华安升级主题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4月22日（基金合同生效日）起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安升级主题股票
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月22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	1,753,527,924.15份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业,分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用"自上而下"与"自下而上"相结合的主动投资管理策略。即:采取"自上而下"的方式选择行业,挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题; 根据上述"自上而下"策略选择行业的基础上,采取"自下而上"的方法,运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中的高风险投资品种。

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、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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日
本期已实现收益	-144,001,207.19
本期利润	-343,756,172.44
加权平均基金份额本期利润	-0.1379
本期基金份额净值增长率	-18.90%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1891
期末基金资产净值	1,422,014,855.78
期末基金份额净值	0.811

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）。

4)本基金于2011年4月22日成立,截至本报告期末,本基金成立未满一年。

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	-6.78%	1.27%	-6.65%	1.12%	-0.13%	0.15%
过去六个月	-18.98%	1.16%	-17.76%	1.09%	-1.22%	0.07%
自基金合同生效起至今	-18.90%	1.09%	-22.98%	1.04%	4.08%	0.05%

注:1) 本基金于2011年4月22日成立,截至本报告期末,本基金成立未满一年。

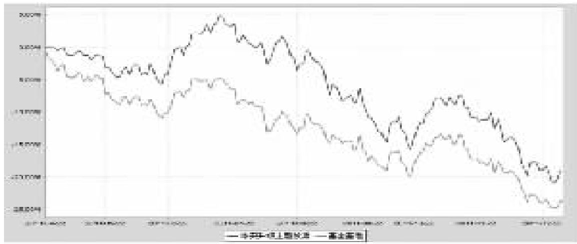
2) 本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

3) 根据基金合同的规定:本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括A股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%~95%,其中投资于战略性新兴行业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的80%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为5~40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为0~3%;现金或者到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。

截至2011年12月31日,本基金股票资产占基金资产净值的88.88%,其中投资于战略性新兴行业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例为股票投资99.66%;债券等固定收益类资产占基金资产的5.77%;权证的投资比例为0;现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的10.71%。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

华安升级主题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
（2011年4月22日至2011年12月31日）

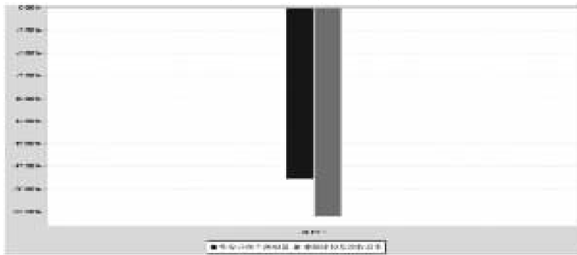


注:1)本基金于2011年4月22日成立,截止本报告期末,本基金成立未满一年。

2)根据《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》规定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。截至本报告期末,本基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分"基金的投资"中投资范围、投资限制等有关约定。

3.2.3 自基金合同生效以来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

华安升级主题股票型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图



注:本基金基金合同生效日为2011年4月22日,合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§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		
陈俏宇	本基金的基金经理	2011-04-22	-	16年	工商管理硕士,中国注册会计师协会非执业会员,16年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、安顺证券投资基金和华安宏利基金经理助理,2007年3月至2008年2月担任安顺证券投资基金、华安宏利基金经理,2008年2月起担任安信证券投资基金的基金经理,2008年10月起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。2011年4月起同时担任本基金的基金经理。

注: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。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《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》、《华安升级主题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、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行良好,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

按照本基金的基金合同规定,本基金的投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前,华安旗下基金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

2011年没有出现异常交易。

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年市场在国内宏观调控与海外债务危机的双重影响下呈现震荡下跌的走势,尽管全年出现了几次阶段性反弹,但总体上缺乏系统性的投资机会,全年来看,流动性紧缩带来的估值下移成为个股下跌主导性因素。风格上,前一年结构性行情中表现最弱的权重股在2011年取得了很高的相对收益。本基金由于更为偏重投资于具有转型升级背景的行业,对权重股配置不足,整体表现不够理想。

建仓初期本基金考虑到市场潜在的风险,以低估值蓝筹为主要配置方向,市场调整以后开始逐步转向长期看好的稳定增长类个股,包括代表新经济方向的信息技术、生物医药以及食品饮料板块。其中的主要配置基本始终保持,获得一定超额收益。进入下半年以后,由于欧债问题以及国内动车事故爆发,市场在开启一轮快速反弹后再次进入下降趋势,本基金在仓位调整上准备有所不足,影响了业绩表现。

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0.811元,成立以来份额净值增长率为-18.90%,同期上证综指下跌26.94%,深圳成指下跌29.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2012年,本基金认为地产调控持续以及通胀对消费的影响仍将在较长时期内压制整体经济表现,出口是否复苏取决于国内外多方面因素,判断难度较大。但另一方面,管理层对股市和经济的态度都开始有所调整,股市本身对经济收缩也隐含了较为充分的预期。综合来看,预计全年的市场表现可能有较大反复,本基金将尽可能捕捉市场超跌带来的投资机会,同时也随时关注宏观经济是否有预期之外的风险。

基于以上看法,本基金在操作中仍将坚持既定的投资策略,即优选符合新经济方向的信息技术、泛消费类个股,用成长性来抵消估值下移或系统性风险的出现。这一点,2011年的市场上已经不乏类似案例。对于传统周期性行业的投资,我们将继续立足于审慎的基本面分析,在严格控制风险的前提下参与阶段性投资,以便尽可能提升本基金的超额收益水平。

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

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20655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:华安升级主题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
资 产:	
银行存款	71,975,682.90
结算备付金	4,225,302.90
存出保证金	252,173.83
交易性金融资产	1,346,002,008.28
其中:股票投资	1,263,905,894.68
基金投资	-
债券投资	82,096,113.60
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	3,001,988.74
应收利息	373,933.22
应收股利	-
应收申购款	67,327.53
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	1,425,898,417.40
负债和所有者权益	本期末 2011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	-
应付赎回款	877,685.61
应付管理人报酬	1,883,797.33
应付托管费	313,966.23
应付销售服务费	-
应付交易费用	441,804.61
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	366,307.84
负债合计	3,883,561.62
所有者权益:	
实收基金	1,753,527,924.15
未分配利润	-331,513,068.37
所有者权益合计	1,422,014,855.78
负债和所有者权益总计	1,425,898,417.40

注:1)报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.811元,基金份额总额1,753,527,924.15份。

2)本财务报表的实际编制期间为2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华安升级主题股票型证券投资基金

本报告期:2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入	-305,600,563.92
1.利息收入	8,358,066.36
其中:存款利息收入	1,827,420.73
债券利息收入	833,271.13
资产支持证券利息收入	-
买入返售金融资产收入	5,697,374.50
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	-117,223,889.67
其中:股票投资收益	-142,564,463.55
基金投资收益	-
债券投资收益	51,491.96
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	25,289,081.92
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	-199,754,965.25
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	3,020,224.64
减:二、费用	38,155,608.52
1.管理人报酬	24,620,298.28
2.托管费	4,103,383.14
3.销售服务费	-
4.交易费用	9,047,520.29
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	384,406.81
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	-343,756,172.44
减:所得税费用	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）	-343,756,172.44

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体:华安升级主题股票型证券投资基金

本报告期:2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年4月22日（基金合同生效日）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）	4,119,090,620.47	-	4,119,090,620.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-343,756,172.44	-343,756,172.44
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）	-2,365,562,696.32	12,243,104.07	-2,353,319,592.25
其中:1.基金申购款	64,212,124.73	-1,349,118.97	62,863,005.76
2.基金赎回款	-2,429,774,821.05	13,592,223.04	-2,416,182,598.01
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）	1,753,527,924.15	-331,513,068.37	1,422,014,855.78

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

华安升级主题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"）证监许可[2011]317号《关于核准华安升级主题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《华安升级主题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4,118,599,416.41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（2011）第134号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》于2011年4月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为4,119,090,620.47份基金份额,其中认购资金利息折合491,204.06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（以下简称"中国建设银行"）。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产的投资比例占基金资产的60%-95%,其中投资于战略性新兴行业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的80%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券的投资比例占基金资产的5%-40%;权证的投资比例占基金资产净值的0%-3%;现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

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》、《华安升级主题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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31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2011年12月31日的财务状况以及2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

（2）金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值:

（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

（2）存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

（3）当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分（包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等）为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分后的余额）。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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（"华安基金"）	基金管理人、基金注册登记机构、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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,620,298.28
其中:支付销售机构的客户维护费	11,479,805.92

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 X 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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,103,383.14

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0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

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

无。

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

无。

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4月22日（基金合同生效日）至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	71,975,682.90	1,646,733.40

注:本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管,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

无。

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	11/12/30	重大资产重组	34.09	12/01/04	34.75	460,000	15,281,596.98	15,681,400.00	

注:本基金截至2011年12月31日止持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1,253,016,608.28元,属于第二层级的余额为92,985,400.00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

无。

（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	1,263,905,894.68	88.64
	其中:股票	1,263,905,894.68	88.64
2	固定收益投资	82,096,113.60	5.76
	其中:债券	82,096,113.60	5.76
	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	76,200,985.80	5.34
6	其他各项资产	3,695,423.32	0.26
7	合计	1,425,898,417.40	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	15,198,000.00	1.07
C	制造业	1,007,816,431.20	70.87
C0	食品、饮料	171,652,814.00	12.07
C1	纺织、服装、皮毛	8,164,200.00	0.57
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	165,447,585.72	11.63
C5	电子	53,554,000.00	3.77
C6	金属、非金属	27,857,000.00	1.96
C7	机械、设备、仪表	321,139,273.98	22.58
C8	医药、生物制品	260,001,557.50	18.28
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	107,236,541.69	7.54
H	批发和零售贸易	2,633,954.00	0.19
I	金融、保险业	126,665,567.79	8.91
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	4,355,400.00	0.31
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,263,905,894.68	88.88

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	000858	五粮液	2,800,000	91,840,000.00	6.46
2	600741	华域汽车	7,729,848	71,578,392.48	5.03
3	002250	联化科技	3,553,099	67,082,509.12	4.72
4	000423	东阿阿胶	1,557,000	66,873,150.00	4.70
5	600016	民生银行	11,182,442	65,864,583.38	4.63
6	002450	康得新	2,832,030	64,343,721.60	4.52
7	000001	深发展A	3,899,999	60,800,984.41	4.28
8	002038	双鹭药业	1,780,000	58,473,000.00	4.11
9	600887	伊利股份	2,550,000	52,096,500.00	3.66
10	600104	上海汽车	3,390,000	47,934,600.00	3.37

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	220,547,956.29	15.51
2	600016	民生银行	215,383,598.30	15.15
3	601088	中国神华	176,708,829.40	12.43
4	600970	中材国际	139,322,031.83	9.80
5	600104	上汽集团	135,194,722.21	9.51
6	600000	浦发银行	130,991,176.14	9.21
7	600036	招商银行	118,841,602.56	8.36
8	002001	新和成	117,186,025.32	8.24
9	002024	苏宁电器	104,387,634.51	7.34
10	000063	中兴通讯	102,099,025.79	7.18
11	600009	上海机场	97,178,502.17	6.83
12	000858	五粮液	94,870,803.99	6.67
13	600028	中国石化	84,567,702.56	5.95
14	600741	华域汽车	82,578,022.37	5.81
15	002250	联化科技	79,611,994.78	5.60
16	000001	深发展A	78,782,522.87	5.54
17	600518	康美药业	78,111,394.01	5.49
18	000039	中集集团	77,952,150.56	5.48
19	600316	洪都航空	71,221,571.60	5.01
20	000423	东阿阿胶	70,533,449.97	4.96
21	000651	格力电器	70,424,021.53	4.95
22	000568	泸州老窖	69,650,362.86	4.90
23	002450	康得新	67,946,514.56	4.78
24	002038	双鹭药业	67,696,022.68	4.76
25	002073	软控股份	64,901,511.62	4.56
26	000157	中联重科	63,499,171.52	4.47
27	600406	国电南瑞	62,691,048.77	4.41
28	002152	广电运通	62,240,359.29	4.38
29	600050	中国联通	61,990,036.46	4.36
30	000778	新兴铸管	61,409,141.38	4.32
31	600176	中国玻纤	55,217,836.38	3.88
32	600153	建发股份	52,088,692.50	3.66
33	600887	伊利股份	49,504,141.49	3.48
34	002007	华兰生物	47,053,615.82	3.31
35	600261	阳光照明	44,450,792.09	3.13
36	002008	大族激光	43,067,264.41	3.03
37	600292	九龙电力	40,712,011.85	2.86
38	600570	恒生电子	36,579,013.78	2.57
39	600252	中恒集团	35,056,423.83	2.47
40	002037	久联发展	33,694,667.75	2.37
41	300182	捷成股份	29,746,814.40	2.09

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600585	海螺水泥	163,990,713.18	11.53
2	601088	中国神华	162,805,816.58	11.45
3	600016	民生银行	137,737,673.35	9.69
4	600000	浦发银行	116,597,598.38	8.20
5	600970	中材国际	111,086,749.98	7.81
6	600036	招商银行	107,483,745.70	7.56
7	002024	苏宁电器	102,145,373.31	7.18
8	000063	中兴通讯	99,491,449.63	7.00
9	600009	上海机场	90,870,977.33	6.39
10	600028	中国石化	81,854,987.78	5.76
11	000651	格力电器	75,025,082.34	5.28
12	600104	上汽集团	74,204,653.51	5.22
13	000039	中集集团	67,740,954.27	4.76
14	000568	泸州老窖	64,598,271.51	4.54
15	000157	中联重科	63,376,319.50	4.46
16	600050	中国联通	62,441,132.60	4.39
17	000778	新兴铸管	61,072,888.69	4.29
18	600518	康美药业	54,094,160.21	3.80
19	002001	新和成	53,394,478.57	3.75
20	600153	建发股份	51,805,347.84	3.64
21	600176	中国玻纤	51,408,388.03	3.62
22	600292	九龙电力	42,717,283.85	3.00
23	002007	华兰生物	39,731,977.36	2.79
24	600406	国电南瑞	38,140,042.09	2.68
25	300182	捷成股份	33,893,791.30	2.38
26	002008	大族激光	30,085,979.67	2.12

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	4,039,610,687.23
卖出股票的收入（成交）总额	2,433,597,707.98

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	-	-
2	央行票据	77,304,000.00	5.44
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	4,792,113.60	0.34
8	其他	-	-
9	合计	82,096,113.60	5.77

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	1101088	11央票88	800,000	77,304,000.00	5.44
2	113001	中行转债	30,000	2,837,400.00	0.20
3	110016	川投转债	21,210	1,954,713.60	0.14

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 2011年5月27日,五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。报告期内,基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	252,173.83
2	应收证券清算款	3,001,988.74
3	应收股利	-
4	应收利息	373,933.22
5	应收申购款	67,327.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,695,423.32

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	2,837,400.00	0.20
2	110016	川投转债	1,954,713.60	0.14

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
30,827	56,882.86	138,879,404.80	7.92%	1,614,648,519.35	92.08%

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	1,685,781.47	0.096%

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日（2011年4月22日）基金份额总额	4,119,090,620.47
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	64,212,124.73
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,429,774,821.05
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,753,527,924.15

注:总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本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、基金管理人的专门基金托管部门的重大人事变动:

2011年8月26日,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。

2011年9月17日,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。

2011年9月17日,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。

2011年9月24日,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。

2011年11月12日,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。

2011年12月16日,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、基金托管人的专门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

本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93,000.00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

本报告期内无管理人、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	
宏源证券股份有限公司	1	1,377,690,886.92	21.28%	1,119,377.49	20.73%	-
新时代证券有限责任公司	1	1,126,884,964.05	17.41%	957,849.85	17.74%	-
上海证券有限责任公司	1	1,122,794,777.13	17.35%	954,374.08	17.68%	-
中山证券有限责任公司	1	600,942,643.53	9.28%	488,267.25	9.04%	-
联讯证券有限责任公司	1	430,711,534.18	6.65%	366,105.94	6.78%	-
财富证券有限责任公司	1	381,801,196.91	5.90%	324,530.02	6.01%	-
齐鲁证券有限公司	1	278,428,759.24	4.30%	226,228.31	4.19%	-
兴业证券股份有限公司	1	250,458,591.30	3.87%	212,889.04	3.94%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	190,747,135.93	2.95%	154,982.68	2.87%	-
申银万国证券股份有限公司	1	188,016,062.99	2.90%	152,764.05	2.83%	-
长江证券股份有限公司	1	140,182,092.75	2.17%	119,154.40	2.21%	-
天风证券有限责任公司	1	136,442,764.73	2.11%	115,975.49	2.15%	-
方正证券股份有限公司	1	115,834,004.62	1.79%	94,115.44	1.74%	-
广州证券有限责任公司	1	51,614,906.10	0.80%	43,872.64	0.81%	-
广发证券股份有限公司	1	46,071,384.02	0.71%	39,160.57	0.73%	-
国盛证券有限责任公司	1	25,823,103.51	0.40%	21,949.42	0.41%	-
万联证券有限责任公司	1	8,744,087.30	0.14%	7,432.51	0.14%	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	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
宏源证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券有限责任公司	-	-	6,281,100,000.00	34.18%	-	-
上海证券有限责任公司	144,984.71	2.89%	2,277,700,000.00	12.39%	-	-
中山证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	-	-	3,600,000,000.00	19.59%	-	-
财富证券有限责任公司	-	-	820,000,000.00	4.46%	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	2,051,087.85	40.85%	3,920,000,000.00	21.33%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	-	-	656,100,000.00	3.57%	-	-
天风证券有限责任公司	-	-	150,500,000.00	0.82%	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	391,000,000.00	2.13%	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	281,200,000.00	1.53%	-	-
万联证券有限责任公司	2,824,500.00	56.26%	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

§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