华安大中华升级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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年3月20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5月17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	华安大中华升级股票（QDII）
基金主代码	040021
交易代码	040021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年5月17日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	113,671,624.72份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。
投资策略	本基金以价值和成长投资理念为导向，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。 行业层面以经济升级受益作为行业配置和个股挖掘的主要线索。通过对于经济结构调整的跟踪和研究，以及对于地区资源禀赋比较，对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期，选择优势行业作为主要投资目标。 个股方面通过对大中华地区的股票基本面的分析和研究，考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘受益于中国地区经济升级，并具备中长期持续增长或阶段性高速成长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准是MSCI金龙净总收益指数（MSCI Golden Dragon Net Total Return Index）
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、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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	唐州徽
	联系电话	021-38969999	010-66594855
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		4008850099	95566
传真		021-68863414	010-66594942

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	Bank of China (Hong Kong) Limited
	中文	中国银行（香港）有限公司
注册地址		香港花园道1号中银大厦
办公地址		香港花园道1号中银大厦
邮政编码		–

2.5 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5月17日（基金合同生效日）至2011年12月31日
本期已实现收益	-6,465,900.03
本期利润	-24,017,600.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1333
本期基金份额净值增长率	-20.20%
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	-0.2024
期末基金资产净值	90,664,672.69
期末基金份额净值	0.798

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5月17日成立。合同生效当期不是完整报告期。

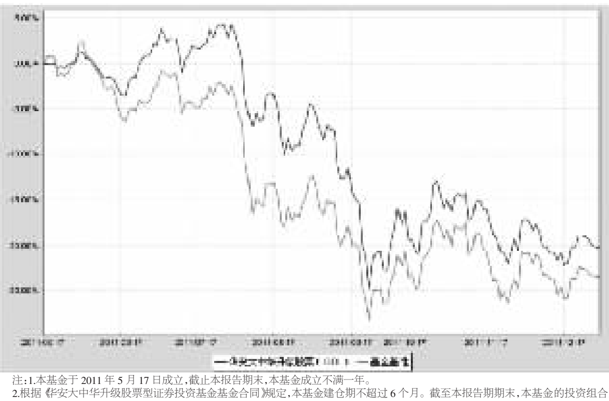
3.2 基金净值表现

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3个月	3.10%	1.70%	3.97%	1.83%	-0.87%	-0.13%
过去6个月	-21.92%	1.74%	-21.34%	1.85%	-0.58%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-20.20%	1.59%	-23.41%	1.71%	3.21%	-0.12%

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

华安大中华升级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5月17日至2011年12月31日）

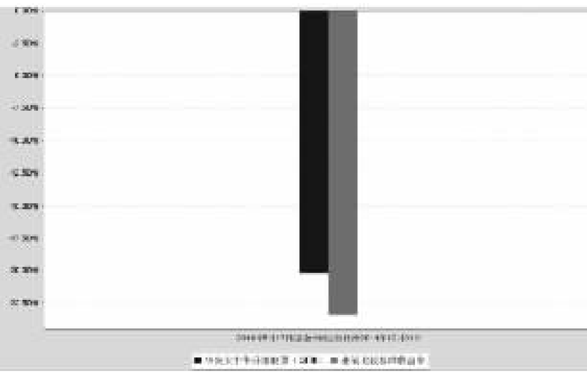


注：1.本基金于2011年5月17日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2.根据《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期不超过6个月。截至本报告期期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十四部分“基金的投资”中投资范围、投资限制的有关约定。

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

华安大中华升级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：本基金于2011年5月17日成立，合同生效当年按实际存续期计算，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5月17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		
翁启森	本基金的基金经理，全球投资部总监	2011-05-17	–	15年	工业工程学硕士，15年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。曾在台湾JP证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008年4月加入华安基金管理有限公司，任全球投资部副总经理。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5月起同时担任本基金的基金经理。
苏圻涵	本基金的基金经理	2011-05-17	–	7年	博士研究生，7年证券、基金从业经历，持有基金从业执业证书。2004年6月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。2010年9月起担任华安香港精选股票型证券投资基金的基金经理。2011年5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《大中华升级股票型证券投资基金基金合同》、《大中华升级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

本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异，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

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年下半年，全球资金由高低风险资产向低风险资产流转，欧洲危机导致的避险情绪，成为主导2011年全球资本市场的主线。风险资产和避险资产走势出现显著差异。高风险资产，包括大宗商品、股票、公司债券等均出现显著下跌，避险资产，美国国债收益率一举突破2%的历史低位。

全球股票市场表现出现分化，在美国经济复苏、资金回流避险货币的推动下，发达市场明显跑赢新兴市场。美元期内表现强势，资金有流出新兴市场的迹象。同时由于对中国紧缩政策不确定性，和台湾选举结果不确定性的担忧，香港、台湾市场表现远远落后于发达市场。行业方面，非周期性行业明显跑赢周期性行业，电信、公用事业领先大市。

报告期内，基金于6月末完成建仓，在欧债危机和国内经济下行趋势的市场环境中，我们较早的转向了防御性行业，包括泛消费行业、医疗、电信等，低配银行、地产、原材料等周期性行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为0.798元，净值增长率为-20.20%，同期比较基准收益率为-23.41%，基金净值跑赢比较基准3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为美国经济在激进的货币政策的推动下，有望持续复苏，欧洲经济在财政紧缩和银行去杠杆的双重压力下，陷入衰退的机率较大，而中国经济基于政策放松力度的不确定，目前来看，存在较大的不确定性。

对于2012年上半年的港股市场，我们认为在外围经济复苏，欧债违约风险负面影响下降，中国经济“硬着落”预期消退的情况下，港股市场估值进一步下调的可能性不大，市场再次破前期低点的可能不大。而对于台湾市场，基于美国经济复苏的观点，预期电子行业景气在一季度能够落底，我们对于今年的台湾消费电子产业链较为乐观。

我们认为在经济走势不确定性较大的环境下，回归基本面，通过寻找在经济下行周期中，盈利确定性高的个股，将能够获取超额收益。我们将重点关注，节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造产业，新能源、新材料、新能源汽车等七大新兴支柱产业，寻求政策不确定性环境下，政策支持和扶植确定的行业与公司。在“美国复苏、欧洲熄火、中国减速”的大环境下，美国经济复苏对我国相关产业，包括家具、纺织、消费电子的拉动，值得关注。移动互联网趋势的发展，苹果、三星等厂家今年积极的智能终端排产计划，以及Win8在年中推出带来的PC产业的更新，将对台湾产业链关键企业的营收产生积极影响。我们计划对于上述产业链中，具有技术优势的企业进行发掘。

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，担任公司发展部宏观研究员，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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安大中华升级股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§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20656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：华安大中华升级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	14,716,296.31
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	75,525,683.43
其中：股票投资	75,525,683.43
基金投资	–
债券投资	–
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	989,404.25
应收利息	174.17
应收股利	–
应收申购款	27,830.78
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	91,259,388.94
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	147,103.07
应付管理人报酬	116,715.63
应付托管费	23,343.15
应付销售服务费	–
应付交易费用	–
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	307,554.40
负债合计	594,716.25
所有者权益：	
实收基金	113,671,624.72
未分配利润	-23,006,952.03
所有者权益合计	90,664,672.69
负债和所有者权益总计	91,259,388.94

注：1.报告截止日2011年12月31日，基金份额净值0.798元，基金份额总额113,671,624.72份。

2.本基金于2011年5月17日成立。合同生效当期不是完整报告期。

7.2 利润表

会计主体：华安大中华升级股票型证券投资基金

本报告期：2011年5月17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5月17日（基金合同生效日）至2011年12月31日
一、收入	-21,069,481.20
1.利息收入	582,004.84
其中：存款利息收入	294,348.47
债券利息收入	–
资产支持证券利息收入	–
买入返售金融资产收入	287,656.37
其他利息收入	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	-2,176,437.12
其中：股票投资收益	-3,685,275.68
基金投资收益	–
债券投资收益	–
资产支持证券投资收益	–
衍生工具收益	265,377.52
股利收益	1,243,461.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-17,551,699.98
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-2,327,246.47
5.其他收入（损失以“-”号填列）	403,897.53
减：二、费用	2,948,118.81
1.管理人报酬	1,576,135.54
2.托管费	315,227.18
3.销售服务费	–
4.交易费用	698,898.56
5.利息支出	–
其中：卖出回购金融资产支出	–
6.其他费用	357,857.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-24,017,600.01
减：所得税费用	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列	-24,017,600.01

注：本基金于2011年5月17日成立。合同生效当期不是完整报告期。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安大中华升级股票型证券投资基金

本报告期：2011年5月17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5月17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）	434,578,142.49	–	434,578,142.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-24,017,600.01	-24,017,600.01
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）	-320,906,517.77	1,010,647.98	-319,895,869.79
其中：1.基金申购款	3,414,907.70	-383,211.09	3,031,696.61
2.基金赎回款	-324,321,425.47	1,393,859.07	-322,927,566.40
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）	113,671,624.72	-23,006,952.03	90,664,672.69

注：本基金于2011年5月17日成立。合同生效当期不是完整报告期。

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从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

华安大中华升级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］第328号《关于核准华安大中华升级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《华安大中华升级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434,522,995.91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178号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》于2011年5月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为434,578,142.49份基金份额，其中认购资金利息折合55,146.58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，基金托管人为中国银行股份有限公司，境外资产托管人为中国银行（香港）有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金投资范围为大中华地区企业，包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场（如香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场）发行的股票、存托凭证及其他衍生产品等；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于东亚及东盟区域市场，包括韩国、印尼、马来西亚、菲律宾、泰国等证券市场交易的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等；投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：股票资产不低于基金资产的60%，其中不低于85%的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业，不高于15%的股票资产投资于东亚及东盟区域市场；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准为：MSCI金龙净总收益指数。

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》、《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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5月17日（基金合同生效日）至2011年12月31日止期间的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5月17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5月17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、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。

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股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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；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。本基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，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）。具体收益分配政策请参见本基金合同的相关章节。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 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。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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［2008］1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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）目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

（3）目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

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（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
中国银行（香港）有限公司（“中银香港”）	境外资产托管人
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5月17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	1,576,135.54
其中：支付销售机构的客户维护费	621,197.35

注：支付基金管理人 华安基金公司 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5月17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	315,227.18

注：支付基金托管人 中国银行 的托管费按前一日基金资产净值0.3%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×0.3%／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

份额单位：份

项目	本期 2011年5月17日（基金合同生效日）至2011年12月31日
基金合同生效日（2011年5月17日）持有的基金份额	14,999,000.00
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	14,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	13.2%

注：本基金的基金管理人华安基金公司在本会计期间认购本基金的交易委托申银万国证券股份有限公司办理，适用费率为1,000元/笔。

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5月17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
中国银行	679,454.87	282,657.38
中银香港	14,036,841.44	13.01

注：1. 本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率或约定利率计息。

2. 本基金本期由基金托管人中国银行保管的银行存款当期产生的利息收入中包含银行定期存款利息收入235,083.33元。

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

无。

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

无。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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75,525,683.43元，无属于第二层级和第三层级的余额。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

（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	75,525,683.43	82.76
	其中：普通股	75,525,683.43	82.76
	存托凭证	–	–
2	基金投资	–	–
3	固定收益投资	–	–
	其中：债券	–	–
	资产支持证券	–	–
4	金融衍生品投资	–	–
	其中：远期	–	–
	期货	–	–
	期权	–	–
	权证	–	–
5	买入返售金融资产	–	–
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	–	–
6	货币市场工具	–	–
7	银行存款和结算备付金合计	14,716,296.31	16.13
8	其他各项资产	1,017,409.20	1.11
9	合计	91,259,388.94	100.00

8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
中国香港	59,797,930.85	65.96
中国台湾	15,727,752.58	17.35
合计	75,525,683.43	83.30

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
金融	20,242,247.84	22.33
非必需消费品	15,700,405.33	17.32
必需消费品	14,565,454.70	16.07
信息技术	8,493,295.53	9.37
保健	6,616,176.21	7.30
电信服务	5,139,870.43	5.67
能源	3,320,229.96	3.66
工业	822,001.16	0.91
材料	626,002.27	0.69
合计	75,525,683.43	83.30

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称（中文）	证券代码	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	1044 HK	香港	中国香港	64,500	3,798,879.40	4.19
2	Belle International Holdings Limited	百丽国际控股有限公司	1880 HK	香港	中国香港	318,000	3,490,647.20	3.85
3	First Financial Holding Co Ltd	第一金融控股股份有限公司	2892 TT	台湾	中国台湾	776,378	2,867,676.39	3.16
4	Far East Horizon Ltd.	远东宏信有限公司	3360 HK	香港	中国香港	479,000	2,691,094.33	2.97
5	Want Want China Holdings Limited	中国旺旺控股有限公司	151 HK	香港	中国香港	422,000	2,651,394.35	2.92
6	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	728 HK	香港	中国香港	732,000	2,622,971.21	2.89
7	PICC Property and Casualty Company Limited.	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	香港	中国香港	296,600	2,524,763.01	2.78
8	China Unicom (Hong Kong) Limited	中国联合网络通信（香港）股份有限公司	762 HK	香港	中国香港	190,000	2,516,899.22	2.78
9	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港	中国香港	283,000	2,418,172.17	2.67
10	TPK Holding Co Ltd	宸鸿光电科技股份有限公司	3673 TT	台湾	中国台湾	29,400	2,413,531.11	2.66

注：1.所用证券代码采用彭博代码。

2.投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于www.huaan.com.cn网站的年度报告正文。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd	2601 HK	12,600,376.81	13.90
2	I.T Ltd.	999 HK	12,392,077.27	13.67
3	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	11,974,417.80	13.21
4	AJISEN (CHINA) HOLDINGS LIMITED	538 HK	11,769,028.16	12.98
5	Anhui Conch Cement Company Limited	914 HK	11,102,737.13	12.25
6	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	11,061,431.35	12.20
7	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	11,025,817.50	12.16
8	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LIMITED	3308 HK	10,877,106.10	12.00
9	Far East Horizon Ltd.	3360 HK	10,817,344.61	11.93
10	INTERNATIONAL MINING MACHINERY HOLDINGS LIMITED	1683 HK	10,743,560.45	11.85
11	Luk Fook Holdings (International) Limited	590 HK	9,276,039.98	10.23
12	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	7,767,986.26	8.57
13	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	322 HK	7,146,253.31	7.88
14	PICC Property and Casualty Company Limited.	2328 HK	6,994,467.51	7.71
15	Belle International Holdings Limited	1880 HK	6,651,188.39	7.34
16	Kunlun Energy Company Limited	135 HK	6,595,825.20	7.27
17	Chow Sang Sang Holdings International Limited	116 HK	6,549,456.24	7.22
18	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	6,339,598.31	6.99
19	China Merchants Bank Co.,Limited	3968 HK	6,201,729.47	6.84
20	TPK Holding Co Ltd	3673 TT	5,575,619.68	6.15
21	First Financial Holding Co Ltd	2892 TT	4,532,519.92	5.00
22	Credit China Holdings Limited	8207 HK	4,488,933.94	4.95
23	Largan Precision Co.,Ltd.	3008 TT	4,358,005.52	4.81
24	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	4,355,515.26	4.80
25	XINGDA INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	1899 HK	4,330,287.92	4.78
26	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	4,327,064.20	4.77
27	Hengan International Group Company Limited	1044 HK	3,561,859.53	3.93
28	Chinatrust Financial Holding Co.	2891 TT	3,310,237.50	3.65
29	Want Want China Holdings Limited	151 HK	3,262,855.51	3.60
30	China Telecom Corporation Limited	728 HK	3,214,575.64	3.55
31	CATCHER TECHNOLOGY CO., LTD.	2474 TT	2,706,659.52	2.99
32	Wei Chuan Food Corp	1201 TT	2,534,234.53	2.80
33	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	2,423,077.28	2.67
34	Sinopharm Group Co., Ltd.	1099 HK	2,262,979.37	2.50
35	NVC LIGHTING HOLDING LIMITED	2222 HK	2,172,434.28	2.40
36	HTC Corporation	2498 TT	2,153,510.28	2.38
37	Tianneng Power International Limited	819 HK	2,052,163.39	2.26
38	Sino Biopharmaceutical Limited	1177 HK	1,993,518.10	2.20
39	Capella Microsystems (Taiwan) Inc.	3582 TT	1,986,806.08	2.19
40	Chaowei Power Holdings Limited	951 HK	1,826,040.32	2.01

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。

8.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	I.T Ltd.	999 HK	11,188,899.07	12.34
2	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	10,653,932.16	11.75
3	Luk Fook Holdings (International) Limited	590 HK	10,466,964.93	11.54
4	Anhui Conch Cement Company Limited	914 HK	10,460,335.14	11.54
5	INTERNATIONAL MINING MACHINERY HOLDINGS LIMITED	1683 HK	9,618,757.51	10.61
6	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	9,282,086.75	10.24
7	Industrial and Commercial Bank of China Limited	1398 HK	9,105,832.53	10.04
8	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd	2601 HK	9,090,096.22	10.03
9	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LIMITED	3308 HK	9,052,818.04	9.98
10	AJISEN (CHINA) HOLDINGS LIMITED	538 HK	7,891,399.60	8.70
11	Chow Sang Sang Holdings International Limited	116 HK	7,409,156.83	8.17
12	Far East Horizon Ltd.	3360 HK	6,963,300.77	7.68
13	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	5,491,236.78	6.06
14	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	322 HK	5,169,860.29	5.70
15	PICC Property and Casualty Company Limited.	2328 HK	4,901,094.48	5.41
16	Kunlun Energy Company Limited	135 HK	4,832,902.98	5.33
17	China Merchants Bank Co.,Limited	3968 HK	4,772,855.45	5.26
18	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	4,346,797.02	4.79
19	XINGDA INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	1899 HK	3,591,746.15	3.96
20	Belle International Holdings Limited	1880 HK	2,729,516.74	3.01
21	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	2,206,120.14	2.43
22	Credit China Holdings Limited	8207 HK	2,164,065.18	2.39
23	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	1,900,924.79	2.10

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。

8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	256,318,041.52
卖出收入（成交）总额	159,555,382.43

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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，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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	–
2	应收证券清算款	989,404.25
3	应收股利	–
4	应收利息	174.17
5	应收申购款	27,830.78
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	1,017,409.20

8.11.4 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。

8.11.5 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
1,890	60,143.72	18,527,113.31	16.30%	95,144,511.41	83.70%

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	3,687,883.33	3.24%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年5月17日）基金份额总额	434,578,142.49
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,414,907.70
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	324,321,425.47
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	113,671,624.72

§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，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、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

本报告期内，根据证监会《关于核准中国银行股份有限公司李爱华基金行业高级管理人员任职资格的批复》，李爱华先生担任本基金托管人——中国银行托管及投资者服务部总经理。因工作调动，董杰先生不再担任中国银行托管及投资者服务部总经理，刘慧军女士不再担任中国银行托管及投资者服务部副总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。本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情况为人民币67,000.00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	
Morgan Stanley & Co. International PLC	–	91,867,646.33	22.23%	58,563.86	21.18%	–
Nomura International Plc.	–	89,403,603.95	21.63%	49,057.08	17.74%	–
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	–	68,180,589.77	16.50%	42,460.83	15.36%	–
CCB International Securities Limited	–	53,554,498.94	12.96%	37,101.25	13.42%	–
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	–	52,501,412.47	12.70%	26,250.69	9.49%	–
UBS Securities Asia Limited	–	29,036,326.45	7.03%	22,988.58	8.31%	–
SinoPac Securities Corp.	–	28,773,009.62	6.96%	40,099.69	14.50%	–
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	–	–	–	–	–	–
CLSA Limited	–	–	–	–	–	–
CMB International Securities Limited	–	–	–	–	–	–
Deutsche Securities Asia Limited	–	–	–	–	–	–
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	–	–	–	–	–	–
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	–	–	–	–	–	–
Mizuho Securities Asia Limited	–	–	–	–	–	–
Yuanta Securities Company Limited.	–	–	–	–	–	–
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	–	–	–	–	–	–

注：1、券商专用交易单元选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

（1）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；

（2）具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；

（3）交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

（4）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；

（5）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。

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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券股份有限公司	–	–	1,856,900,000.00	100.00%	–	–	–	–

华安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日