华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

2012 第四季度 报告

2012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：二〇一三年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安标普全球石油指数（QDII-LOF）
基金主代码	160416
交易代码	160416
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月29日
报告期末基金份额总额	179,005,406.79份
投资目标	本基金为股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以标普全球石油指数成分股构成及其权重等指标为基础构建指数化投资组合。选择以“跟踪偏离度的绝对值”作为投资组合管理的主要标准，控制基金相对指数的偏离风险。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过6%（以美元资产计价）。
业绩比较基准	标普全球石油净总收益指数收益率 S&P Global Oil Index Net Total Return）
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	State Street Bank and Trust Company
境外资产托管人中文名称	美国道富银行

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-170,593.79
2.本期利润	-3,786,326.25
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0247
4.期末基金资产净值	179,366,888.31
5.期末基金份额净值	1.002

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	-3.93%	0.80%	-2.53%	0.85%	-1.40%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2012年3月29日至2012年12月31日）

注：1.本基金于2012年3月29日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2.根据《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）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十三部分“基金的投资”中投资范围、投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
徐宜宜	本基金的基金经理	2012-3-29	-	6年	管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM（金融风险管理师），6年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国富富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理职务。2012年3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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。①）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。②）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。③）银行间市场业务，遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的wind群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间以价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易或交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0次，未出现异常交易。

4.4 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

第四季度，市场在极度低落的情绪中不断下跌，创出了几年来的新低后，市场上演了否极泰来的戏剧性行情，随着QFII资金的大举买入、加上投资者对经济触底回升的预期，以及蓝筹股估值便宜的现实等多种因素的综合作用下，在12月份市场出现了大幅快速的反弹，以大盘蓝筹股的估值修复为主导，各类超跌股也轮番上涨，指数实现了全年正收益。

报告期内，本基金重点配置于科技类产业和拥有核心技术的企业以及由于制度革新而在未来可能产生变革的行业。作为一个行业类成长型基金，对于12月份市场反弹的主力金融和地产基本没有配置，而基于对市场和科技类与成长类行业的谨慎判断，在操作上比较保守，影响了基金净值的表现，但我们相信，坚持特色、坚持风格，不懈地对优秀的成长性公司进行挖掘和投资，一定会获得应有的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.991元，本报告期份额净值增长率为 2.06%，同期业绩比较基准增长率为6.49%。

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2013年一季度，经济仍然处于弱复苏状态，预计市场情绪仍然比较高涨，市场的变化来自于企业盈利能否匹配股价的上涨，以及对政策预期的检验。在操作策略上，主要以公司和行业的成长性作为选股标准，重点配置电子、节能环保、医药、以及具有核心竞争力的制造业等。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	154,554,774.25	78.25
	其中：普通股	139,233,679.43	70.49
	存托凭证	15,321,094.82	7.76
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	9,487,596.25	4.80
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	30,324,196.83	15.35
8	其他各项资产	3,153,335.17	1.60
9	合计	197,519,902.50	100.00

5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
美国	82,194,705.30	45.82
英国	35,151,858.11	19.60
加拿大	18,912,830.77	10.54
法国	7,300,565.46	4.07
中国香港	5,113,803.91	2.85
意大利	3,561,513.14	1.99
澳大利亚	2,319,497.56	1.29
合计	154,554,774.25	86.17

5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

5.3.1报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
电信服务	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
非必需消费品	-	-
能源	153,359,150.94	85.50
保健	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
合计	153,359,150.94	85.50

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3.2报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
电信服务	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
非必需消费品	-	-
能源	1,195,623.31	0.67
保健	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
合计	1,195,623.31	0.67

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.4 报告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及存托凭证投资明细

5.4.1 指数投资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及存托凭证投资明细

序号	证券代码	公司名称（英文）	公司名称（中文）	所在证券市场	所属国家（地区）	数量（股）	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽约	美国	30,500	16,592,305.76	9.25
2	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽约	美国	18,500	12,574,708.45	7.01
3	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	RDSA LN	伦敦	英国	40,952	8,830,010.53	4.92
4	BP PLC	碧辟公司	BP/ LN	伦敦	英国	182,003	7,856,041.66	4.38
5	TOTAL SA	道达尔	FP FP	巴黎	法国	22,500	7,300,565.46	4.07
6	GAZPROM OAO-SPON ADR	俄罗斯天然气工业公司	OGZD LI	伦敦	英国	109,500	6,510,960.89	3.63
7	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约	美国	17,000	6,196,434.47	3.45
8	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽约	美国	14,000	6,098,068.90	3.40
9	CANADIAN NATURAL RESOURCES	加拿大自然资源有限公司	CNQ CN	多伦多	加拿大	33,000	5,971,646.21	3.33
10	BG GROUP PLC	BG集团	BG/ LN	伦敦	英国	44,500	4,578,210.62	2.55

5.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

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	CAIRN ENERGY PLC	凯恩能源有限公司	CNE LN	伦敦	英国	21,000	565,038.45	0.32
2	CHINA OILFIELD SERVI	中国海洋石油	2883 HK	香港	中国香港	30,000	388,721.49	0.22
3	EXCO RESOURCES INC	EXCO资源公司	XCO US	纽约	美国	2,500	106,382.09	0.06
4	FOREST OIL CORP	福雷斯特石油公司	FST US	纽约	美国	2,500	105,124.99	0.06
5	ESSAR ENERGY PLC	爱萨能源有限公司	ESSR LN	伦敦	英国	2,500	30,356.29	0.02

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 报告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。

5.9 报告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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	SPDR S&P OIL & GAS EXP & PR	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	4,079,038.08	2.27
2	UNITED STATES OIL FUND LP	ETF	开放式	United States Commodities Fund LLC	2,621,839.19	1.46
3	BARRRUR ID	Open-end Fund	开放式	Barclays Capital Fund Solutions	1,888,898.16	1.05
4	ENERGY SELECT SECTOR SPDR	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	897,820.82	0.50

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	129,122.94
4	应收利息	3,145.69
5	应收申购款	3,020,635.50
6	其他应收款	431.04
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,153,335.17

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.10.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.10.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	125,902,608.76
本报告期基金总申购份额	124,031,599.22
减：本报告期基金总赎回份额	70,928,801.19
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	179,005,406.79

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》

2、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）招募说明书》

3、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）托管协议》

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇一三年一月二十一日

华安科技动力股票型证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012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：二〇一三年一月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安科技动力股票
基金主代码	040025
交易代码	040025
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月20日
报告期末基金份额总额	58,050,276.07份
投资目标	本基金重点投资于以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业，关注其科技创新或技术突破后产生的增长动能，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	本基金采取相对稳定的资产配置策略，一般情况下将保持股票配置比例的相对稳定，避免因过于主动的仓位调整带来额外的风险。个股选择中以产业链价值结构为主要判则基准，选取以科学技术为动力在产业价值链中占据优势地位的行业或企业，同时从市场广度、技术深度、产业宽度和政策强度等方面寻找选取财务状况良好、盈利能力较强且资产质量较好的公司并作为重点投资对象。
业绩比较基准	80%×中证800指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
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中高风险投资品种。
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-1,832,139.97
2.本期利润	1,045,713.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.0176
4.期末基金资产净值	57,503,860.13
5.期末基金份额净值	0.991

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

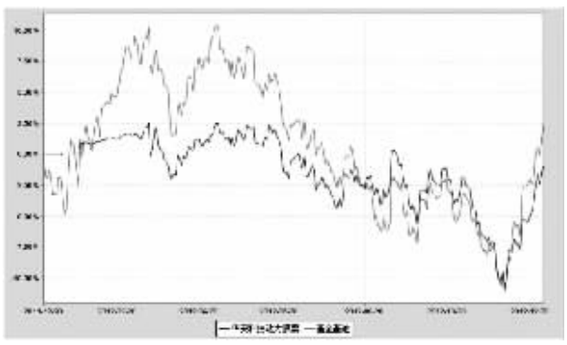
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.06%	0.83%	6.49%	1.04%	-4.43%	-0.21%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

华安科技动力股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2011年12月20日至2012年12月31日）



注：根据《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》，本基金建仓期为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中投资范围、投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2011-12-20	-	10年	管理学博士，持有基金从业资格证书。10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宏利股票型证券投资基金的基金经理，2009年3月起担任华安创新证券投资基金的基金经理。2011年12月起担任本基金的基金经理。2012年6月起担任基金投资部副总监。

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《华安科技动力股票型证券投资基金基金合同》、《华安科技动力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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。①）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。②）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。③）银行间市场业务，遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的wind群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。④）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的wind群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。⑤）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的wind群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。⑥）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的wind群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间以价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的次数为0次，未出现异常交易。

4.4 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

第四季度，市场在极度低落的情绪中不断下跌，创出了几年来的新低后，市场上演了否极泰来的戏剧性行情，随着QFII资金的大举买入、加上投资者对经济触底回升的预期，以及蓝筹股估值便宜的现实等多种因素的综合作用下，在12月份市场出现了大幅快速的反弹，以大盘蓝筹股的估值修复为主导，各类超跌股也轮番上涨，指数实现了全年正收益。

报告期内，本基金重点配置于科技类产业和拥有核心技术的企业以及由于制度革新而在未来可能产生变革的行业。作为一个行业类成长型基金，对于12月份市场反弹的主力金融和地产基本没有配置，而基于对市场和科技类与成长类行业的谨慎判断，在操作上比较保守，影响了基金净值的表现，但我们相信，坚持特色、坚持风格，不懈地对优秀的成长性公司进行挖掘和投资，一定会获得应有的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.991元，本报告期份额净值增长率为 2.06%，同期业绩比较基准增长率为6.49%。

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2013年一季度，经济仍然处于弱复苏状态，预计市场情绪仍然比较高涨，市场的变化来自于企业盈利能否匹配股价的上涨，以及对政策预期的检验。在操作策略上，主要以公司和行业的成长性作为选股标准，重点配置电子、节能环保、医药、以及具有核心竞争力的制造业等。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	39,012,212.11	64.81
	其中：股票	39,012,212.11	64.81
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	20,600,291.19	34.22
6	其他各项资产	581,979.65	0.97
7	合计	60,194,482.95	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	2,364,600.00	4.11
C	制造业	24,105,740.11	41.92
C0	食品、饮料	-	-
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	3,708,490.72	6.45
C5	电子	4,842,794.56	8.42
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	13,309,654.83	23.15
C8	医药、生物制品	2,244,800.00	3.90
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,098,000.00	1.91
F	交通运输、仓储业	1,014,000.00	1.76
G	信息技术业	6,313,072.00	10.98
H	批发和零售贸易	2,484,800.00	4.32
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,632,000.00	2.84
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	39,012,212.11	67.84

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000651	格力电器	134,888	3,439,644.00	5.98
2	600050	中国联通	700,000	2,450,000.00	4.26
3	601231	环旭电子	201,959	2,391,194.56	4.16
4	600309	烟台万华	150,000	2,341,500.00	4.07
5	002649	博彦科技	124,800	1,983,072.00	3.45
6	300083	劲胜股份	150,000	1,812,000.00	3.15
7	002658	雪迪龙	74,800	1,709,180.00	2.97
8	300332	天壕节能	170,000	1,632,000.00	2.84
9	002013	中航精机	140,917	1,602,226.29	2.79
10	600741	华域汽车	140,000	1,565,200.00	2.72

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告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。

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	54,762.46
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,028.93
5	应收申购款	523,188.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	581,979.65

5.8.4 报告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可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中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在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	58,806,604.91
本报告期基金总申购份额	16,949,042.35