,309.60
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	-	77,120,996.02
应收利息	6,267,531.05	11,324,503.41
应收股利	-	-
应收申购款	501,002.83	2,164,841.83
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,579,888,918.87	9,531,295,590.06
负债和所有者权益	**本期末 2011年12月31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	12,482,547.71	100,903,852.86
应付赎回款	3,948,799.31	4,655,362.59
应付管理人报酬	9,646,198.41	12,531,652.19
应付托管费	1,607,699.69	2,088,608.69
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,109,282.32	7,621,764.67
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,448,548.76	1,212,102.97
负债合计	33,243,076.20	129,013,343.97
所有者权益：		
实收基金	3,735,597,518.43	3,607,370,468.12
未分配利润	3,811,048,324.24	5,794,911,777.97
所有者权益合计	7,546,645,842.67	9,402,282,246.09
负债和所有者权益总计	7,579,888,918.87	9,531,295,590.06

注：报告截止日2011年12月31日，基金份额净值2.0202元，基金份额总额3,735,597,518.43份。

7.2 利润表

会计主体：华安宏利股票型证券投资基金
本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-1,932,991,806.33	-47,984,705.28
1.利息收入	18,012,905.96	19,593,789.90
其中：存款利息收入	3,699,869.09	4,646,879.45
债券利息收入	14,313,036.87	14,946,910.45
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）	363,476,631.54	623,373,605.92
其中：股票投资收益	268,154,680.07	531,272,241.59
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6,682,898.30	3,851,504.79
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	88,639,053.17	88,249,859.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,315,625,790.53	-695,821,750.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	1,144,446.70	4,869,649.88
减：二、费用	195,582,981.70	248,911,697.77
1.管理人报酬	128,274,637.91	171,893,876.89
2.托管费	21,379,106.33	28,648,979.58
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	45,321,839.26	47,865,051.01
5.利息支出	112,813.75	-
其中：卖出回购金融资产支出	112,813.75	-
6.其他费用	494,584.45	503,790.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,128,574,788.03	-296,896,403.05
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,128,574,788.03	-296,896,403.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安宏利股票型证券投资基金
本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31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）	3,607,370,468.12	5,794,911,777.97	9,402,282,246.09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,128,574,788.03	-2,128,574,788.03
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）	128,227,050.31	144,711,334.30	272,938,384.61
其中：1.基金申购款	983,862,001.46	1,428,557,816.98	2,412,419,818.44
2.基金赎回款	-855,634,951.15	-1,283,846,482.68	-2,139,481,433.83
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）	3,735,597,518.43	3,811,048,324.24	7,546,645,842.67
项目	**上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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）	5,507,885,070.97	9,036,418,706.33	14,544,303,777.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-296,896,403.05	-296,896,403.05
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）	-1,900,514,602.85	-2,944,610,525.31	-4,845,125,128.16
其中：1.基金申购款	970,357,672.47	1,408,317,963.92	2,378,675,636.39
2.基金赎回款	-2,870,872,275.32	-4,352,928,489.23	-7,223,800,764.55
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）	3,607,370,468.12	5,794,911,777.97	9,402,282,246.09

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

华安宏利股票型证券投资基金（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143号《关于同意华安宏利股票型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《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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1,683,963,683.51元，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112号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于2006年9月6日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,684,224,358.17份基金份额，其中认购资金利息折合260,674.66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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%以上。本基金的业绩比较基准为：中信标普300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%。

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3月26日批准报出。

7.4.2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》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3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12月31日的财务状况以及2011年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3差错更正的说明

无。

7.4.6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。

7.4.7关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气（集团）总公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1股票交易

无。

7.4.8.1.2权证交易

无。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	128,274,637.91	171,893,876.89
其中：支付销售机构的客户维护费	11,489,142.58	14,250,084.46

注：1. 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：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,379,106.33	28,648,979.58

注：1. 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0.25%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：日托管费=前一日基金资产净值 ×0.25% / 当年天数。

7.4.8.2.3销售服务费

无。

7.4.8.3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12月31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
中国建设银行	-	9,960,694.40	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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
-	-	-	-	-	-	-

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1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12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	38,437,143.57	38,437,143.57
期间申购/买入总份额	-	-
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	38,437,143.57	38,437,143.57
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.03%	1.07%

7.4.8.4.2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

无。

7.4.8.5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12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31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	98,493,333.22	3,458,660.73	129,966,283.78	4,465,355.75

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。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末（2011年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300275	梅安森	2011-10-27	2012-02-02	网下中签	26.00	34.60	580,000	15,080,000.00	20,068,000.00	-
601100	恒立油缸	2011-10-21	2012-01-30	网下中签	23.00	16.71	1,177,570	27,084,110.00	19,677,194.70	-
002639	雪人股份	2011-11-22	2012-03-05	网下中签	19.80	13.56	800,000	15,840,000.00	10,848,000.00	-
601555	东吴证券	2011-12-06	2012-03-12	网下中签	6.50	6.57	949,660	6,172,790.00	6,239,266.20	-
601336	新华保险	2011-12-09	2012-03-16	网下中签	23.25	27.87	87,441	2,033,003.25	2,436,980.67	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2011-12-30	股权转让	34.09	2012-01-04	34.75	10,000	335,730.83	340,900.00	-

注：本基金截止至2011年12月31日止有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

截至报告期末2011年12月31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。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至报告期末2011年12月31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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii)各层次金融工具公允价值

于2011年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为7,083,158,823.85元，属于第二层级的余额为377,642,900.00元，无属于第三层级的余额（2010年12月31日：第一层级8,843,586,639.31元，第二层级455,259,000.00元，无属于第三层级的余额）。

(iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv)第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具（2010年12月31日：同）。本基金本期净转入/（转出）第三层级零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元（2010年度：无），涉及河南双汇投资发展股份有限公司（“双汇发展”）发行的股票。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	7,071,982,473.85	93.30
	其中：股票	7,071,982,473.85	93.30
2	固定收益投资	388,819,250.00	5.13
	其中：债券	388,819,250.00	5.13
	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	111,064,255.40	1.47
6	其他各项资产	8,022,939.62	0.11
7	合计	7,579,888,918.87	100.00

8.2 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	939,508,749.00	12.45
C	制造业	3,101,988,485.53	41.10
C0	食品、饮料	593,427,283.09	7.86
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	425,889,268.88	5.64
C5	电子	64,500,000.00	0.85
C6	金属、非金属	517,006,800.00	6.85
C7	机械、设备、仪表	1,053,203,138.87	13.96
C8	医药、生物制品	447,961,994.69	5.94
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	95,330,218.25	1.26
E	建筑业	231,848,307.12	3.07
F	交通运输、仓储业	703,462,746.16	9.32
G	信息技术业	94,106,724.62	1.25
H	批发和零售贸易	553,640,531.48	7.34
I	金融、保险业	1,226,985,323.66	16.26
J	房地产业	803,400.00	0.01
K	社会服务业	106,483,581.03	1.41
L	传播与文化产业	303,000.00	0.00
M	综合类	17,521,407.00	0.23
	合计	7,071,982,473.85	93.71

8.3 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	600028	中国石化	73,699,900	529,165,282.00	7.01
2	600036	招商银行	40,488,800	480,602,056.00	6.37
3	600585	海螺水泥	30,000,000	469,500,000.00	6.22
4	600519	贵州茅台	2,159,936	417,515,628.80	5.53
5	601088	中国神华	16,199,900	410,343,467.00	5.44
6	002024	苏宁电器	45,177,717	381,299,931.48	5.05
7	002001	新 和 成	16,099,919	316,524,407.54	4.19
8	601333	广深铁路	89,000,000	313,280,000.00	4.15
9	000001	深发展A	19,999,990	311,799,844.10	4.13
10	600309	烟台万华	21,990,000	283,671,000.00	3.76

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于http://www.huaan.com.cn网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1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	600519	贵州茅台	792,114,806.25	8.42
2	000001	深发展A	599,264,478.43	6.37
3	600036	招商银行	527,376,451.34	5.61
4	601288	农业银行	511,418,169.80	5.44
5	600104	上汽集团	506,059,858.88	5.38
6	600050	中国联通	450,059,062.25	4.79
7	002024	苏宁电器	388,338,917.53	4.13
8	000651	格力电器	388,217,776.31	4.13
9	000983	西山煤电	387,372,250.24	4.12
10	600000	浦发银行	378,157,793.25	4.02
11	600585	海螺水泥	374,740,874.03	3.99
12	600019	宝钢股份	369,159,342.20	3.93
13	601333	广深铁路	359,942,540.33	3.83
14	600028	中国石化	344,244,969.04	3.66
15	600016	民生银行	338,880,917.81	3.60
16	601318	中国平安	331,022,804.90	3.52
17	600153	建发股份	317,038,992.11	3.37
18	600176	中国玻纤	316,244,261.88	3.36
19	600309	烟台万华	304,006,344.02	3.23
20	601186	中国铁建	286,564,460.50	3.05
21	000157	中联重科	259,641,888.00	2.76
22	002073	软控股份	250,669,003.03	2.67
23	600362	江西铜业	243,240,290.43	2.59
24	002123	荣信股份	237,265,110.92	2.52
25	600292	九龙电力	231,800,476.55	2.47
26	600009	上海机场	231,211,451.45	2.46
27	601006	大秦铁路	225,552,216.63	2.40
28	600406	国电南瑞	216,973,633.92	2.31
29	002304	洋河股份	216,430,918.32	2.30
30	601992	金隅股份	210,032,796.88	2.23
31	002038	双鹭药业	209,994,803.05	2.23
32	002001	新 和 成	205,666,591.95	2.19
33	000825	太钢不锈	191,063,229.69	2.03

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。

8.4.2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	601318	中国平安	832,586,907.99	8.86
2	600519	贵州茅台	719,640,678.90	7.65
3	600050	中国联通	627,242,327.79	6.67
4	600000	浦发银行	607,041,369.01	6.46
5	601288	农业银行	505,099,122.01	5.37
6	600016	民生银行	410,292,262.54	4.36
7	600256	广汇股份	409,766,773.66	4.36
8	600036	招商银行	371,673,312.88	3.95
9	002202	金风科技	347,519,115.27	3.70
10	600866	星湖科技	343,337,274.23	3.65
11	601601	中国太保	338,934,097.20	3.60
12	000983	西山煤电	334,382,314.12	3.56
13	601166	兴业银行	309,748,962.40	3.29
14	600019	宝钢股份	307,999,808.16	3.28
15	002024	苏宁电器	305,635,738.89	3.25
16	600309	烟台万华	303,392,065.94	3.23
17	600298	安琪酵母	292,668,522.86	3.11
18	600166	福田汽车	268,860,373.07	2.86
19	600475	华光股份	264,634,273.86	2.81
20	000001	深发展A	257,795,643.04	2.74
21	601186	中国铁建	251,194,863.78	2.67
22	601992	金隅股份	221,327,764.34	2.35
23	002123	荣信股份	210,361,013.79	2.24
24	600406	国电南瑞	201,427,058.35	2.14
25	600362	江西铜业	193,639,433.41	2.06
26	600196	复星医药	192,412,994.66	2.05

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。

8.4.3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	15,062,429,177.73
卖出股票的收入（成交）总额	14,757,847,085.43

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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。

8.5 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	221,533,250.00	2.94
2	央行票据	38,650,000.00	0.51
3	金融债券	128,636,000.00	1.70
	其中：政策性金融债	128,636,000.00	1.70
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	388,819,250.00	5.15

8.6 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	110009	11附息国债09	1,000,000	100,000,000.00	1.33
2	110245	11国开45	800,000	78,656,000.00	1.04
3	110018	11附息国债18	600,000	60,246,000.00	0.80
4	110308	11进出08	500,000	49,980,000.00	0.66
5	090009	09附息国债09	500,000	49,770,000.00	0.66

8.7 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细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	1,254,405.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,267,531.05
5	应收申购款	501,002.83
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,022,939.62

8.9.4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。

8.9.5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流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
209,424	17,837.49	1,412,208,440.81	37.80%	2,323,389,077.62	62.20%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	1,001,484.22	0.03%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年9月6日）基金份额总额	1,684,224,358.17
本报告期期初基金份额总额	3,607,370,468.12
本报告期基金总申购份额	983,862,001.46
减：本报告期基金总赎回份额	855,634,951.15
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,735,597,518.43

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：

(1)2011年8月26日，本基金管理人发布基金行业高级管理人员变更公告，李炳旺副总经理因个人原因辞职。

(2)2011年9月17日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举朱仲群先生、李勍先生为本公司董事，俞妙根先生、陈兵先生不再担任本公司董事。

(3)2011年9月17日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，俞妙根董事长因个人原因辞职，由李勍总经理代任董事长职务。

(4)2011年9月24日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，韩勇副总经理因个人原因辞职。

(5)2011年11月12日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，邵杰军副总经理因个人原因辞职。

(6)2011年12月16日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，朱仲群先生任华安基金管理有限公司董事长。朱仲群先生经中国证监会核准取得高管任职资格。李勍总经理不再代行董事长职务。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

本基金托管人2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可［2011］115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人2011年10月24日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币147,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1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	
广发证券股份有限公司	1	4,424,713,575.19	14.96%	3,761,008.58	15.16%	-
长江证券股份有限公司	1	2,937,647,234.23	9.93%	2,496,995.85	10.06%	-
联讯证券有限责任公司	1	2,519,508,102.55	8.52%	2,141,586.99	8.63%	-
中山证券有限责任公司	1	2,270,149,944.49	7.68%	1,844,507.09	7.43%	-
齐鲁证券有限公司	1	1,945,882,014.83	6.58%	1,581,038.50	6.37%	-
国信证券股份有限公司	1	1,915,452,743.22	6.48%	1,628,140.19	6.56%	-
宏源证券股份有限公司	1	1,807,220,397.80	6.11%	1,468,379.38	5.92%	-
广州证券有限责任公司	1	1,389,503,810.71	4.70%	1,181,077.50	4.76%	-
中国银河证券股份有限公司	1	1,357,782,100.02	4.59%	1,154,115.34	4.65%	-
天风证券有限责任公司	1	1,206,485,628.33	4.08%	1,025,512.23	4.13%	-
国盛证券有限责任公司	1	1,153,562,319.40	3.90%	980,523.08	3.95%	-
申银万国证券股份有限公司	1	1,007,628,504.40	3.41%	818,703.30	3.30%	-
华安证券有限责任公司	1	996,815,921.52	3.37%	847,295.50	3.41%	-
德邦证券有限责任公司	1	921,126,668.35	3.11%	782,954.76	3.16%	-
新时代证券有限责任公司	1	855,489,307.72	2.89%	727,163.59	2.93%	-
财富证券有限责任公司	1	741,926,912.37	2.51%	630,638.89	2.54%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	679,254,451.77	2.30%	551,896.74	2.22%	-
方正证券股份有限公司	1	634,859,293.30	2.15%	515,824.09	2.08%	-
万联证券有限责任公司	1	312,735,356.84	1.06%	265,823.87	1.07%	-
中国国际金融有限公司	1	217,886,204.32	0.74%	185,202.93	0.75%	-
湘财证券有限责任公司	1	186,396,972.67	0.63%	151,447.99	0.61%	-
上海证券有限责任公司	1	89,409,551.38	0.30%	75,997.53	0.31%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 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。

2. 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和合规性进行阐述。

(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。

3.报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(1)新增联讯证券有限责任公司上海交易单元1个；

(2)新增新时代证券有限责任公司上海交易单元1个；

(3)新增天风证券有限责任公司上海交易单元1个；

(4)新增广州证券有限责任公司上海交易单元1个；

(5)新增方正证券股份有限公司深圳交易单元1个；

11.7.2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
广发证券股份有限公司	4,044,717.20	2.79%	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	26,420,810.30	18.21%	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	11,500,000.00	7.93%	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
天风证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券有限责任公司	103,120,941.20	71.08%	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

1、2011年10月28日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2、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。

华安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日