华安创新证券投资基金

2012年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一三年三月二十七日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2013年3月11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2012年1月1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	华安创新混合	
基金主代码	040001	
交易代码	040001(前端)	041001(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001年9月21日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	8,798,180,702.95份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	裘学敏
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701262

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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-689,207,520.39	-334,816,088.14	602,457,828.35
本期利润	200,130,239.89	-1,985,615,867.53	358,384,717.10
加权平均基金份额本期利润	0.0217	-0.1984	0.0339
本期基金份额净值增长率	3.47%	-25.72%	5.04%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	0.2475	0.3208	0.3754
期末基金资产净值	5,245,311,156.84	5,641,560,747.56	8,077,339,923.21
期末基金份额净值	0.596	0.576	0.797

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.83%	0.80%	7.47%	0.93%	-3.64%	-0.13%
过去六个月	0.68%	0.80%	2.17%	0.90%	-1.49%	-0.10%
过去一年	3.47%	0.90%	6.27%	0.94%	-2.80%	-0.04%
过去三年	-19.26%	1.06%	-19.12%	1.04%	-0.14%	0.02%
过去五年	-36.92%	1.29%	-32.84%	1.47%	-4.08%	-0.18%
自基金合同生效起至今	227.19%	1.17%	66.60%	1.32%	160.59%	-0.15%

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

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

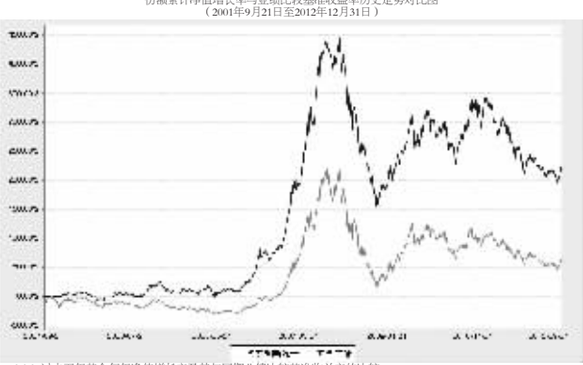
截至2012年12月31日，本基金投资于股票、债券占基金总资产92.38%，权证投资比例为0，投资于国债和政策性金融债占基金净资产20.43%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

华安创新证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

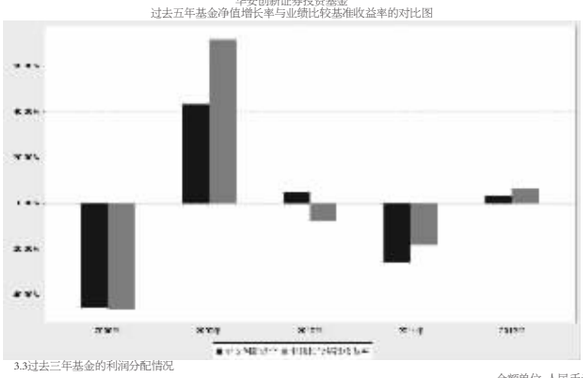
（2001年9月21日至2012年12月31日）



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

华安创新证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位：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
2012年	-	-	-	-	-
2011年	0.200	113,483,944.69	88,593,507.52	202,077,452.21	-
2010年	0.200	121,472,413.12	94,948,866.67	216,421,279.79	-
合计	0.400	234,956,357.81	183,542,374.19	418,498,732.00	-

§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2012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、华安安利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证300指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券等34只开放式基金。管理资产规模达到 955.90亿元人民币。

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		
汪光成	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2009-03-27	-	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利股票证券投资基金的基金经理，2009年3月起担任本基金的基金经理。2011年12月起担任华安科技动力股票型证券投资基金的基金经理。

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《华安创新证券投资基金基金合同》、《华安创新证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

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。通过内部共享的twind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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3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阈日反向交易的检查；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，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%的情况共出现了2次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量被释少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

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

2012年市场呈现两头强中间弱的格局。年初市场曾经预计政府将改变两年来的调控基调，适当放松，而国内经济也将触底回升，因此在一季度A股市场经历了一波较大反弹行情。二、三季度，国内经济仍然处于下滑状态，实体经济继续面临去库存和盈利下滑的困境，通胀水平呈现出下降趋势，货币和财政政策开始适度放松，但力度低于市场预期，市场在狐疑之中宽幅震荡，但随着中期多项数据的陆续公布，投资者发现经济数据欠佳，许多上市公司中报不佳，再加上周边局势不稳定，欧债问题等，市场出现了较大幅度的下跌，周期类股票以及业绩趋势欠佳的股票跌幅比较大，但一些成长特性比较明显且业绩趋势比较好的行业如医药、消费电子等行业表现良好，市场结构性分化较为明显。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，市场在12月份出现了大幅快速的反弹，以大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。

由于市场波动幅度和风格变化比较大，本报告期内基金的操作也在跟随变化，在一、二季度本基金重点配置了周期类行业，在反弹过程中表现良好，而基于对市场的谨慎判断，在股票组合比例上进行了控制，并适当增加了消费品的配置比例，而在市场下跌过程中，由于对低估值股票的防御价值判断有所高估，对周期类股票降低幅度不大，所以基金净值在二、三季度波动较大。第四季度，在市场创新低的过程中，基于低估值的防御思路，开始逐步增持银行股，股票组合比例也逐步提升，但在12月中旬，基金经理过早过快地对金融股进行了减持，一方面是对市场行情的变化认识不足，另一方面在发现错误之后没有及时调整组合结构，这是需要认真反思的。纵观全年，本基金股票资产主要配置于金融、地产、汽车、化工、能源、电子、医药、煤炭等行业，但偏重于周期类行业，在个股布局上以低估值股票为特征。

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0.596元。本报告期份额净值增长率为3.47%，同期业绩基准增长率6.27%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2013年，基金经理认为经济仍然处于温和复苏状态，而通货膨胀趋势有可能抬头但力度可能相对温和，预计国家在财政和货币政策上有可能以窥望和微调为主，就证券市场而言，在经济出现复苏的情况下，对全年走势持相对乐观态度，但预计市场将在预期的证实和证伪的过程中产生较大的波动，具体而言，重点关注一季度国家对房地产政策的力度和态度；二、三季度对经济复苏程度的判断、通货膨胀状况和企业盈利变化的关注；四季度新一届政府经济政策的明朗化，以及对IPO重启和再融资规模的接受程度等，都会对市场情绪产生较大的触动，因此，无论是指数、行业、还是个股等，预计都将比较活跃。

在行业选择方面，看好低估值、盈利预期稳定的金融、地产等行业全年的表现，其他行业如化工、汽车、机械、煤炭等，根据经济复苏状况和行业特征变化等，适当进行配置。而对于一些成长性行业如医药、电子、节能环保及其他具有中国优势的制造业则进行持续的配置和研究。对于股票的选择，按照商业模式、行业特性、公司战略、管理层等因素进行综合考量和研究，遵循“基本价值”的纪律和理念在波动中进行操作。

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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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，首席投资官，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。

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。

黄勤，固定收益部总监，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，指数投资部总监，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

2012年度，基金托管人在华安创新证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012年度，华安基金管理有限公司在华安创新证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2012年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安创新证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 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、庄贤签字出具了普华永道中天审字(2013)第21319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：华安创新证券投资基金

报告截止日：2012年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资产：		
银行存款	225,972,214.00	93,939,175.52
结算备付金	96,464,821.08	101,331,891.37
存出保证金	1,074,082.19	2,016,302.20
交易性金融资产	4,858,472,136.79	5,257,844,894.46
其中：股票投资	3,248,296,556.79	3,764,142,801.26
基金投资	-	-
债券投资	1,610,175,580.00	1,493,702,093.20
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	48,900,224.45	187,880,841.82
应收证券清算款	13,912,794.76	-
应收利息	23,180,263.65	21,704,203.56
应收股利	-	-
应收申购款	148,293.43	168,940.12
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,268,124,830.35	5,664,886,249.05
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31日	上年度末 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	9,075,742.74	8,613,861.77
应付赎回款	2,266,257.24	1,056,081.95
应付管理人报酬	6,317,074.81	7,352,978.16
应付托管费	1,052,845.80	1,225,496.38
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,813,186.52	3,773,948.18
应交税费	1,253.64	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,287,312.76	1,303,135.05
负债合计	22,813,673.51	23,325,501.49
所有者权益：		
实收基金	2,047,336,359.63	2,277,737,439.64
未分配利润	3,197,974,797.21	3,363,823,307.92
所有者权益合计	5,245,311,156.84	5,641,560,747.56
负债和所有者权益总计	5,268,124,830.35	5,664,886,249.05

注：报告截止日2012年12月31日，基金份额净值0.596元，基金份额总额8,798,180,702.95份。

7.2 利润表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	326,087,538.22	-1,826,260,866.96
1.利息收入	59,228,983.30	62,016,088.29
其中：存款利息收入	4,648,601.56	6,068,151.79
债券利息收入	50,050,466.14	52,678,670.05
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,529,915.60	3,269,266.45
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-623,227,110.31	-237,846,851.72
其中：股票投资收益	-689,188,717.41	-256,035,671.63
基金投资收益	-	-
债券投资收益	836,235.10	-17,351,946.64
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	65,125,372.00	35,540,766.55
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	889,337,760.28	-1,650,799,779.39
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	747,904.95	369,675.86
减：二、费用	125,957,298.33	159,355,000.57
1. 管理人报酬	81,338,244.50	106,165,836.21
2. 托管费	13,556,374.08	17,694,306.02
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	30,591,262.00	33,742,044.87
5. 利息支出	7,714.36	1,289,682.87
其中：卖出回购金融资产支出	7,714.36	1,289,682.87
6. 其他费用	463,703.39	463,130.60
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	200,130,239.89	-1,985,615,867.53
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	200,130,239.89	-1,985,615,867.53

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2012年1月1日至2012年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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）	2,277,737,439.64	3,363,823,307.92	5,641,560,747.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	200,130,239.89	200,130,239.89
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）	-230,401,080.01	-365,978,750.60	-596,379,830.61
其中：1.基金申购款	19,394,449.63	29,770,452.37	49,164,902.00
2.基金赎回款	-249,795,529.64	-395,749,202.97	-645,544,732.61
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）	2,047,336,359.63	3,197,974,797.21	5,245,311,156.84

项目	上年度可比期间 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）	2,359,280,337.05	5,718,059,586.16	8,077,339,923.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,985,615,867.53	-1,985,615,867.53
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）	-81,542,897.41	-166,542,958.50	-248,085,855.91
其中：1.基金申购款	126,811,992.42	283,221,977.61	410,033,970.03
2.基金赎回款	-208,354,889.83	-449,764,936.11	-658,119,825.94
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-202,077,452.21	-202,077,452.21
五、期末所有者权益（基金净值）	2,277,737,439.64	3,363,823,307.92	5,641,560,747.56

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：

基金管理人公司负责人：李勤，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

华安创新证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2001]第33号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》（后更名为《华安创新证券投资基金基金合同》）发起，并于2001年9月21日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,000,001,124.00元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2001)第84号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2013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”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安创新证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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2012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2012年12月31日的财务状况以及2012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[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[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) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
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

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

本基金本报告期和上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	81,338,244.50	106,165,836.21
其中：支付销售机构的客户维护费	9,254,006.64	11,799,288.48

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值 ×1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	13,556,374.08	17,694,306.02

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

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 2012年1月1日至2012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
交通银行	259,941,442.56	-	400,000,000.00	140,556.71	-	-
上年度可比期间 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
交通银行	180,177,979.84	-	99,000,000.00	311,106.84	-	-

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
期初持有的基金份额	23,684,213.97	23,059,300.68
期间申购/买入总份额	-	624,913.29
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	23,684,213.97	-
期末持有的基金份额	-	23,684,213.97
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.24%

注：期间申购/买入总