华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

2013 年度 报告摘要

2013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：二〇一四年三月三十一日

§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2014年3月18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2013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	华安标普全球石油指数（QDII-LOF）（场内简称：华安石油）
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
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	52,407,148.80份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳交易所
上市日期	2012年5月2日

2.2 基金产品说明

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。

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	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮政编码		02111

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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年12月31日
本期已实现收益	7,609,094.18	16,740,343.65
本期利润	9,741,324.66	19,224,665.68
加权平均基金份额本期利润	0.1038	0.0683
本期基金份额净值增长率	9.08%	4.14%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0930	0.0020
期末基金资产净值	57,278,835.90	179,366,888.31
期末基金份额净值	1.093	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）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

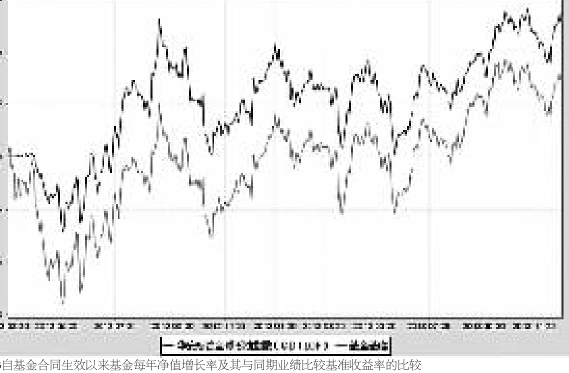
3.2.1基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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3个月	4.59%	0.56%	3.05%	0.61%	1.54%	-0.05%
过去6个月	11.30%	0.55%	12.09%	0.59%	-0.79%	-0.04%
过去1年	9.08%	0.71%	11.12%	0.75%	-2.04%	-0.04%
自基金成立起至今	13.59%	0.78%	7.96%	0.93%	5.63%	-0.15%

注：本基金业绩比较基准：标普全球石油净总收益指数收益率（S&P Global Oil Index Net Total Return）

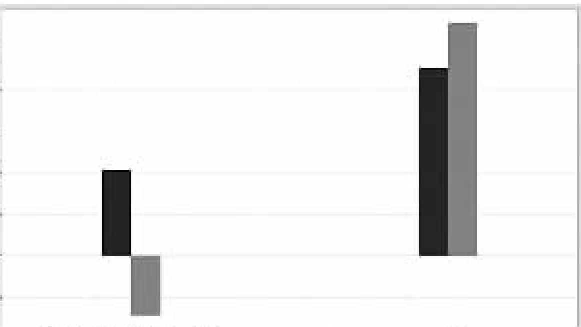
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）
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
（2012年3月29日至2013年12月31日）



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

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



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
2012年	0.400	6,218,657.42	446,544.36	6,665,201.78	–
合计	0.400	6,218,657.42	446,544.36	6,665,201.78	–

§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2013年12月31日，公司旗下共管理了华安安顺封闭1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、华安月安鑫短期理财债券、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、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克100指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金ETF联接、华安沪深300量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产ETF、华安中证细分医药ETF等46只开放式基金。管理资产规模达到838.62亿元人民币。

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		
徐宜宜	本基金的基金经理	2012-03-29	–	7年	管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM（金融风险管理师），7年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国道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。2013年7月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金的基金经理。2013年8月起同时担任华安易富黄金交易型开放式证券投资基金联接基金及华安纳斯达克100指数证券投资基金的基金经理。2013年12月起同时担任华安中证细分地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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 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、邮件发送、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iwind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议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。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

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，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3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，交易量稀少，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

2013年全年油价总体走势震荡向上，接近年底油价又出现了上涨。第一季度主要受经济利好和对货币宽松的预期影响，油价出现大幅上涨。二季度以来，相对宽松的供给和充沛库存，以及对量化宽松退出的担忧，石油价格出现一定的下跌。三季度以来，以美国为代表的发达国家经济体经济复苏迹象明显，具体表现在失业率逐步降低，房地产开发升温，包括汽车在内的耐用品消费转旺，导致油价逐步回升，并在年底创出2013年最高点。2013年，中东局势较为稳定，地缘政治对油价作用不明显。石油指数全年以来总体与油价走势高度吻合，呈现前低后高的态势。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013 年12 月31 日，本基金份额净值为1.093 元，本报告期份额净值增长率为9.08%，同期的业绩比较基准增长率为11.12%。2013年的累计偏离度为-2.04%。日均跟踪误差为0.07%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期三大机构预测来看，2014 年非OPEC 原油产量将大幅上升，OPEC供给量将明显下降，原油市场进入供给宽松环境，其中美国成为供给上升的主要推动力。EIA 预测2014 年OPEC 闲置产能较为乐观，这造成市场对明年油价存在较谨慎预期。在美国逐步退出量化宽松的大环境下，资金将从新兴市场离开，而部分新兴市场今年面临政治选举，叠加经济上的不确定性因素，全球受威胁的石油产能仍然较高。而如果全球经济增长在2014 年之后能够按照IMF 预测一样，恢复到4%以上，则有理由相信石油市场供应和需求之间的缓冲空间将有所缩减，对原油中期价格将较为乐观。

石油指数中主要成分股是综合型石油企业。其未来股价表现除了油价以外，还包括资本支出的优化以及新的油气勘探突破等因素。预计，2014年主要石油生产企业将减缓资本支出的增长幅度。石油企业的盈利潜力有望得到进一步释放。

作为标普石油指数基金的管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

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副总裁、首席投资官。

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。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，现华安香港精选、华安大中华升级股票的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监。

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，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

贺涛，金融学硕士，固定收益部副总监。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。现任华安稳定收益债券基金、华安可转债基金、华安信用增强债券基金、华安双债添利债券基金的基金经理，固定收益部副总监。

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

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。

本报告期不进行收益分配。

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(特殊普通合伙)审计，注册会计师汪棣、傅琛慧签字出具了普华永道中天审字(2014)第20843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：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资产：		
银行存款	2,868,866.55	30,324,196.83
结算备付金	–	–
存出保证金	–	–
交易性金融资产	55,725,250.78	164,042,370.50
其中：股票投资	55,725,250.78	154,554,774.25
基金投资	–	9,487,596.25
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	–	–
应收利息	561.77	3,145.69
应收股利	49,583.00	129,122.94
应收申购款	167,306.40	3,020,635.50
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	431.04
资产总计	58,811,568.50	197,519,902.50
负债和所有者权益	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012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	–	2,666,560.52
应付赎回款	1,098,342.24	14,731,391.74
应付管理人报酬	48,678.20	151,806.65
应付托管费	13,629.88	42,505.85
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	372,082.28	560,749.43
负债合计	1,532,732.60	18,153,014.19
所有者权益：		
实收基金	52,407,148.80	179,005,406.79
未分配利润	4,871,687.10	361,481.52
所有者权益合计	57,278,835.90	179,366,888.31
负债和所有者权益总计	58,811,568.50	197,519,902.50

注：1. 报告截止日2013年12月31日，基金份额净值1.093元，基金份额总额52,407,148.80份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为2012年3月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年12月31日
一、收入	11,632,313.22	23,080,406.90
1.利息收入	41,533.53	1,147,299.28
其中：存款利息收入	41,533.53	277,304.49
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	–	869,994.79
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	10,555,171.05	19,000,841.41
其中：股票投资收益	7,809,485.81	13,953,783.85
基金投资收益	251,351.00	965,081.68
债券投资收益	–	–
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	23,832.69
股利收益	2,494,334.24	4,058,143.19
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,132,230.48	2,484,322.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,280,525.17	-197,494.12
5.其他收入（损失以“-”号填列）	183,903.33	645,438.30
减：二、费用	1,890,988.56	3,855,741.22
1.管理人报酬	979,408.32	2,125,600.23
2.托管费	274,234.48	595,168.06
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	55,253.75	508,570.45
5.利息支出	–	–
其中：卖出回购金融资产支出	–	–
6.其他费用	582,092.01	626,402.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	9,741,324.66	19,224,665.68
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列	9,741,324.66	19,224,665.68

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2013年1月1日至2013年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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）	179,005,406.79	361,481.52	179,366,888.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	9,741,324.66	9,741,324.66
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）	-126,598,257.99	-5,231,119.08	-131,829,377.07
其中：1.基金申购款	35,706,918.56	1,137,838.10	36,844,756.66
2.基金赎回款	-162,305,176.55	-6,368,957.18	-168,674,133.73
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）	52,407,148.80	4,871,687.10	57,278,835.90

项目	上年度可比期间 2012年3月29日（基金合同生效日）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）	529,058,682.11	–	529,058,682.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	19,224,665.68	19,224,665.68
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）	-350,053,275.32	-12,197,982.38	-362,251,257.70
其中：1.基金申购款	153,658,245.05	433,926.50	154,092,171.55
2.基金赎回款	-503,711,520.37	-12,631,908.88	-516,343,429.25
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）	–	-6,665,201.78	-6,665,201.78
五、期末所有者权益（基金净值）	179,005,406.79	361,481.52	179,366,888.31

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号）从报告7.1至报告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：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

华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)(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1475号《关于核准华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)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《华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式，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528,753,887.81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(2012)第093号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2012年3月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为529,058,682.11份基金份额，其中认购资金利息折合304,794.30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，境外资产托管人为道富银行(State Street Bank and Trust Company)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2012]第100号文审核同意，本基金39,560,197份基金份额于2012年5月2日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股，与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类证券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股的比例不低于基金资产净值的80%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的20%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。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)。本基金的业绩比较基准为：标普全球石油净总收益指数收益率(S&P Global Oil Index Net Total Return)。

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2014年3月28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》、《华安标普全球石油指数证券投资基金(LOF) 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所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2013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2013年12月31日的财务状况以及2013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

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[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，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(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、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
道富银行(State Street Bank and Trust Company)	境外资产托管人

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 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	979,408.32	2,125,600.23
其中：支付销售机构的客户维护费	485,082.01	1,473,734.94

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1.0%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×1.0%/当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	274,234.48	595,168.06

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0.28%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×0.28%/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 2013年1月1日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012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	2,301,745.86	41,139.53	17,397,595.00	261,725.82
道富银行	567,120.69	326.30	12,926,601.83	2,539.42

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人道富银行保管，按适用利率或约定利率计息。

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（2013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。

7.4.10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) 各层级金融工具公允价值

于2013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55,725,250.78 元，无属于第二层级和第三层级的余额(于2012年12月31日，第一层级164,042,370.50元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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) 第三层级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	55,725,250.78	94.75
	其中：普通股	54,343,129.27	92.40
	存托凭证	1,382,121.51	2.35
	优先股	–	–
	房地产信托	–	–
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	2,868,866.55	4.88
8	其他各项资产	217,451.17	0.37
9	合计	58,811,568.50	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（%）
美国	26,881,817.42	46.93
英国	9,667,780.23	16.88
法国	5,061,063.83	8.84
加拿大	9,111,041.38	15.91
澳大利亚	2,315,889.87	4.04
意大利	2,687,658.05	4.69
合计	55,725,250.78	97.29

8.3 期末按行业分类的权益投资组合

8.3.1 指数投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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（%）
电信服务	–	–
工业	–	–
信息技术	–	–
非必需消费品	–	–
能源	55,725,250.78	97.29
保健	–	–
公用事业	–	–
金融	–	–
必需消费品	–	–
材料	–	–
合计	55,725,250.78	97.29

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.3.2 积极投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

无。

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

8.4.1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	EXXON MOBIL CORP	艾克森美孚石油	XOM US	纽约交易所	美国	11,000	6,787,069.08	11.85
2	CHEVRON CORP	雪佛龙德士古	CVX US	纽约交易所	美国	7,000	5,330,946.45	9.31
3	TOTAL SA	道达尔	FP FP	法国交易所	法国	13,500	5,061,063.83	8.84
4	BP PLC	碧辟公司	BP/ LN	伦敦交易所	英国	75,539	3,707,178.85	6.47
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷兰皇家壳牌	RDSA LN	伦敦交易所	英国	15,314	3,330,835.25	5.82
6	ENI SPA	埃尼	ENI IM	意大利交易所	意大利	16,900	2,488,466.88	4.34
7	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽约交易所	美国	4,000	2,197,566.64	3.84
8	SUNCOR ENERGY INC	森科能源公司	SU CN	加拿大交易所	加拿大	8,248	1,758,741.79	3.07
9	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽约交易所	美国	4,000	1,722,983.94	3.01
10	BG GROUP PLC	BG集团	BG/ LN	伦敦交易所	英国	13,000	1,696,128.33	2.96

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。

8.4.2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

无。

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	ENBRIDGE INC	ENB CN	1,956,826.61	1.09
2	ENI SPA	ENI IM	1,538,042.07	0.86
3	TOTAL SA	FP FP	1,144,883.99	0.64
4	BP PLC	BP/ LN	291,263.01	0.16
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	RDSA LN	278,366.62	0.16
6	CRESCENT POINT ENERGY CORP	CPG CN	62,047.37	0.03
7	TRANSCANADA CORP	TRP CN	60,399.47	0.03
8	CENOVUS ENERGY INC	CVE CN	42,917.47	0.02
9	SUNCOR ENERGY INC	SU CN	29,695.20	0.02
10	ENCANA CORP	ECA CN	28,404.43	0.02
11	HUSKY ENERGY INC	HSE CN	10,427.91	0.01
12	IMPERIAL OIL LTD	IMO CN	5,858.11	0.00
13	AMEC PLC	AMEC LN	4,064.74	0.00
14	FREEPORT MCMORGEN COPPER	FCX US	575.63	0.00

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初基金资产净值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	占期初基金资产净值比例（%）
1	EXXON MOBIL CORP	XOM US	10,978,042.06	6.12
2	CHEVRON CORP	CVX US	8,569,898.54	4.78
3	GAZPROM OAO-SPON ADR	OGZD LI	6,582,219.37	3.67
4	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	RDSA LN	5,660,282.59	3.16
5	CANADIAN NATURAL RESOURCES	CNQ CN	5,455,485.60	3.04
6	BP PLC	BP/ LN	5,139,798.95	2.87
7	CONOCOPHILLIPS	COP US	5,018,296.39	2.80
8	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	5,015,744.30	2.80
9	TOTAL SA	FP FP	4,133,068.36	2.30
10	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	3,625,706.50	2.02
11	BG GROUP PLC	BG/ LN	3,482,829.46	1.94
12	HALLIBURTON CO	HAL US	2,715,854.58	1.51
13	ENCANA CORP	ECA CN	2,667,638.68	1.49
14	NOVATEK OAO-SPONS GDR REG S	NVTK LI	2,104,136.15	1.17
15	BAKER HUGHES INC	BHI US	2,020,078.36	1.13
16	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	1,862,925.14	1.04
17	MARATHON OIL CORP	MRO US	1,853,456.30	1.03
18	APACHE CORP	APA US	1,833,756.98	1.02
19	ENI SPA	ENI IM	1,827,186.76	1.02
20	DEVON ENERGY CORPORATION	DVN US	1,821,863.25	1.02

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

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	5,453,772.63
卖出收入（成交）总额	114,381,190.28

注：1、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。

8.6 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	–
3	应收股利	49,583.00
4	应收利息	561.77
5	应收申购款	167,306.40
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	217,451.17

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

8.11.5.1 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。

8.11.5.2 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。

§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
3811	13,751.55	–	–	52,407,148.80	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	马辰浩	200,066.00	0.38%
2	谷荣	90,026.00	0.17%
3	陆保福	90,000.00	0.17%
4	朱小妹	87,300.00	0.17%
5	洪舜銮	49,704.00	0.09%
6	余素泽	40,001.00	0.08%
7	赵德喜	33,900.00	0.06%
8	虞晓现	32,001.00	0.06%
9	赵梗明	29,363.00	0.06%
10	赖根	28,525.00	0.05%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	148,479.18	0.28%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0；本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012年3月29日)基金份额总额	529,058,682.11
本报告期期初基金份额总额	179,005,406.79
本报告期基金总申购份额	35,706,918.56
减：本报告期基金总赎回份额	162,305,176.55
本报告期基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	52,407,148.80

§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：

无。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

本基金托管人2013年12月5日发布任免通知，聘任黄秀莲为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

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

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	
兴业证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
Morgan Stanley & Co. International PLC	–	38,837,161.33	32.41%	9,382.32	20.46%	–
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	–	25,000,359.28	20.86%	10,768.56	23.48%	–
Nomura International Plc.	–	–	–	–	–	–
Barclays Capital Asia Limited.	–	13,066,847.53	10.90%	5,328.57	11.62%	–
UBS Securities Asia Limited	–	7,087,396.82	5.91%	8,495.15	18.52%	–
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	–	34,409,651.34	28.71%	11,886.94	25.92%	–
BMO Nesbitt Burns Inc.	–	–	–	–	–	–
CCB International Securities Limited	–	–	–	–	–	–
SinoPac Securities Corp.	–	–	–	–	–	–
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	–	–	–	–	–	–
UOB KayHian HK Ltd	–	–	–	–	–	–
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	–	–	–	–	–	–

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		股指期货交易	
	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	成交金额	占当期成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Morgan Stanley & Co. International PLC	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	–	–	–	–	–	–	5,132,588.87	53.56%	–	–
Nomura International Plc.	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Barclays Capital Asia Limited.	–	–	–	–	–	–	1,780,380.74	18.58%	–	–
UBS Securities Asia Limited	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	–	–	–	–	–	–	2,669,799.75	27.86%	–	–
BMO Nesbitt Burns Inc.	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
CCB International Securities Limited	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
SinoPac Securities Corp.	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
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	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
UOB KayHian HK Ltd	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–
Credit Suisse (Hong Kong) Limited	–	–	–	–	–	–	–	–	–	–

§12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华安基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日