

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

2012 年半年度报告

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十七日

§ 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。本半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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
4	管理人报告.....	8
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
5	托管人报告.....	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1	资产负债表.....	15
6.2	利润表.....	17
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4	报表附注.....	19
7	投资组合报告.....	33
7.1	期末基金资产组合情况.....	33
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	33
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6	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.....	48
7.7	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.....	49
7.8	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.....	49
7.9	投资组合报告附注.....	49
8	基金份额持有人信息.....	50
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
9	开放式基金份额变动.....	50
10	重大事件揭示.....	50

10.1	基金份额持有人大会决议.....	50
10.2	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.....	51
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4	基金投资策略的改变.....	51
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	51
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8	其他重大事件.....	54
11	备查文件目录.....	56
11.1	备查文件目录.....	56
11.2	存放地点.....	56
11.3	查阅方式.....	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金	
基金简称	华安中国A股增强指数	
基金主代码	040002	
交易代码	040002(前端)	041002(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2002年11月8日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	6,902,195,524.66份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对MSCI中国A股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。
投资策略	<p>(1) 资产配置：本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少规避风险工具的情况下，可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况，适当调整基金资产分配比例。</p> <p>(2) 股票投资：本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。</p> <p>(3) 其它投资：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的</p>

	收益。
业绩比较基准	95% × MSCI 中国 A 股指数收益率 + 5% × 金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李劼	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层
--------	------------	-------------------------------

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期 (2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-121,280,575.61
本期利润	236,532,858.04
加权平均基金份额本期利润	0.0345
本期加权平均净值利润率	4.98%
本期基金份额净值增长率	5.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,413,895,117.00
期末可供分配基金份额利润	0.2048
期末基金资产净值	4,673,814,710.73
期末基金份额净值	0.677
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	183.77%

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
过去一个月	-5.31%	1.11%	-5.94%	1.05%	0.63%	0.06%
过去三个	1.80%	1.09%	0.90%	1.06%	0.90%	0.03%

月						
过去六个月	5.45%	1.31%	5.21%	1.28%	0.24%	0.03%
过去一年	-18.04%	1.31%	-18.98%	1.30%	0.94%	0.01%
过去三年	-17.49%	1.48%	-19.07%	1.49%	1.58%	-0.01%
自基金成立起至今	183.77%	1.63%	125.45%	1.66%	58.32%	-0.03%

注：业绩比较基准收益率=95%×MSCI 中国 A 股指数+5%×金融同业存款利率，业绩比较基准在每个交易日实现再平衡。

根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95% 投资于股票，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%。本基金可以投资于权证，权证的投资比例不高于基金资产净值的 3%。

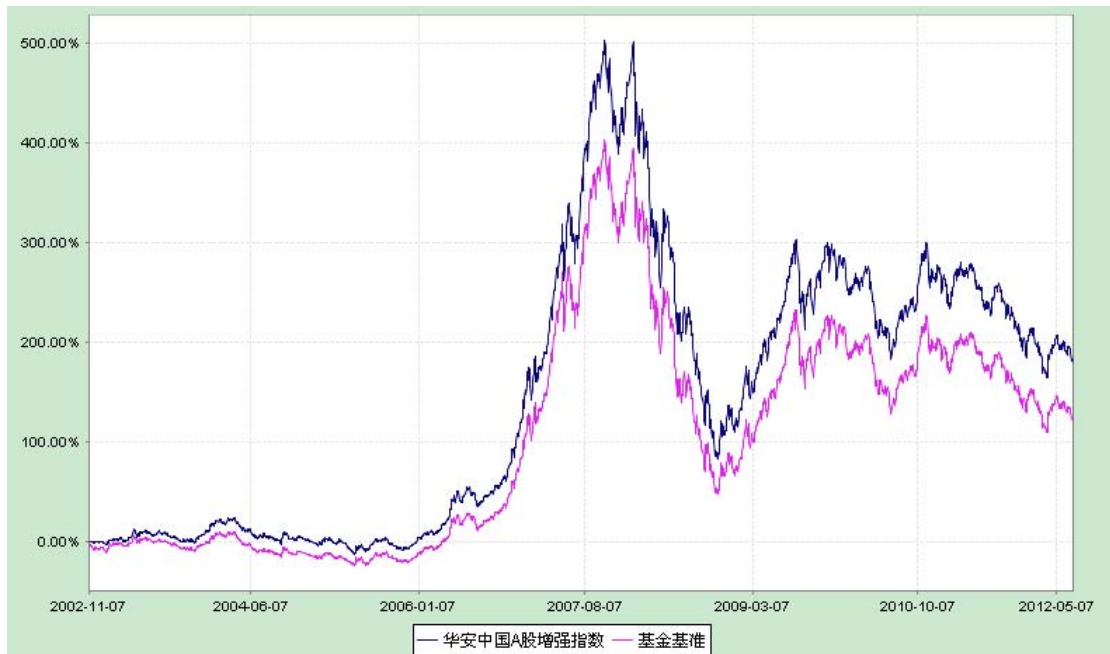
截至 2012 年 6 月 30 日，本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 94.72%，其中权证投资比例为 0。投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金净资产为 5.22%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

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

(2002 年 11 月 8 日至 2012 年 6 月 30 日)



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 6 月 30 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、华安双月鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级等 29 只开放式基金，管理资产规模达到 854.82 亿人民币。

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		
许之彦	本基金的基金经理，指数投资部总监	2008-04-25	-	8 年	理学博士，8 年证券、基金从业经验，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

					<p>公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008 年 4 月起担任本基金的基金经理，2009 年 9 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金及华安上证 180ETF 联接基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2011 年 9 月起同时担任华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理。</p>
牛勇	本基金的基金经理	2010-09-02	-	7 年	<p>复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），7 年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008 年 5 月加入华安基金管理有限公司后任风险管理与金融工程部高级金融工程师，2009 年 7 月至 2010 年 8 月担任本基金的基金经理助理，2010 年 6 月起同时担任上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。2010 年 11 月起担任华安上证龙头企业</p>

					交易型开放式指数证券投资基金和华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2012年6月起同时担任华安沪深300指数分级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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金合同》、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强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

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 MSN 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。

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，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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济需求整体进入放缓期，工业产能面临一定过剩，中游行业去库存压力较大，并波及上游产品价格。4 月份工业增加值开始低于市场预期，央行随后两次出台降息政策，意在降低企业的资金成本以对冲需求放缓。上半年市场先扬后抑，周期性行业在基本面影响下估值继续下探，但金融改革主题、地产、白酒相关板块相对强势。本基金报告期间整体低配上中游周期性板块，超配地产、保险、券商等大金融板块。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内华安中国 A 股增强指数基金份额净值增长率为 5.45%，同期业绩比较基准增长率为 5.21%，基金净值表现领先比较基准 0.24%，截至 2012 年 6 月 30 日，本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.08%（按照基金合同和招募说明书规定）。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度进入上市公司中报的集中预告发布期，在市场对三季度经济能否见底仍存分歧下，投资者注意力回到公司业绩基本面上，市场情绪将受到业绩公布影响。从中期来看，尽管市场对投资拉动的长期效果有所顾虑，但当前需求下滑下，财政政策的对冲效果可能更直接，当前弱市震荡行情若有改变需要政策上有新的突破，并释放更多的制度红利。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们继续坚持被动投资的原则，在充分拟合指数的前提下，通过适度增强策略，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，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。

宋磊，投资研究部联席总监，工学硕士，曾在鹏证券、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

本基金的基金经理许之彦作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认

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 年上半年，本基金托管人在对华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2012 年上半年，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	155,780,289.49	54,430,777.86
结算备付金		4,109,071.61	2,059,366.30
存出保证金		1,091,238.22	967,247.87
交易性金融资产	6.4.7.2	4,531,751,669.78	4,206,695,394.76
其中：股票投资		4,427,167,261.78	4,048,587,224.48
基金投资		-	-
债券投资		104,584,408.00	158,108,170.28
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		1,451,768.05	23,356,196.14
应收利息	6.4.7.3	484,088.92	3,699,454.78
应收股利		1,684,430.02	-
应收申购款		2,633,637.12	18,613,309.11
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,698,986,193.21	4,309,821,746.82
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 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		13,432,925.86	-
应付赎回款		4,499,482.69	1,907,707.71
应付管理人报酬		3,940,803.98	3,772,538.68
应付托管费		788,160.81	754,507.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.4	1,800,570.59	1,262,617.25
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	709,538.55	916,160.18
负债合计		25,171,482.48	8,613,531.54

所有者权益：			
实收基金	6.4.7.6	2,103,162,484.84	2,041,287,068.39
未分配利润	6.4.7.7	2,570,652,225.89	2,259,921,146.89
所有者权益合计		4,673,814,710.73	4,301,208,215.28
负债和所有者权益总计		4,698,986,193.21	4,309,821,746.82

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.677 元，基金份额总额 6,902,195,524.66 份。

6.2 利润表

会计主体：华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		270,798,245.03	-143,071,031.94
1. 利息收入		2,438,915.78	3,299,004.97
其中：存款利息收入	6.4.7.8	575,363.82	829,816.90
债券利息收入		1,863,551.96	2,469,188.07
资产支持证券 利息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-89,454,104.40	202,046,180.00
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-134,414,669.32	165,825,238.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	127,713.31	-1,519,942.69
资产支持证券 投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益	6.4.7.11	44,832,851.61	37,740,884.06
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	6.4.7.12	357,813,433.65	-348,416,216.91
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）		-	-
减：二、费用		34,265,386.99	40,952,496.96

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,560,176.78	28,274,984.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,712,035.36	5,654,996.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.13	5,776,437.33	6,807,591.63
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.14	216,737.52	214,924.19
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		236,532,858.04	-184,023,528.90
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		236,532,858.04	-184,023,528.90

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

本报告期: 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 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)	2,041,287,068.39	2,259,921,146.89	4,301,208,215.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	236,532,858.04	236,532,858.04
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)	61,875,416.45	74,198,220.96	136,073,637.41
其中: 1. 基金申购款	423,773,170.78	545,803,440.98	969,576,611.76
2. 基金赎回款	-361,897,754.33	-471,605,220.02	-833,502,974.35
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)	2,103,162,484.84	2,570,652,225.89	4,673,814,710.73
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	2,167,017,577.63	4,047,257,865.54	6,214,275,443.17
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	-184,023,528.90	-184,023,528.90
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)	-205,932,925.29	-437,842,843.45	-643,775,768.74
其中：1. 基金申购款	455,810,637.99	792,840,733.71	1,248,651,371.70
2. 基金赎回款	-661,743,563.28	-1,230,683,577.16	-1,892,427,140.44
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)	-	-71,195,469.37	-71,195,469.37
五、期末所有者权益 (基金净值)	1,961,084,652.34	3,354,196,023.82	5,315,280,676.16

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勃，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(2006 年 1 月 9 日前原名为华安上证 180 指数增强型证券投资基金，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”)证监基金字[2002]第 70 号《关于同意华安上证 180 指数增强型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《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金契约》(后变更为《华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金合同》)发起，并于 2002 年 11 月 8 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 3,094,001,258.61 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(2002)

第 126 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据 2006 年 1 月 14 日发布的《关于华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果的公告》，并经中国证监会证监基金字[2006]8 号《关于核准华安上证 180 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，本基金自 2006 年 1 月 9 日起更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金，跟踪标的的成份指数由上证 180 指数变更为 MSCI 中国 A 股指数。

根据《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》和《关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金份额拆分比例的公告》的有关规定，本基金于 2008 年 4 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 3.281806547，并于 2008 年 4 月 30 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于由权威机构发布的、代表中国 A 股市场的 MSCI 中国 A 股指数的成份股。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；此外，本基金可参与股票一级市场的市值配售及标的指数成份股的增发和配股，在成份股之外的股票投资仅限于未售出的配售新股、预期将调整入指数成份股的个股以及增强型投资中替代成份股的其他个股。本基金持有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%。本基金的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+金融同业存款利率×5%。

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 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规

定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年上半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 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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。

6.4.5 差错更正的说明

无。

6.4.6 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收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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	155,780,289.49
定期存款	-

其他存款	-
合计	155,780,289.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012年6月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,022,839,288.52	4,427,167,261.78	-595,672,026.74
债券	交易所市场	4,032,000.00	4,209,408.00	177,408.00
	银行间市场	100,125,800.00	100,375,000.00	249,200.00
	合计	104,157,800.00	104,584,408.00	426,608.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,126,997,088.52	4,531,751,669.78	-595,245,418.74

6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
应收活期存款利息	25,773.10
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,664.19
应收债券利息	456,124.54
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	527.09
其他	-
合计	484,088.92

6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,797,589.40
银行间市场应付交易费用	2,981.19
合计	1,800,570.59

6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
应付后端申购费	2,675.53
债券利息税	-
预提费用	206,863.02
银行手续费	-
合计	709,538.55

6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,699,334,178.71	2,041,287,068.39
本期申购	1,390,502,694.12	423,773,170.78
本期赎回（以“-”号填列）	-1,187,641,348.17	-361,897,754.33
本期末	6,902,195,524.66	2,103,162,484.84

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.7 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,492,380,389.27	767,540,757.62	2,259,921,146.89
本期利润	-121,280,575.61	357,813,433.65	236,532,858.04
本期基金份额交易产生的变动数	42,795,303.34	31,402,917.62	74,198,220.96
其中：基金申购款	293,955,146.01	251,848,294.97	545,803,440.98
基金赎回款	-251,159,842.67	-220,445,377.35	-471,605,220.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,413,895,117.00	1,156,757,108.89	2,570,652,225.89

6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	534,882.54
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	25,399.50
其他	15,081.78
合计	575,363.82

6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	1,832,417,431.53
减：卖出股票成本总额	1,966,832,100.85
买卖股票差价收入	-134,414,669.32

6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	163,372,987.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	158,118,120.00
减：应收利息总额	5,127,154.01
债券投资收益	127,713.31

6.4.7.11 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	44,832,851.61
基金投资产生的股利收益	-
合计	44,832,851.61

6.4.7.12 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	357,813,433.65
——股票投资	357,376,875.93
——债券投资	436,557.72
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-

合计	357,813,433.65
----	----------------

6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	5,775,887.33
银行间市场交易费用	550.00
合计	5,776,437.33

6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	57,683.08
信息披露费	149,179.94
银行汇划费用	874.50
帐户维护费	9,000.00
合计	216,737.52

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

无。

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,560,176.78	28,274,984.35
其中：支付销售机构的客户维护费	936,399.46	1,059,206.96

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 1.0% 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 X 1.0% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,712,035.36	5,654,996.79

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 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 0.2% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	155,780,289.49	534,882.54	130,601,081.80	763,294.73

注：本基金的银行存款由基金托管人 中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只指数化增强型投资的开放式基金，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合，属于高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过控制股票投资组合相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为

核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 0.09% (2011 年 12 月 31 日：0.08%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能

自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012年6 月30日	1年以内	1-5 年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	155,780,289.49	-	-	-	155,780,289.49
结算备付金	4,109,071.61	-	-	-	4,109,071.61
存出保证金	-	-	-	1,091,238.22	1,091,238.22
交易性金融资产	104,584,408.00	-	-	4,427,167,261.78	4,531,751,669.78
应收证券清算款	-	-	-	1,451,768.05	1,451,768.05
应收利息	-	-	-	484,088.92	484,088.92
应收申购	1,066,126.80	-	-	1,567,510.32	2,633,637.12

款					
应收股利	-	-	-	1,684,430.02	1,684,430.02
资产总计	265,539,895.90	-	-	4,433,446,297.31	4,698,986,193.21
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,499,482.69	4,499,482.69
应付管理人报酬	-	-	-	3,940,803.98	3,940,803.98
应付托管费	-	-	-	788,160.81	788,160.81
应付交易费用	-	-	-	1,800,570.59	1,800,570.59
应付证券清算款	-	-	-	13,432,925.86	13,432,925.86
其他负债	-	-	-	709,538.55	709,538.55
负债总计	-	-	-	25,171,482.48	25,171,482.48
利率敏感度缺口	265,539,895.90	-	-	4,408,274,814.83	4,673,814,710.73
上年度末 2011年12 月31日	1年以内	1-5 年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	54,430,777.86	-	-	-	54,430,777.86
结算备付金	2,059,366.30	-	-	-	2,059,366.30
存出保证金	-	-	-	967,247.87	967,247.87
交易性金融资产	154,784,000.00	-	3,324,170.28	4,048,587,224.48	4,206,695,394.76
应收证券清算款	-	-	-	23,356,196.14	23,356,196.14
应收利息	-	-	-	3,699,454.78	3,699,454.78
应收申购款	16,289,169.33	-	-	2,324,139.78	18,613,309.11

应收股利	-	-	-	-	-
资产总计	227,563,313.49	-	3,324,170.28	4,078,934,263.05	4,309,821,746.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,907,707.71	1,907,707.71
应付管理人报酬	-	-	-	3,772,538.68	3,772,538.68
应付托管费	-	-	-	754,507.72	754,507.72
应付交易费用	-	-	-	1,262,617.25	1,262,617.25
应付证券清算款	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	916,160.18	916,160.18
负债总计	-	-	-	8,613,531.54	8,613,531.54
利率敏感度缺口	227,563,313.49	-	3,324,170.28	4,070,320,731.51	4,301,208,215.28

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.24%(2011 年 12 月 31 日：3.68%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以 MSCI 中国 A 股指数成份股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验

该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。同时，本基金根据股票市场的具体情况，对投资组合的股票仓位、行业及个股、权重进行适当的调整以达到相对 MSCI 中国 A 股指数有限度的偏离。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于 MSCI 中国 A 股指数的成份股，投资组合中股票投资的目标比例为基金资产净值的 95%，投资标的指数成份股的比重在 50 个交易日内不持续低于股票净值的 80%；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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,427,167,261.78	94.72	4,048,587,224.48	94.13
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,427,167,261.78	94.72	4,048,587,224.48	94.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 23,838.00 万元	增加约 21,487.00 万元
	业绩比较基准下降 5%	减少约 23,838.00 万元	减少约 21,487.00 万元

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 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	4,427,167,261.78	94.22
	其中：股票	4,427,167,261.78	94.22
2	固定收益投资	104,584,408.00	2.23
	其中：债券	104,584,408.00	2.23
	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	159,889,361.10	3.40
6	其他各项资产	7,345,162.33	0.16
7	合计	4,698,986,193.21	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资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	43,129,525.86	0.92
B	采掘业	395,578,453.71	8.46
C	制造业	1,701,494,916.93	36.40
C0	食品、饮料	372,697,200.38	7.97
C1	纺织、服装、皮毛	24,107,575.55	0.52
C2	木材、家具	4,223,582.55	0.09
C3	造纸、印刷	1,175,639.61	0.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	85,930,771.66	1.84
C5	电子	103,987,739.06	2.22
C6	金属、非金属	323,458,672.50	6.92
C7	机械、设备、仪表	487,082,716.23	10.42
C8	医药、生物制品	296,039,983.07	6.33
C99	其他制造业	2,791,036.32	0.06

D	电力、煤气及水的生产和供应业	88,948,281.33	1.90
E	建筑业	133,634,959.79	2.86
F	交通运输、仓储业	167,833,359.35	3.59
G	信息技术业	113,521,474.97	2.43
H	批发和零售贸易	126,799,139.66	2.71
I	金融、保险业	1,127,447,439.35	24.12
J	房地产业	325,166,774.88	6.96
K	社会服务业	88,117,490.84	1.89
L	传播与文化产业	34,295,468.60	0.73
M	综合类	80,701,808.51	1.73
	合计	4,426,669,093.78	94.71

7.2.2 积极资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	-	-
C	制造业	498,168.00	0.01
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	-	-
C5	电子	498,168.00	0.01
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
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	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-

	合计	498,168.00	0.01
--	----	------------	------

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 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	600036	招商银行	10,504,580	114,710,013.60	2.45
2	601166	兴业银行	8,280,371	107,479,215.58	2.30
3	600030	中信证券	8,301,248	104,844,762.24	2.24
4	600016	民生银行	16,910,049	101,291,193.51	2.17
5	601318	中国平安	2,071,934	94,770,261.16	2.03
6	600048	保利地产	8,082,471	91,655,221.14	1.96
7	000858	五粮液	2,688,818	88,085,677.68	1.88
8	601601	中国太保	3,939,322	87,374,161.96	1.87
9	600837	海通证券	8,880,474	85,518,964.62	1.83
10	600519	贵州茅台	337,833	80,792,761.95	1.73
11	000002	万科A	7,720,366	68,788,461.06	1.47
12	601628	中国人寿	3,540,920	64,798,836.00	1.39
13	600000	浦发银行	7,452,745	60,590,816.85	1.30
14	000001	深发展A	3,441,813	52,177,885.08	1.12
15	601328	交通银行	11,226,710	50,969,263.40	1.09
16	600104	上汽集团	3,432,216	49,046,366.64	1.05
17	600019	宝钢股份	10,633,351	45,936,076.32	0.98
18	000895	双汇发展	704,147	43,572,616.36	0.93
19	601088	中国神华	1,838,863	41,337,640.24	0.88
20	601668	中国建筑	11,900,598	39,747,997.32	0.85
21	600029	南方航空	8,416,326	38,799,262.86	0.83
22	600015	华夏银行	4,052,526	38,377,421.22	0.82
23	000776	广发证券	1,276,523	38,078,681.09	0.81
24	600031	三一重工	2,681,371	37,324,684.32	0.80
25	600111	包钢稀土	923,945	36,458,869.70	0.78
26	000423	东阿阿胶	907,674	36,316,036.74	0.78
27	600547	山东黄金	1,092,033	35,862,363.72	0.77
28	000651	格力电器	1,629,296	33,970,821.60	0.73
29	600395	盘江股份	1,132,623	30,444,906.24	0.65
30	002155	辰州矿业	1,476,567	28,586,337.12	0.61

31	000568	泸州老窖	675,015	28,559,884.65	0.61
32	600887	伊利股份	1,383,146	28,465,144.68	0.61
33	000527	美的电器	2,528,002	27,934,422.10	0.60
34	600060	海信电器	1,536,656	25,831,187.36	0.55
35	600079	人福医药	1,096,322	25,423,707.18	0.54
36	002304	洋河股份	188,493	25,361,733.15	0.54
37	600518	康美药业	1,555,518	23,986,087.56	0.51
38	000024	招商地产	931,333	22,845,598.49	0.49
39	000538	云南白药	377,545	22,380,867.60	0.48
40	600383	金地集团	3,379,351	21,898,194.48	0.47
41	601117	中国化学	3,749,964	21,637,292.28	0.46
42	600123	兰花科创	1,132,500	20,452,950.00	0.44
43	000630	铜陵有色	1,021,166	19,708,503.80	0.42
44	000063	中兴通讯	1,406,984	19,641,496.64	0.42
45	000157	中联重科	1,945,115	19,509,503.45	0.42
46	000961	中南建设	1,510,493	18,820,742.78	0.40
47	601006	大秦铁路	2,665,666	18,739,631.98	0.40
48	000069	华侨城 A	2,886,159	18,413,694.42	0.39
49	600276	恒瑞医药	618,101	17,745,679.71	0.38
50	600583	海油工程	2,853,421	17,377,333.89	0.37
51	600196	复星医药	1,678,859	17,309,036.29	0.37
52	600068	葛洲坝	2,650,252	17,306,145.56	0.37
53	600690	青岛海尔	1,473,882	17,273,897.04	0.37
54	601009	南京银行	2,007,327	17,102,426.04	0.37
55	002024	苏宁电器	1,915,443	16,070,566.77	0.34
56	600489	中金黄金	735,929	15,837,192.08	0.34
57	000778	新兴铸管	2,348,358	15,710,515.02	0.34
58	600266	北京城建	1,018,330	15,468,432.70	0.33
59	601888	中国国旅	542,090	15,297,779.80	0.33
60	600256	广汇能源	1,132,400	15,253,428.00	0.33
61	601939	建设银行	3,608,565	15,155,973.00	0.32
62	600570	恒生电子	1,090,160	14,956,995.20	0.32
63	601808	中海油服	894,020	14,760,270.20	0.32
64	600809	山西汾酒	388,844	14,655,530.36	0.31
65	600765	中航重机	1,891,768	14,585,531.28	0.31
66	000338	潍柴动力	486,128	14,433,140.32	0.31
67	601866	中海集运	5,697,382	14,414,376.46	0.31
68	000401	冀东水泥	1,019,955	14,340,567.30	0.31
69	600900	长江电力	2,097,407	14,262,367.60	0.31
70	000917	电广传媒	568,065	14,048,247.45	0.30
71	600585	海螺水泥	933,916	13,840,635.12	0.30

72	000629	攀钢钒钛	2,099,850	13,817,013.00	0.30
73	002065	东华软件	622,089	13,810,375.80	0.30
74	600600	青岛啤酒	352,262	13,452,885.78	0.29
75	600546	山煤国际	638,125	13,349,575.00	0.29
76	601633	长城汽车	734,497	13,074,046.60	0.28
77	600153	建发股份	1,814,937	12,994,948.92	0.28
78	000792	盐湖股份	384,682	12,990,711.14	0.28
79	600348	阳泉煤业	846,309	12,948,527.70	0.28
80	002069	獐子岛	620,452	12,936,424.20	0.28
81	002106	莱宝高科	636,987	12,784,329.09	0.27
82	600115	东方航空	3,043,310	12,721,035.80	0.27
83	002038	双鹭药业	393,665	12,676,013.00	0.27
84	601699	潞安环能	601,298	12,470,920.52	0.27
85	601390	中国中铁	4,827,065	12,405,557.05	0.27
86	000402	金融街	1,871,227	12,219,112.31	0.26
87	601688	华泰证券	1,160,046	12,180,483.00	0.26
88	600875	东方电气	678,245	12,154,150.40	0.26
89	600549	厦门钨业	274,145	12,037,706.95	0.26
90	600805	悦达投资	1,287,429	12,011,712.57	0.26
91	600999	招商证券	1,033,857	12,003,079.77	0.26
92	000983	西山煤电	765,912	11,948,227.20	0.26
93	002001	新和成	563,514	11,907,050.82	0.25
94	601169	北京银行	1,210,299	11,824,621.23	0.25
95	000623	吉林敖东	673,923	11,685,824.82	0.25
96	000009	中国宝安	1,167,320	11,673,200.00	0.25
97	600406	国电南瑞	624,116	11,664,728.04	0.25
98	601989	中国重工	2,242,235	11,637,199.65	0.25
99	600739	辽宁成大	744,624	11,616,134.40	0.25
100	000999	华润三九	530,731	11,596,472.35	0.25
101	601168	西部矿业	1,351,430	11,568,240.80	0.25
102	600795	国电电力	4,160,116	11,232,313.20	0.24
103	601098	中南传媒	1,153,628	11,051,756.24	0.24
104	000758	中色股份	577,408	10,953,429.76	0.23
105	000826	桑德环境	477,593	10,936,879.70	0.23
106	601899	紫金矿业	2,806,943	10,890,938.84	0.23
107	000970	中科三环	272,036	10,794,388.48	0.23
108	600089	特变电工	1,588,517	10,754,260.09	0.23
109	600535	天士力	244,882	10,706,241.04	0.23
110	600309	烟台万华	787,701	10,515,808.35	0.22
111	002146	荣盛发展	963,917	10,506,695.30	0.22
112	000783	长江证券	1,152,283	10,485,775.30	0.22

113	600100	同方股份	1,207,881	10,170,358.02	0.22
114	601766	中国南车	2,174,717	9,916,709.52	0.21
115	601607	上海医药	918,314	9,798,410.38	0.21
116	600588	用友软件	632,768	9,656,039.68	0.21
117	601998	中信银行	2,412,202	9,648,808.00	0.21
118	600160	巨化股份	955,117	9,646,681.70	0.21
119	000876	新希望	643,148	9,634,357.04	0.21
120	002353	杰瑞股份	198,399	9,622,351.50	0.21
121	601111	中国国航	1,560,742	9,598,563.30	0.21
122	600138	中青旅	530,876	9,545,150.48	0.20
123	600166	福田汽车	1,317,984	9,423,585.60	0.20
124	601666	平煤股份	928,583	9,397,259.96	0.20
125	600058	五矿发展	412,951	9,221,195.83	0.20
126	601788	光大证券	700,000	9,219,000.00	0.20
127	000926	福星股份	986,686	9,215,647.24	0.20
128	000729	燕京啤酒	1,259,442	9,193,926.60	0.20
129	600252	中恒集团	832,770	9,127,159.20	0.20
130	601618	中国中冶	3,563,014	8,836,274.72	0.19
131	000060	中金岭南	1,024,590	8,831,965.80	0.19
132	000933	神火股份	953,238	8,693,530.56	0.19
133	000581	威孚高科	315,634	8,648,371.60	0.19
134	600177	雅戈尔	1,013,838	8,607,484.62	0.18
135	600366	宁波韵升	412,721	8,568,087.96	0.18
136	000425	徐工机械	588,486	8,438,889.24	0.18
137	600208	新潮中宝	2,040,139	8,425,774.07	0.18
138	601958	金钼股份	664,242	8,415,946.14	0.18
139	600642	申能股份	1,824,825	8,412,443.25	0.18
140	601898	中煤能源	1,024,712	7,931,270.88	0.17
141	000039	中集集团	593,347	7,891,515.10	0.17
142	000768	西飞国际	986,068	7,740,633.80	0.17
143	600066	宇通客车	342,235	7,686,598.10	0.16
144	600673	东阳光铝	844,807	7,561,022.65	0.16
145	600261	阳光照明	627,810	7,470,939.00	0.16
146	600879	航天电子	944,199	7,440,288.12	0.16
147	600018	上港集团	2,794,844	7,434,285.04	0.16
148	601333	广深铁路	2,520,072	7,409,011.68	0.16
149	002041	登海种业	356,138	7,404,109.02	0.16
150	000400	许继电气	472,001	7,396,255.67	0.16
151	600143	金发科技	1,234,888	7,372,281.36	0.16
152	600010	包钢股份	1,504,684	7,342,857.92	0.16
153	600458	时代新材	583,937	7,328,409.35	0.16

154	000800	一汽轿车	657,713	7,142,763.18	0.15
155	600150	中国船舶	307,843	7,071,153.71	0.15
156	000937	冀中能源	461,053	7,040,279.31	0.15
157	600881	亚泰集团	1,252,017	6,886,093.50	0.15
158	000877	天山股份	701,490	6,839,527.50	0.15
159	600660	福耀玻璃	861,151	6,734,200.82	0.14
160	600062	华润双鹤	349,154	6,661,858.32	0.14
161	000541	佛山照明	770,924	6,653,074.12	0.14
162	600362	江西铜业	277,782	6,641,767.62	0.14
163	000969	安泰科技	539,535	6,598,513.05	0.14
164	600415	小商品城	845,033	6,591,257.40	0.14
165	601336	新华保险	190,000	6,505,600.00	0.14
166	600888	新疆众和	629,697	6,504,770.01	0.14
167	000012	南玻A	721,757	6,495,813.00	0.14
168	000718	苏宁环球	797,479	6,459,579.90	0.14
169	000422	湖北宜化	526,731	6,452,454.75	0.14
170	600703	三安光电	471,819	6,421,456.59	0.14
171	002236	大华股份	208,744	6,408,440.80	0.14
172	600581	八一钢铁	969,998	6,392,286.82	0.14
173	600895	张江高科	743,170	6,368,966.90	0.14
174	000963	华东医药	209,587	6,329,527.40	0.14
175	000006	深振业A	1,100,000	6,281,000.00	0.13
176	600125	铁龙物流	731,830	6,205,918.40	0.13
177	000625	长安汽车	1,262,940	6,163,147.20	0.13
178	000825	太钢不锈	1,729,562	6,105,353.86	0.13
179	600827	友谊股份	538,602	6,091,588.62	0.13
180	600161	天坛生物	420,095	5,994,755.65	0.13
181	002152	广电运通	363,134	5,991,711.00	0.13
182	601857	中国石油	660,567	5,978,131.35	0.13
183	601877	正泰电器	389,375	5,941,862.50	0.13
184	600893	航空动力	455,349	5,924,090.49	0.13
185	000709	河北钢铁	2,162,879	5,904,659.67	0.13
186	600497	驰宏锌锗	418,529	5,888,703.03	0.13
187	600216	浙江医药	233,919	5,883,062.85	0.13
188	000860	顺鑫农业	366,316	5,868,382.32	0.13
189	601717	郑煤机	504,500	5,852,200.00	0.13
190	600005	武钢股份	2,175,260	5,851,449.40	0.13
191	000562	宏源证券	352,167	5,824,842.18	0.12
192	600635	大众公用	1,247,440	5,813,070.40	0.12
193	002007	华兰生物	235,492	5,788,393.36	0.12
194	600649	城投控股	798,529	5,765,379.38	0.12

195	600320	振华重工	1,362,158	5,748,306.76	0.12
196	000027	深圳能源	886,390	5,734,943.30	0.12
197	600259	广晟有色	86,749	5,719,361.57	0.12
198	600655	豫园商城	725,046	5,713,362.48	0.12
199	000417	合肥百货	454,787	5,707,576.85	0.12
200	600839	四川长虹	2,669,616	5,632,889.76	0.12
201	600085	同仁堂	321,389	5,608,238.05	0.12
202	002375	亚厦股份	226,281	5,586,877.89	0.12
203	000869	张裕A	82,388	5,541,416.88	0.12
204	601918	国投新集	449,286	5,485,782.06	0.12
205	600859	王府井	195,500	5,348,880.00	0.11
206	600717	天津港	835,779	5,282,123.28	0.11
207	000061	农产品	910,623	5,281,613.40	0.11
208	601872	招商轮船	1,638,712	5,276,652.64	0.11
209	600221	海南航空	1,064,646	5,195,472.48	0.11
210	000878	云南铜业	288,549	5,165,027.10	0.11
211	600674	川投能源	738,412	5,109,811.04	0.11
212	600008	首创股份	1,043,227	5,101,380.03	0.11
213	600239	云南城投	600,628	5,099,331.72	0.11
214	000501	鄂武商A	341,464	5,080,984.32	0.11
215	600157	永泰能源	557,622	5,063,207.76	0.11
216	000759	中百集团	680,069	5,059,713.36	0.11
217	601001	大同煤业	458,439	5,019,907.05	0.11
218	600970	中材国际	430,752	4,970,878.08	0.11
219	600694	大商股份	148,549	4,968,964.05	0.11
220	600611	大众交通	942,700	4,939,748.00	0.11
221	000726	鲁泰A	678,405	4,911,652.20	0.11
222	000539	粤电力A	743,446	4,906,743.60	0.10
223	600195	中牧股份	286,843	4,893,541.58	0.10
224	000962	东方钨业	365,969	4,889,345.84	0.10
225	600376	首开股份	368,770	4,882,514.80	0.10
226	600811	东方集团	890,415	4,879,474.20	0.10
227	600271	航天信息	253,603	4,795,632.73	0.10
228	000652	泰达股份	1,207,516	4,721,387.56	0.10
229	002004	华邦制药	209,025	4,703,062.50	0.10
230	600997	开滦股份	447,359	4,683,848.73	0.10
231	600467	好当家	659,451	4,682,102.10	0.10
232	600499	科达机电	452,391	4,650,579.48	0.10
233	600426	华鲁恒升	624,914	4,618,114.46	0.10
234	002022	科华生物	421,234	4,570,388.90	0.10
235	000559	万向钱潮	904,977	4,552,034.31	0.10

236	000960	锡业股份	230,124	4,533,442.80	0.10
237	600500	中化国际	665,121	4,496,217.96	0.10
238	600582	天地科技	306,945	4,435,355.25	0.09
239	601669	中国水电	1,000,000	4,370,000.00	0.09
240	000998	隆平高科	243,300	4,338,039.00	0.09
241	600770	综艺股份	374,831	4,303,059.88	0.09
242	600750	江中药业	153,308	4,278,826.28	0.09
243	000939	凯迪电力	500,000	4,240,000.00	0.09
244	600978	宜华木业	892,935	4,223,582.55	0.09
245	600737	中粮屯河	708,133	4,220,472.68	0.09
246	002008	大族激光	668,454	4,197,891.12	0.09
247	000680	山推股份	716,376	4,190,799.60	0.09
248	600432	吉恩镍业	314,871	4,181,486.88	0.09
249	000807	云铝股份	706,844	4,163,311.16	0.09
250	002081	金螳螂	109,274	4,152,412.00	0.09
251	000528	柳工	331,801	4,117,650.41	0.09
252	000762	西藏矿业	286,290	4,099,672.80	0.09
253	600685	广船国际	273,912	4,040,202.00	0.09
254	002129	中环股份	310,000	3,983,500.00	0.09
255	600598	北大荒	533,628	3,975,528.60	0.09
256	600816	安信信托	236,606	3,932,391.72	0.08
257	600108	亚盛集团	796,134	3,924,940.62	0.08
258	000839	中信国安	581,367	3,906,786.24	0.08
259	000540	中天城投	526,998	3,889,245.24	0.08
260	600011	华能国际	594,840	3,836,718.00	0.08
261	000786	北新建材	293,965	3,803,907.10	0.08
262	002422	科伦药业	81,484	3,802,043.44	0.08
263	002142	宁波银行	377,892	3,771,362.16	0.08
264	600199	金种子酒	150,339	3,755,468.22	0.08
265	601101	昊华能源	219,056	3,750,238.72	0.08
266	600009	上海机场	293,612	3,740,616.88	0.08
267	601991	大唐发电	662,777	3,731,434.51	0.08
268	600267	海正药业	210,862	3,685,867.76	0.08
269	002029	七匹狼	132,041	3,670,739.80	0.08
270	600858	银座股份	311,030	3,663,933.40	0.08
271	600961	株冶集团	370,954	3,650,187.36	0.08
272	600037	歌华有线	482,687	3,634,633.11	0.08
273	600636	三爱富	187,388	3,625,957.80	0.08
274	600269	赣粤高速	965,691	3,611,684.34	0.08
275	600741	华域汽车	401,669	3,602,970.93	0.08
276	600268	国电南自	400,000	3,572,000.00	0.08

277	000900	现代投资	249,147	3,547,853.28	0.08
278	002051	中工国际	132,417	3,516,995.52	0.08
279	600787	中储股份	396,002	3,516,497.76	0.08
280	600312	平高电气	496,559	3,475,913.00	0.07
281	000046	泛海建设	774,770	3,463,221.90	0.07
282	600884	杉杉股份	289,638	3,443,795.82	0.07
283	002123	荣信股份	302,033	3,434,115.21	0.07
284	600170	上海建工	473,102	3,415,796.44	0.07
285	600657	信达地产	766,787	3,396,866.41	0.07
286	600369	西南证券	300,000	3,393,000.00	0.07
287	600307	酒钢宏兴	976,636	3,388,926.92	0.07
288	002028	思源电气	305,073	3,383,259.57	0.07
289	600528	中铁二局	490,099	3,313,069.24	0.07
290	002465	海格通信	145,662	3,291,961.20	0.07
291	000973	佛塑科技	703,803	3,272,683.95	0.07
292	600117	西宁特钢	585,623	3,267,776.34	0.07
293	002344	海宁皮城	124,337	3,242,708.96	0.07
294	600220	江苏阳光	1,063,753	3,223,171.59	0.07
295	600572	康恩贝	300,000	3,189,000.00	0.07
296	600886	国投电力	734,679	3,188,506.86	0.07
297	600863	内蒙华电	396,546	3,132,713.40	0.07
298	000816	江淮动力	580,850	3,107,547.50	0.07
299	600718	东软集团	359,985	3,099,470.85	0.07
300	002161	远望谷	400,000	3,096,000.00	0.07
301	000793	华闻传媒	495,300	3,060,954.00	0.07
302	600602	仪电电子	722,377	3,048,430.94	0.07
303	600236	桂冠电力	767,828	3,040,598.88	0.07
304	000513	丽珠集团	109,105	3,032,027.95	0.06
305	002244	滨江集团	333,755	3,027,157.85	0.06
306	600409	三友化工	462,986	3,023,298.58	0.06
307	600436	片仔癀	34,282	3,013,044.98	0.06
308	600704	物产中大	337,938	3,011,027.58	0.06
309	600219	南山铝业	444,693	2,979,443.10	0.06
310	002223	鱼跃医疗	199,505	2,962,649.25	0.06
311	600098	广州控股	428,117	2,962,569.64	0.06
312	002385	大北农	152,061	2,949,983.40	0.06
313	600815	厦工股份	317,563	2,937,457.75	0.06
314	002140	东华科技	150,924	2,905,287.00	0.06
315	600028	中国石化	460,687	2,902,328.10	0.06
316	600183	生益科技	562,617	2,897,477.55	0.06
317	000685	中山公用	196,149	2,861,813.91	0.06

318	600064	南京高科	248,255	2,854,932.50	0.06
319	000028	国药一致	95,449	2,842,471.22	0.06
320	600575	芜湖港	367,193	2,842,073.82	0.06
321	000690	宝新能源	647,119	2,840,852.41	0.06
322	600038	哈飞股份	168,076	2,805,188.44	0.06
323	002168	深圳惠程	301,335	2,796,388.80	0.06
324	600210	紫江企业	677,436	2,791,036.32	0.06
325	000930	中粮生化	569,129	2,765,966.94	0.06
326	600200	江苏吴中	300,000	2,748,000.00	0.06
327	600597	光明乳业	293,910	2,739,241.20	0.06
328	600823	世茂股份	249,457	2,739,037.86	0.06
329	000612	焦作万方	235,744	2,736,987.84	0.06
330	600331	宏达股份	340,216	2,735,336.64	0.06
331	000418	小天鹅 A	321,214	2,727,106.86	0.06
332	600675	中华企业	581,028	2,719,211.04	0.06
333	600804	鹏博士	449,808	2,671,859.52	0.06
334	000089	深圳机场	647,530	2,648,397.70	0.06
335	600820	隧道股份	296,022	2,634,595.80	0.06
336	000968	煤气化	172,607	2,632,256.75	0.06
337	000088	盐田港	637,739	2,601,975.12	0.06
338	600517	置信电气	226,791	2,601,292.77	0.06
339	000550	江铃汽车	121,001	2,583,371.35	0.06
340	600316	洪都航空	195,741	2,550,505.23	0.05
341	600511	国药股份	178,866	2,504,124.00	0.05
342	600880	博瑞传播	250,740	2,499,877.80	0.05
343	600096	云天化	186,081	2,467,434.06	0.05
344	600783	鲁信创投	154,524	2,466,203.04	0.05
345	600176	中国玻纤	249,576	2,453,332.08	0.05
346	600550	天威保变	279,811	2,442,750.03	0.05
347	601299	中国北车	600,449	2,407,800.49	0.05
348	002506	超日太阳	200,000	2,404,000.00	0.05
349	002294	信立泰	88,204	2,381,508.00	0.05
350	601179	中国西电	594,255	2,365,134.90	0.05
351	600072	中船股份	132,400	2,351,424.00	0.05
352	600033	福建高速	988,253	2,332,277.08	0.05
353	600118	中国卫星	184,134	2,318,247.06	0.05
354	000997	新大陆	227,646	2,310,606.90	0.05
355	600282	南钢股份	919,154	2,307,076.54	0.05
356	000988	华工科技	167,460	2,305,924.20	0.05
357	600251	冠农股份	123,016	2,304,089.68	0.05
358	600004	白云机场	337,888	2,301,017.28	0.05

359	000830	鲁西化工	506,543	2,299,705.22	0.05
360	601588	北辰实业	798,268	2,275,063.80	0.05
361	600748	上实发展	373,343	2,243,791.43	0.05
362	601186	中国铁建	500,000	2,225,000.00	0.05
363	000021	长城开发	412,375	2,218,577.50	0.05
364	601718	际华集团	700,000	2,212,000.00	0.05
365	002237	恒邦股份	55,205	2,151,890.90	0.05
366	600755	厦门国贸	429,337	2,146,685.00	0.05
367	600026	中海发展	423,854	2,140,462.70	0.05
368	600835	上海机电	243,405	2,124,925.65	0.05
369	601377	兴业证券	200,000	2,096,000.00	0.04
370	600662	强生控股	482,705	2,094,939.70	0.04
371	000987	广州友谊	157,308	2,079,611.76	0.04
372	601018	宁波港	800,000	2,024,000.00	0.04
373	000596	古井贡酒	42,786	2,021,210.64	0.04
374	600663	陆家嘴	164,346	2,016,525.42	0.04
375	600481	双良节能	279,970	2,004,585.20	0.04
376	002230	科大讯飞	101,276	1,995,137.20	0.04
377	600595	中孚实业	353,020	1,969,851.60	0.04
378	600188	兖州煤业	103,470	1,963,860.60	0.04
379	002408	齐翔腾达	120,000	1,951,200.00	0.04
380	600435	北方导航	244,986	1,918,240.38	0.04
381	002249	大洋电机	199,983	1,859,841.90	0.04
382	600456	宝钛股份	96,370	1,808,864.90	0.04
383	600812	华北制药	279,848	1,779,833.28	0.04
384	000932	华菱钢铁	721,355	1,760,106.20	0.04
385	002063	远光软件	120,297	1,745,509.47	0.04
386	600315	上海家化	44,544	1,737,661.44	0.04
387	002241	歌尔声学	47,073	1,717,693.77	0.04
388	600971	恒源煤电	122,632	1,708,263.76	0.04
389	600311	荣华实业	212,172	1,697,376.00	0.04
390	600141	兴发集团	82,029	1,697,180.01	0.04
391	600298	安琪酵母	68,360	1,682,339.60	0.04
392	000598	兴蓉投资	206,416	1,682,290.40	0.04
393	002310	东方园林	27,846	1,634,838.66	0.03
394	002056	横店东磁	98,449	1,567,308.08	0.03
395	600410	华胜天成	190,581	1,562,764.20	0.03
396	600808	马钢股份	724,872	1,551,226.08	0.03
397	600729	重庆百货	53,870	1,520,211.40	0.03
398	601107	四川成渝	435,324	1,506,221.04	0.03
399	601919	中国远洋	323,766	1,502,274.24	0.03

400	601268	二重重装	243,908	1,495,156.04	0.03
401	000686	东北证券	84,550	1,449,187.00	0.03
402	002405	四维图新	120,000	1,432,800.00	0.03
403	000683	远兴能源	251,454	1,420,715.10	0.03
404	601106	中国一重	435,950	1,377,602.00	0.03
405	002179	中航光电	99,962	1,371,478.64	0.03
406	600050	中国联通	355,193	1,321,317.96	0.03
407	002431	棕榈园林	50,775	1,309,487.25	0.03
408	000650	仁和药业	147,630	1,266,665.40	0.03
409	600027	华电国际	300,000	1,257,000.00	0.03
410	600132	重庆啤酒	57,671	1,245,116.89	0.03
411	601678	滨化股份	115,820	1,234,641.20	0.03
412	002122	天马股份	187,971	1,214,292.66	0.03
413	600380	健康元	244,041	1,193,360.49	0.03
414	002078	太阳纸业	200,693	1,157,998.61	0.02
415	600844	丹化科技	92,242	1,153,947.42	0.02
416	600601	方正科技	452,740	1,136,377.40	0.02
417	002250	联化科技	65,000	1,121,250.00	0.02
418	600825	新华传媒	180,971	1,074,967.74	0.02
419	002092	中泰化学	133,399	1,020,502.35	0.02
420	601288	农业银行	372,054	963,619.86	0.02
421	000667	名流置业	440,183	950,795.28	0.02
422	000887	中鼎股份	100,000	849,000.00	0.02
423	600169	太原重工	238,338	836,566.38	0.02
424	600020	中原高速	339,103	834,193.38	0.02
425	600664	哈药股份	123,867	816,283.53	0.02
426	601818	光大银行	286,721	814,287.64	0.02
427	600078	澄星股份	99,166	812,169.54	0.02
428	600428	中远航运	198,959	809,763.13	0.02
429	600270	外运发展	112,039	797,717.68	0.02
430	000655	金岭矿业	66,708	749,130.84	0.02
431	600801	华新水泥	59,593	746,104.36	0.02
432	600509	天富热电	92,290	730,936.80	0.02
433	600747	大连控股	143,747	671,298.49	0.01
434	000951	中国重汽	48,618	590,222.52	0.01
435	600569	安阳钢铁	242,749	587,452.58	0.01
436	001696	宗申动力	95,773	566,976.16	0.01
437	000059	辽通化工	69,988	553,605.08	0.01
438	600522	中天科技	63,920	545,237.60	0.01
439	000897	津滨发展	163,830	468,553.80	0.01
440	000503	海虹控股	76,684	445,534.04	0.01

441	600006	东风汽车	125,663	395,838.45	0.01
442	600122	宏图高科	84,816	385,064.64	0.01
443	600418	江淮汽车	68,448	370,303.68	0.01
444	000829	天音控股	53,230	347,059.60	0.01
445	002293	罗莱家纺	3,301	246,254.60	0.01
446	600720	祁连山	16,888	176,817.36	0.00
447	000728	国元证券	8,754	95,506.14	0.00
448	000066	长城电脑	20,300	79,982.00	0.00
449	000522	白云山 A	3,610	73,427.40	0.00
450	002005	德豪润达	5,988	46,586.64	0.00
451	600054	黄山旅游	3,038	45,357.34	0.00
452	000780	平庄能源	3,605	37,780.40	0.00
453	600637	百视通	1,437	18,824.70	0.00
454	600069	银鸽投资	2,990	17,641.00	0.00
455	000518	四环生物	2,910	12,978.60	0.00
456	600158	中体产业	960	7,363.20	0.00
457	000572	海马汽车	2,062	6,722.12	0.00
458	600521	华海药业	346	5,228.06	0.00
459	600736	苏州高新	872	4,935.52	0.00
460	600439	瑞贝卡	826	4,476.92	0.00
461	600724	宁波富达	571	4,442.38	0.00
462	600121	郑州煤电	449	3,520.16	0.00
463	600773	西藏城投	257	3,248.48	0.00
464	600139	西部资源	323	2,968.37	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资 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	600584	长电科技	103,785	498,168.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金 资产净值比 例（%）
1	600837	海通证券	85,141,124.74	1.98

2	601166	兴业银行	82,128,997.28	1.91
3	000527	美的电器	69,240,959.95	1.61
4	601628	中国人寿	68,245,603.99	1.59
5	000858	五粮液	60,116,786.98	1.40
6	600030	中信证券	53,836,000.47	1.25
7	600048	保利地产	52,540,425.43	1.22
8	600019	宝钢股份	45,964,695.55	1.07
9	601088	中国神华	43,014,677.45	1.00
10	000776	广发证券	42,631,060.96	0.99
11	600104	上汽集团	39,854,590.05	0.93
12	000895	双汇发展	39,629,205.00	0.92
13	601601	中国太保	38,133,614.37	0.89
14	600015	华夏银行	37,985,179.59	0.88
15	000401	冀东水泥	37,958,898.43	0.88
16	600029	南方航空	36,111,808.69	0.84
17	600395	盘江股份	35,343,018.58	0.82
18	600585	海螺水泥	34,668,459.91	0.81
19	600519	贵州茅台	34,635,321.31	0.81
20	000937	冀中能源	32,215,568.04	0.75

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600887	伊利股份	61,025,765.55	1.42
2	600837	海通证券	56,371,046.43	1.31
3	000858	五粮液	54,538,330.84	1.27
4	601601	中国太保	52,876,213.37	1.23
5	600028	中国石化	46,989,162.07	1.09
6	000527	美的电器	45,638,013.90	1.06
7	600519	贵州茅台	42,522,026.57	0.99
8	601166	兴业银行	41,445,719.69	0.96
9	601088	中国神华	39,192,837.37	0.91
10	601288	农业银行	35,250,375.14	0.82
11	000937	冀中能源	34,361,271.94	0.80
12	600383	金地集团	33,230,963.34	0.77
13	601699	潞安环能	31,744,942.89	0.74
14	600585	海螺水泥	31,282,167.32	0.73
15	601106	中国一重	29,994,084.32	0.70
16	600276	恒瑞医药	29,915,531.84	0.70

17	600009	上海机场	29,328,034.67	0.68
18	600050	中国联通	28,856,035.49	0.67
19	000401	冀东水泥	27,764,054.60	0.65
20	600062	华润双鹤	26,226,449.33	0.61

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。

7.4.3 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	1,988,035,262.22
卖出股票的收入（成交）总额	1,832,417,431.53

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。

7.5 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	50,025,000.00	1.07
3	金融债券	50,350,000.00	1.08
	其中：政策性金融债	50,350,000.00	1.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,209,408.00	0.09
8	其他	-	-
9	合计	104,584,408.00	2.24

7.6 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	110307	11 进出 07	500,000	50,350,000.00	1.08
2	1001037	10 央票 37	500,000	50,025,000.00	1.07
3	113003	重工转债	40,320	4,209,408.00	0.09

7.7 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

无。

7.8 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

无。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内，基金投资的前十名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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	1,091,238.22
2	应收证券清算款	1,451,768.05
3	应收股利	1,684,430.02
4	应收利息	484,088.92
5	应收申购款	2,633,637.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,345,162.33

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.9.5.1 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未出现流通受限情况。

7.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

期末积极投资前五名股票中未出现流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
221,318	31,186.78	1,855,227,393.00	26.88%	5,046,968,132.00	73.12%

8.2 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	2,690,933.24	0.04%

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。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2002 年 11 月 8 日) 基金份额总额	3,094,001,262.00
本报告期期初基金份额总额	6,699,334,178.71
本报告期基金总申购份额	1,390,502,694.12
减：本报告期基金总赎回份额	1,187,641,348.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,902,195,524.66

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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：

2012 年 2 月 3 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，尚志民先生任华安基金管理有限公司副总经理。尚志民先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	佣金	占当期佣金总量的比	

			的比例		例	
中国银河证券股份有限公司	1	2,068,954,713.35	54.25%	1,763,232.17	54.86%	-
招商证券股份有限公司	1	833,329,397.17	21.85%	679,506.49	21.14%	-
广发证券股份有限公司	1	344,345,841.56	9.03%	283,447.93	8.82%	-
申银万国证券股份有限公司	1	298,758,136.36	7.83%	253,943.87	7.90%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	230,972,691.77	6.06%	201,439.04	6.27%	-
中信建投证券有限责任公司	1	37,357,393.06	0.98%	32,612.58	1.01%	-

注：1、本报告期内，本基金无交易单元变更情况。

2、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。

3、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。

10.7.2 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
中国银河证券股份有限公司	1,857,578.50	55.07%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	726,371.02	21.53%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	789,037.80	23.39%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	0.00	0.00%	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	0.00	0.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安基金管理有限公司关于新增财富里昂证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-01-09
2	华安基金管理有限公司关于新增财通证券有限责任公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-01-16
3	华安基金管理有限公司关于新增广州银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-02-20
4	关于旗下基金参加广州银行股份有限公司网上申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-02-28
5	关于参加中国工商银行开展个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-30
6	关于住所变更公告,住所变更为上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-30
7	关于电子直销平台开通“直销转托管”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-04-16
8	关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-04-26
9	关于旗下部分基金参加邮政储蓄银行手机银行申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-02
10	关于基金电子交易平台开展工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-02

11	关于旗下部分基金参加华融证券定投及非现场申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-31
12	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-29
13	关于旗下部分基金参加中信银行股份有限公司电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-06-29

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新
- 3、《华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

11.2 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>。

11.3 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
二〇一二年八月二十七日