

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金
2012 年年度报告
2012 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 3 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。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	8
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8	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合规守信情况声明.....	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6	审计报告.....	15
6.1	管理层对财务报表的责任.....	16
6.2	注册会计师的责任.....	16
6.3	审计意见.....	16
§7	年度财务报表.....	17
7.1	资产负债表.....	17
7.2	利润表.....	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4	报表附注.....	21
§8	投资组合报告.....	40
8.1	期末基金资产组合情况.....	40
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	40
8.3	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.....	42
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6	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.....	58
8.7	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.....	58
8.8	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.....	58

8.9	投资组合报告附注.....	58
§9	基金份额持有人信息.....	59
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
§10	开放式基金份额变动.....	60
§11	重大事件揭示.....	60
11.1	基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	61
11.4	基金投资策略的改变.....	61
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	61
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.....	61
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	61
11.8	其他重大事件.....	63
§12	备查文件目录.....	67
12.1	备查文件目录.....	67
12.2	存放地点.....	67
12.3	查阅方式.....	67

§ 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	12,610,512,619.71 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收益。</p>

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		李勍	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、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	-523,727,636.05	-59,112,697.71	125,683,843.94
本期利润	474,556,888.17	-1,399,127,913.53	-152,255,361.64
加权平均基金份额本期利润	0.0603	-0.2111	-0.0227
本期加权平均净值利润率	9.72%	-26.40%	-2.70%
本期基金份额净值增长率	8.34%	-25.64%	-6.65%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
期末可供分配利润	-111,338,486.28	1,492,380,389.27	1,715,754,495.03
期末可供分配基金份额利润	-0.0088	0.2228	0.2413
期末基金资产净值	6,516,464,811.30	4,301,208,215.28	6,214,275,443.17
期末基金份额净值	0.517	0.642	0.874
3.1.3 累计期末指标	2012 年末	2011 年末	2010 年末
基金份额累计净值增长率	191.53%	169.10%	261.89%

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
过去三个 月	9.19%	1.25%	8.42%	1.22%	0.77%	0.03%
过去六个 月	2.74%	1.22%	1.03%	1.19%	1.71%	0.03%
过去一年	8.34%	1.26%	6.29%	1.23%	2.05%	0.03%
过去三年	-24.80%	1.34%	-27.51%	1.33%	2.71%	0.01%
过去五年	-47.74%	1.84%	-48.42%	1.86%	0.68%	-0.02%
自基金合 同生效起 至今	191.53%	1.61%	127.81%	1.64%	63.72%	-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。

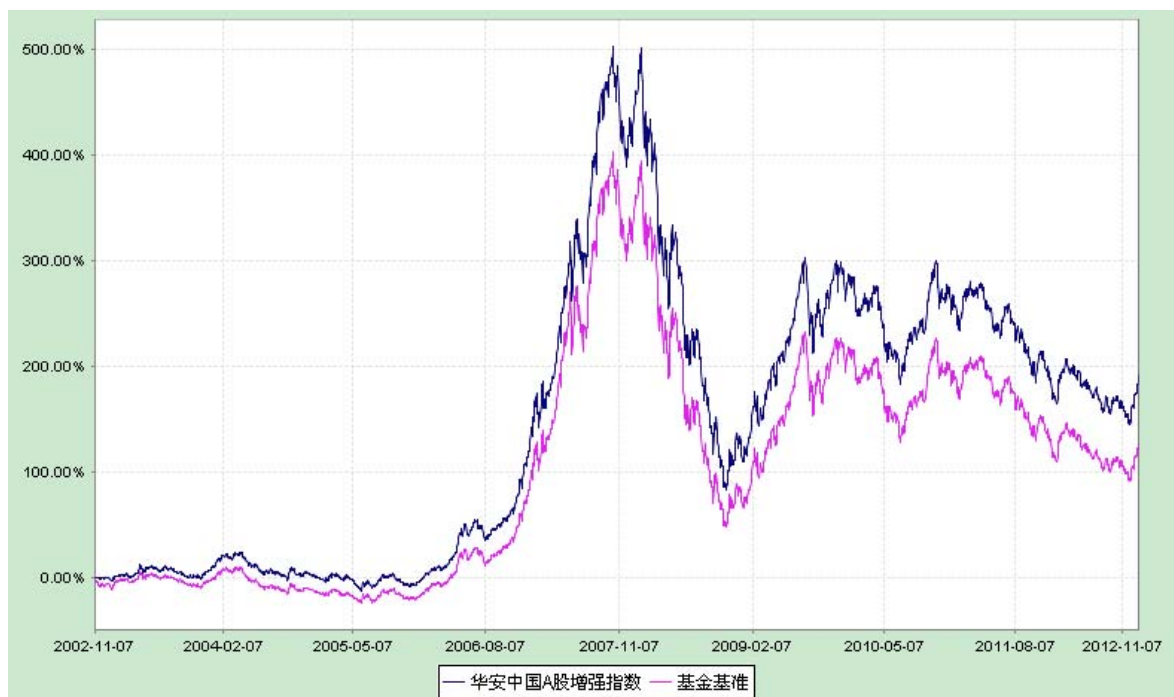
根据基金合同的规定：本基金将基金资产的 70%-95%投资于股票，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金可以投资于权证，权证的 投资比例不高于基金资产净值的 3%。

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

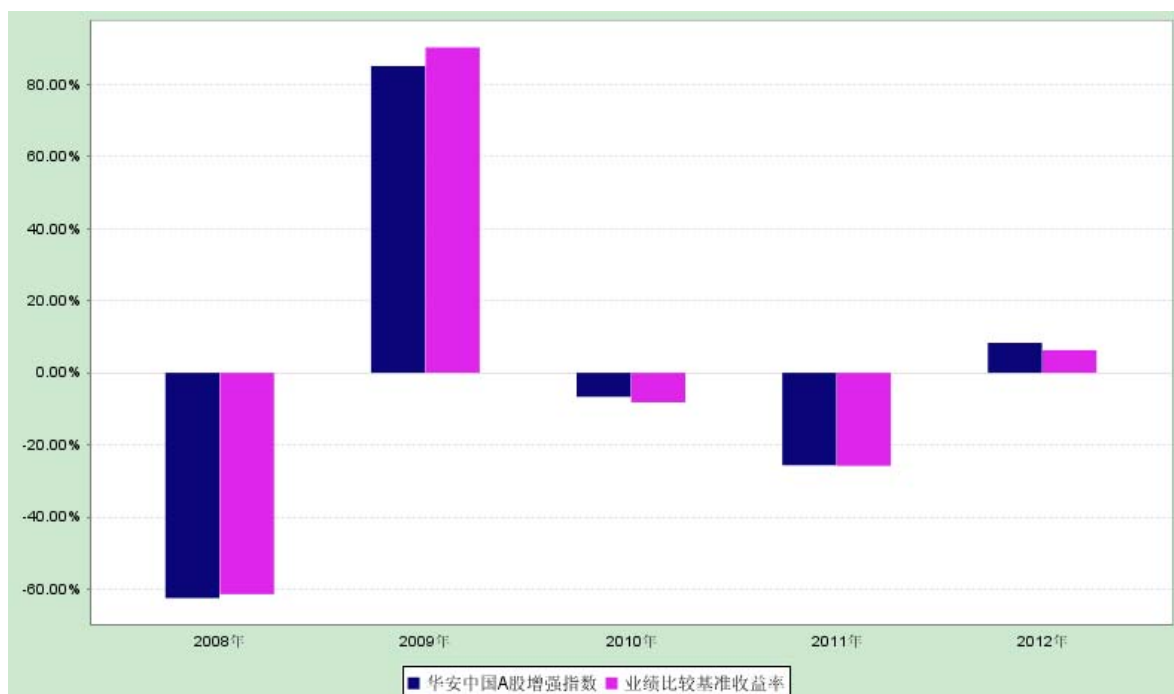
(2002 年 11 月 8 日至 2012 年 12 月 31 日)



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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金

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	1.630	1,629,667,574.78	560,596,481.63	2,190,264,056.41	-
2011年	0.100	36,750,963.82	34,444,505.55	71,195,469.37	-
2010年	0.200	44,720,683.43	74,245,733.95	118,966,417.38	-
合计	1.930	1,711,139,222.03	669,286,721.13	2,380,425,943.16	-

§ 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		
许之彦	本基金的基金经理，指数	2008-04-25	2012-12-22	9 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

	投资总监				<p>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，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	基金经理	2010-09-02	-	8 年	<p>复旦大学经济学硕士，FRM（金融风险管理师），8 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 月至 2012 年 12 月担任上证 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。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。</p>

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。

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 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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

截至 2012 年四季度，尽管企业盈利增速仍处同比下滑通道，企业去库存后期并未看到过剩产能有显著收缩，同时企业整体杠杆水平仍在上升，但对应市场年内低点的估值水平已基本反映中长期悲观预期。从宏观政策角度看，货币政策、财政政策分别于 2012 年二季度、四季度见底，12 月份初召开的中央经济工作会议部分纠正了市场的悲观预期，加之海外资金率先配置国内金融、地产、基建板块，在企业补库存对总需求的拉动下，流动性改善与经济复苏预期推动市场强劲反弹，其中以金融、地产、建材建筑等低估值板块反弹居前。本基金整体超配地产、金融、建材等低估值板块，并在各板块中优配行业龙头与成长优势股，取得一定超额收益。

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 8.34%，同期业绩比较基准增长率为 6.29%，基金净值表现领先比较基准 2.05%，截至 2012 年 12 月 31 日，本基金过去 30 个交易日日均跟踪偏离度为 0.14%（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

对 2013 年的宏观经济与市场表现，我们较 2012 年持更乐观态度，上半年宏观经济处于通胀温和、复苏确认的有利阶段，结合流动性的继续改善，以及一季度后投资新周期的启动，市场整体表现积极的概率比较大，尽管中间不排除由对地产调控担忧引发的震荡。下半年影响市场走势的首要因素是通胀预期以及可能带来的政策转向，我们对通胀走势与经济复苏程度保持同样的高度关注，并相应调整配置的重点。作为 MSCI 中国 A 股增强型指数基金的管理人，我们继续坚持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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司从维护基金份额持有人利益，保障基金合规运作出发，强化公司制度流程的落实，合规监察稽核部对公司产品开发、基金投资、基金销售、后台运行、员工行为的合规性进行定期和不定期检查，根据相关法规的变化和业务发展的需要，深化员工的合规意识，推动公司内部风险控制机制的完善与优化。监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，坚守“三条底线”，强化全体员工的合规意识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密等方面的合规培训和检查，保持公司良好的内控环境和合规文化。

(2) 进一步提高在新基金产品开发、新投资品种、新业务推进中法律、合规及风险控制方面的支持力度，加强了对新产品的风险评估。

(3) 坚持做好投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

(4) 推动落实公司投资业务操作流程标准化，细化各相关部门在各业务环节的操作流程及工作职责，降低操作风险发生的概率。

(5) 有计划地对公司投资研究、基金销售、后台运营等相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，强化对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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

本基金的原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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施 2012 年度的第一次分红，分红方案为：1.63 元/10 份，权益登记日及除息日：2012 年 11 月 7 日；现金红利发放日：2012 年 11 月 8 日。

§ 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，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，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对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 2,190,264,056.41 元。

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 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 21441 号

华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金(以下简称“华安 MSCI 中国 A 股指数基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是华安 MSCI 中国 A 股指数基金的基金管理人 华安基金管理有限公司 管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述华安 MSCI 中国 A 股指数基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了 华安 MSCI 中国 A 股指数基金 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册会计师 汪棣 庄贤

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	177,483,166.64	54,430,777.86
结算备付金		17,622,671.40	2,059,366.30
存出保证金		1,096,607.47	967,247.87
交易性金融资产	7.4.7.2	6,327,688,561.24	4,206,695,394.76
其中：股票投资		6,155,796,427.74	4,048,587,224.48
基金投资		-	-
债券投资		171,892,133.50	158,108,170.28
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	23,356,196.14
应收利息	7.4.7.5	1,976,063.34	3,699,454.78
应收股利		-	-
应收申购款		9,074,587.37	18,613,309.11
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		6,534,941,657.46	4,309,821,746.82
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		7,181,716.41	1,907,707.71
应付管理人报酬		4,996,910.28	3,772,538.68
应付托管费		999,382.07	754,507.72
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,139,690.70	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	7.4.7.8	1,159,146.70	916,160.18
负债合计		18,476,846.16	8,613,531.54
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,842,805,671.65	2,041,287,068.39
未分配利润	7.4.7.1 0	2,673,659,139.65	2,259,921,146.89
所有者权益合计		6,516,464,811.30	4,301,208,215.28
负债和所有者权益总计		6,534,941,657.46	4,309,821,746.82

注：报告截止日 2012 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.517 元，基金份额总额 12,610,512,619.71 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本 期	上 年 度 可 比 期 间
		2012年1月1日至2012年 12月31日	2011年1月1日至2011年 12月31日

一、收入		549,142,605.51	-1,322,922,708.55
1.利息收入		4,935,448.05	6,348,736.64
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,679,950.61	1,299,086.29
债券利息收入		3,255,497.44	5,049,650.35
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）		-454,077,366.76	10,743,770.63
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-527,966,761.33	-38,138,160.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	246,956.03	-1,595,053.39
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	73,642,438.54	50,476,984.05
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	998,284,524.22	-1,340,015,215.82
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、费用		74,585,717.34	76,205,204.98
1. 管理人报酬		48,655,549.40	53,134,523.05
2. 托管费		9,731,109.84	10,626,904.48
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	15,770,569.85	12,008,843.89
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	428,488.25	434,933.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		474,556,888.17	-1,399,127,913.53

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		474,556,888.17	-1,399,127,913.53

7.3 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 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）	2,041,287,068.39	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）	-	474,556,888.17	474,556,888.17
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）	1,801,518,603.26	2,129,445,161.00	3,930,963,764.26
其中：1.基金申购款	3,407,737,298.12	3,488,516,203.40	6,896,253,501.52
2.基金赎回款	-1,606,218,694.86	-1,359,071,042.40	-2,965,289,737.26
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）	-	-2,190,264,056.41	-2,190,264,056.41
五、期末所有者权益（基金净值）	3,842,805,671.65	2,673,659,139.65	6,516,464,811.30
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）	2,167,017,577.63	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）	-	-1,399,127,913.53	-1,399,127,913.53
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）	-125,730,509.24	-317,013,335.75	-442,743,844.99
其中：1.基金申购款	736,131,495.52	1,213,208,591.95	1,949,340,087.47

2.基金赎回款	-861,862,004.76	-1,530,221,927.70	-2,392,083,932.46
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)	2,041,287,068.39	2,259,921,146.89	4,301,208,215.28

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人: 李劼, 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 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 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 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配

利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。具体收益分配政策请参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会字[2007]21 号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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[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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
活期存款	177,483,166.64	54,430,777.86
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	177,483,166.64	54,430,777.86

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,110,416,289.41	6,155,796,427.74	45,380,138.33
债券	交易所市场	1,619,000.00	1,743,133.50
	银行间市场	170,427,600.00	170,149,000.00
			124,133.50
			-278,600.00

	合计	172,046,600.00	171,892,133.50	-154,466.50
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		6,282,462,889.41	6,327,688,561.24	45,225,671.83
项目		上年度末		
		2011 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,001,636,127.15	4,048,587,224.48	-953,048,902.67
债券	交易所市场	3,348,200.00	3,324,170.28	-24,029.72
	银行间市场	154,769,920.00	154,784,000.00	14,080.00
	合计	158,118,120.00	158,108,170.28	-9,949.72
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		5,159,754,247.15	4,206,695,394.76	-953,058,852.39

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应收活期存款利息	62,072.92	12,315.78
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	7,930.20	926.70
应收债券利息	1,903,150.70	3,684,822.48
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	2,909.52	1,389.82

其他	-	-
合计	1,976,063.34	3,699,454.78

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,136,534.51	1,260,186.06
银行间市场应付交易费用	3,156.19	2,431.19
合计	4,139,690.70	1,262,617.25

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	500,000.00
应付赎回费	146.70	160.18
应付后端申购费	-	-
债券利息税	-	-
预提费用	409,000.00	416,000.00
银行手续费	-	-
合计	1,159,146.70	916,160.18

7.4.7.9 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12月31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	11,184,175,797.46	3,407,737,298.12
本期赎回（以“-”号填列）	-5,272,997,356.46	-1,606,218,694.86
本期末	12,610,512,619.71	3,842,805,671.65

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	-523,727,636.05	998,284,524.22	474,556,888.17
本期基金份额交易产生的变动数	1,110,272,816.91	1,019,172,344.09	2,129,445,161.00
其中：基金申购款	1,613,635,646.98	1,874,880,556.42	3,488,516,203.40
基金赎回款	-503,362,830.07	-855,708,212.33	-1,359,071,042.40
本期已分配利润	-2,190,264,056.41	-	-2,190,264,056.41
本期末	-111,338,486.28	2,784,997,625.93	2,673,659,139.65

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
活期存款利息收入	1,456,141.44	1,190,266.39
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	78,802.34	46,151.39
其他	145,006.83	62,668.51
合计	1,679,950.61	1,299,086.29

7.4.7.12 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
卖出股票成交总额	4,610,084,232.73	4,068,684,097.79
减：卖出股票成本总额	5,138,050,994.06	4,106,822,257.82
买卖股票差价收入	-527,966,761.33	-38,138,160.03

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	217,974,415.11	220,100,575.10
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	211,940,120.00	212,572,240.00
减：应收利息总额	5,787,339.08	9,123,388.49
债券投资收益	246,956.03	-1,595,053.39

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	73,642,438.54	50,476,984.05
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	73,642,438.54	50,476,984.05

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	998,284,524.22	-1,340,015,215.82
——股票投资	998,429,041.00	-1,341,853,506.10
——债券投资	-144,516.78	1,838,290.28
——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	998,284,524.22	-1,340,015,215.82

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	15,769,294.85	12,008,293.89
银行间市场交易费用	1,275.00	550.00
合计	15,770,569.85	12,008,843.89

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	109,000.00	116,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行汇划费用	1,488.25	933.56
帐户维护费	-	-
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	428,488.25	434,933.56

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局、中国证监会于 2012 年 11 月 16 日联合发布财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(以下简称“通知”), 要求个人从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。证券投资基金从上市公司取得的股息红利所得, 按照本通知的规定计征个人所得税。通知自 2013 年 1 月 1 日起施行。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司 (“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国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

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应付关联方佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	48,655,549.40	53,134,523.05
其中：支付销售机构的客户 维护费	1,803,886.24	2,038,095.98

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。

7.4.10.2.2 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	9,731,109.84	10,626,904.48
----------------	--------------	---------------

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 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	177,483,166.64	1,456,141.44	54,430,777.86	1,190,266.39
合计	177,483,166.64	1,456,141.44	54,430,777.86	1,190,266.39

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	利润分配 合计	备注
1	2012-11-07	2012-11-07	1.630	1,629,667,574.78	560,596,481.63	2,190,264,056.41	-
合计	-	-	1.630	1,629,667,574.78	560,596,481.63	2,190,264,056.41	-

7.4.12 期末（2012 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000826	桑德环境	2012-12-24	2013-01-09	配股	12.71	22.99	169,666	2,156,454.86	3,900,621.34	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科 A	2012-12-26	公告重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	15,619,573	134,813,470.04	158,070,078.76	-
000527	美的电器	2012-08-27	重大资产重组	9.18	尚未复牌	-	2,010,202	27,505,028.35	18,453,654.36	-
600100	同方股份	2012-12-27	公告重大事项	7.48	2013-01-10	7.90	1,434,113	12,654,532.39	10,727,165.24	-
601618	中国中冶	2012-12-28	公告重大事项	2.26	2013-01-04	2.33	4,216,343	16,013,515.12	9,528,935.18	-
000793	华闻传媒	2012-11-23	公告重大事项	6.63	2013-02-28	7.29	586,009	3,525,291.93	3,885,239.67	-
600236	桂冠电力	2012-12-21	重大资产重组	3.98	2013-02-05	4.36	908,296	4,538,414.58	3,615,018.08	-

注：本基金截至 2012 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.03%(2011 年 12 月 31 日：0.08%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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发行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 7.4.12 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，其余均能以合理价格适时变现。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	177,483,166.64	-	-	-	177,483,166.64
结算备付金	17,622,671.40	-	-	-	17,622,671.40
存出保证金	-	-	-	1,096,607.47	1,096,607.47
交易性金融资产	50,065,000.00	120,364,704.00	1,462,429.50	6,155,796,427.74	6,327,688,561.24
应收利息	-	-	-	1,976,063.34	1,976,063.34
应收申购款	221,566.59	-	-	8,853,020.78	9,074,587.37
资产总计	245,392,404.63	120,364,704.00	1,462,429.50	6,167,722,119.33	6,534,941,657.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	7,181,716.41	7,181,716.41
应付管理人报酬	-	-	-	4,996,910.28	4,996,910.28
应付托管费	-	-	-	999,382.07	999,382.07
应付交易费用	-	-	-	4,139,690.70	4,139,690.70
其他负债	-	-	-	1,159,146.70	1,159,146.70
负债总计	-	-	-	18,476,846.16	18,476,846.16
利率敏感度缺口	245,392,404.63	120,364,704.00	1,462,429.50	6,149,245,273.17	6,516,464,811.30

上年度末 2011 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 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
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
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账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 12 月 31 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 2.64%(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(2011 年 12 月 31 日: 同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中, 采用“自上而下”的策略, 通过对宏观经济情况及政策的分析, 结合证券市场运行情况, 做出资产配置及组合构建的决定; 通过对单个证券的定性分析及定量分析, 选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化, 对投资策略、资产配置、投资组合进行修正, 来主动应对可能发生的市场价格风险。

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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 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	6,155,796,427.74	94.47	4,048,587,224.48	94.13
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,155,796,427.74	94.47	4,048,587,224.48	94.13

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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：人民币元）	
		本期末 2012 年 12 月 31 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	增加约 33,300.00 万元	增加约 21,487.00 万元
	2.业绩比较基准下降 5%	减少约 33,300.00 万元	减少约 21,487.00 万元

7.4.14 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 2012 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为 5,953,259,469.95 元，属于第二层级的余额为 374,429,091.29 元，无属于第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日：第一层级 4,023,531,515.25 元，第二层级 183,163,879.51 元，无属于第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层

级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2011年12月31日：同)。本基金本期无第三层次公允价值变动(2011年度：本基金本期净转入/(转出)第三层级金额为零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元，涉及河南双汇投资发展股份有限公司发行的股票)。

(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	6,155,796,427.74	94.20
	其中：股票	6,155,796,427.74	94.20
2	固定收益投资	171,892,133.50	2.63
	其中：债券	171,892,133.50	2.63
	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	195,105,838.04	2.99
6	其他各项资产	12,147,258.18	0.19
7	合计	6,534,941,657.46	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	46,541,569.04	0.71

B	采掘业	593,592,058.01	9.11
C	制造业	2,360,479,582.59	36.22
C0	食品、饮料	607,868,635.62	9.33
C1	纺织、服装、皮毛	21,336,419.04	0.33
C2	木材、家具	5,206,727.76	0.08
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	115,729,747.73	1.78
C5	电子	179,024,746.20	2.75
C6	金属、非金属	355,583,174.34	5.46
C7	机械、设备、仪表	674,468,394.11	10.35
C8	医药、生物制品	398,447,482.97	6.11
C99	其他制造业	2,814,254.82	0.04
D	电力、煤气及水的生产和供应业	92,920,740.24	1.43
E	建筑业	187,140,354.65	2.87
F	交通运输、仓储业	142,918,873.09	2.19
G	信息技术业	209,942,175.94	3.22
H	批发和零售贸易	141,642,515.16	2.17
I	金融、保险业	1,618,466,505.74	24.84
J	房地产业	505,428,826.06	7.76
K	社会服务业	95,869,440.38	1.47
L	传播与文化产业	60,941,465.91	0.94
M	综合类	79,652,050.91	1.22
	合计	6,135,536,157.72	94.15

8.2.2 积极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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	14,077,645.52	0.22
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	2,009,645.52	0.03
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	12,068,000.00	0.19
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	6,182,624.50	0.09
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	20,260,270.02	0.31

8.3 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

8.3.1 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	600016	民生银行	28,392,036	223,161,402.96	3.42
2	601318	中国平安	4,204,271	190,411,433.59	2.92
3	601166	兴业银行	11,232,276	187,466,686.44	2.88
4	600030	中信证券	13,746,223	183,649,539.28	2.82

5	600519	贵州茅台	772,159	161,396,674.18	2.48
6	000002	万科 A	15,619,573	158,070,078.76	2.43
7	600837	海通证券	14,326,279	146,844,359.75	2.25
8	600000	浦发银行	14,316,563	142,020,304.96	2.18
9	600036	招商银行	9,304,462	127,936,352.50	1.96
10	000858	五粮液	4,451,475	125,665,139.25	1.93
11	600048	保利地产	7,395,150	100,574,040.00	1.54
12	601088	中国神华	3,344,865	84,792,327.75	1.30
13	000423	东阿阿胶	1,664,617	67,267,172.97	1.03
14	600406	国电南瑞	4,161,730	66,712,531.90	1.02
15	000157	中联重科	6,699,422	61,701,676.62	0.95
16	600887	伊利股份	2,754,894	60,552,570.12	0.93
17	000568	泸州老窖	1,703,577	60,306,625.80	0.93
18	600546	山煤国际	2,894,242	58,897,824.70	0.90
19	601628	中国人寿	2,650,063	56,711,348.20	0.87
20	601328	交通银行	10,639,733	52,560,281.02	0.81
21	601668	中国建筑	12,916,006	50,372,423.40	0.77
22	600028	中国石化	7,008,893	48,501,539.56	0.74
23	600208	新湖中宝	11,151,734	48,063,973.54	0.74
24	600276	恒瑞医药	1,579,699	47,548,939.90	0.73
25	600015	华夏银行	4,384,373	45,378,260.55	0.70
26	601918	国投新集	4,734,400	45,308,208.00	0.70
27	600104	上汽集团	2,369,106	41,791,029.84	0.64
28	000401	冀东水泥	3,027,482	41,779,251.60	0.64
29	600111	包钢稀土	1,078,363	40,384,694.35	0.62
30	000651	格力电器	1,576,131	40,191,340.50	0.62
31	600809	山西汾酒	958,655	39,937,567.30	0.61
32	600166	福田汽车	5,794,324	38,995,800.52	0.60
33	002304	洋河股份	398,139	37,174,238.43	0.57
34	600031	三一重工	3,508,957	37,159,854.63	0.57
35	600050	中国联通	10,567,702	36,986,957.00	0.57

36	601699	潞安环能	1,681,048	36,798,140.72	0.56
37	601006	大秦铁路	5,369,808	36,299,902.08	0.56
38	601288	农业银行	12,747,407	35,692,739.60	0.55
39	601299	中国北车	7,708,751	34,766,467.01	0.53
40	600395	盘江股份	2,022,892	34,429,621.84	0.53
41	601601	中国太保	1,525,002	34,312,545.00	0.53
42	000895	双汇发展	592,200	34,288,380.00	0.53
43	600060	海信电器	3,331,950	33,686,014.50	0.52
44	601998	中信银行	7,736,469	33,189,452.01	0.51
45	600690	青岛海尔	2,440,613	32,704,214.20	0.50
46	600079	人福医药	1,363,644	31,895,633.16	0.49
47	601766	中国南车	6,326,512	31,379,499.52	0.48
48	600383	金地集团	4,330,300	30,398,706.00	0.47
49	000028	国药一致	851,798	30,068,469.40	0.46
50	601098	中南传媒	3,306,637	29,561,334.78	0.45
51	000776	广发证券	1,857,215	28,638,255.30	0.44
52	600157	永泰能源	2,963,104	27,882,808.64	0.43
53	000069	华侨城 A	3,686,725	27,650,437.50	0.42
54	601390	中国中铁	9,091,048	27,636,785.92	0.42
55	600823	世茂股份	2,303,462	26,950,505.40	0.41
56	600547	山东黄金	691,726	26,396,264.16	0.41
57	601169	北京银行	2,759,880	25,666,884.00	0.39
58	002415	海康威视	805,846	25,069,869.06	0.38
59	000538	云南白药	364,181	24,764,308.00	0.38
60	000338	潍柴动力	957,299	24,229,237.69	0.37
61	601336	新华保险	818,827	23,598,594.14	0.36
62	600583	海油工程	3,995,921	23,456,056.27	0.36
63	000999	华润三九	988,630	23,430,531.00	0.36
64	600256	广汇能源	1,408,829	23,090,707.31	0.35
65	000937	冀中能源	1,665,097	23,028,291.51	0.35
66	000024	招商地产	753,963	22,535,954.07	0.35

67	000630	铜陵有色	1,179,752	22,297,312.80	0.34
68	002155	辰州矿业	1,052,527	21,134,742.16	0.32
69	600309	烟台万华	1,353,296	21,124,950.56	0.32
70	600196	复星医药	1,999,921	20,979,171.29	0.32
71	600518	康美药业	1,528,768	20,088,011.52	0.31
72	000877	天山股份	2,096,102	19,745,280.84	0.30
73	002241	歌尔声学	507,993	19,151,336.10	0.29
74	000528	柳 工	1,902,061	19,039,630.61	0.29
75	600153	建发股份	2,651,363	18,639,081.89	0.29
76	000527	美的电器	2,010,202	18,453,654.36	0.28
77	002038	双鹭药业	465,117	18,400,028.52	0.28
78	000778	新兴铸管	2,783,351	17,980,447.46	0.28
79	601888	中国国旅	643,510	17,645,044.20	0.27
80	601808	中海油服	1,069,936	17,546,950.40	0.27
81	601117	中国化学	2,097,926	17,286,910.24	0.27
82	600741	华域汽车	1,543,367	17,254,843.06	0.26
83	000422	湖北宜化	1,546,553	17,182,203.83	0.26
84	600900	长江电力	2,487,210	17,087,132.70	0.26
85	000629	攀钢钒钛	4,106,552	16,918,994.24	0.26
86	000826	桑德环境	735,220	16,902,707.80	0.26
87	002244	滨江集团	1,527,855	16,577,226.75	0.25
88	000725	京东方 A	7,214,908	16,377,841.16	0.25
89	000063	中兴通讯	1,667,846	16,261,498.50	0.25
90	600535	天士力	290,223	16,040,625.21	0.25
91	601333	广深铁路	5,410,024	15,797,270.08	0.24
92	600585	海螺水泥	850,400	15,689,880.00	0.24
93	600600	青岛啤酒	473,348	15,648,884.88	0.24
94	600570	恒生电子	1,379,053	15,459,184.13	0.24
95	002236	大华股份	328,377	15,220,273.95	0.23
96	600062	华润双鹤	665,997	15,118,131.90	0.23
97	000402	金 融 街	2,219,548	14,981,949.00	0.23

98	601633	长城汽车	631,700	14,971,290.00	0.23
99	000917	电广传媒	1,480,961	14,765,181.17	0.23
100	002375	亚厦股份	556,770	14,743,269.60	0.23
101	600805	悦达投资	1,224,312	14,569,312.80	0.22
102	000961	中南建设	1,059,817	14,540,689.24	0.22
103	600199	金种子酒	730,356	14,030,138.76	0.22
104	600859	王府井	580,501	13,908,803.96	0.21
105	600489	中金黄金	835,616	13,896,294.08	0.21
106	002073	软控股份	1,799,996	13,607,969.76	0.21
107	000623	吉林敖东	799,126	13,585,142.00	0.21
108	600597	光明乳业	1,359,578	13,364,651.74	0.21
109	000800	一汽轿车	1,602,746	13,334,846.72	0.20
110	600739	辽宁成大	883,327	13,241,071.73	0.20
111	600999	招商证券	1,234,261	13,021,453.55	0.20
112	600795	国电电力	4,923,607	12,949,086.41	0.20
113	601899	紫金矿业	3,328,127	12,746,726.41	0.20
114	601989	中国重工	2,657,873	12,678,054.21	0.19
115	600549	厦门钨业	324,686	12,656,260.28	0.19
116	000783	长江证券	1,344,573	12,638,986.20	0.19
117	600362	江西铜业	528,498	12,609,962.28	0.19
118	601168	西部矿业	1,602,158	12,560,918.72	0.19
119	600765	中航重机	1,642,121	12,496,540.81	0.19
120	600881	亚泰集团	2,482,103	12,460,157.06	0.19
121	002146	荣盛发展	882,403	12,344,817.97	0.19
122	000792	盐湖股份	458,238	12,280,778.40	0.19
123	600019	宝钢股份	2,509,695	12,272,408.55	0.19
124	600348	阳泉煤业	835,220	12,135,746.60	0.19
125	600259	广晟有色	206,206	12,058,926.88	0.19
126	600089	特变电工	1,864,625	12,045,477.50	0.18
127	600376	首开股份	911,085	11,953,435.20	0.18
128	000581	威孚高科	370,194	11,809,188.60	0.18

129	600426	华鲁恒升	1,523,013	11,803,350.75	0.18
130	601788	光大证券	836,435	11,793,733.50	0.18
131	000400	许继电气	472,001	11,634,824.65	0.18
132	000926	福星股份	1,223,072	11,558,030.40	0.18
133	600141	兴发集团	638,991	11,527,397.64	0.18
134	000596	古井贡酒	334,857	11,478,897.96	0.18
135	002106	莱宝高科	747,187	11,439,432.97	0.18
136	600875	东方电气	800,914	11,124,695.46	0.17
137	601111	中国国航	1,847,720	11,086,320.00	0.17
138	000060	中金岭南	1,213,831	10,985,170.55	0.17
139	000100	TCL 集团	4,904,711	10,741,317.09	0.16
140	600100	同方股份	1,434,113	10,727,165.24	0.16
141	000970	中科三环	328,622	10,709,790.98	0.16
142	600528	中铁二局	1,598,990	10,681,253.20	0.16
143	600588	用友软件	1,082,618	10,674,613.48	0.16
144	000758	中色股份	520,310	10,614,324.00	0.16
145	600066	宇通客车	404,309	10,188,586.80	0.16
146	600425	青松建化	1,025,300	10,140,217.00	0.16
147	000009	中国宝安	1,147,367	10,096,829.60	0.15
148	600138	中青旅	628,886	10,011,865.12	0.15
149	600068	葛洲坝	1,820,373	9,993,847.77	0.15
150	601009	南京银行	1,075,488	9,894,489.60	0.15
151	600010	包钢股份	1,787,653	9,653,326.20	0.15
152	600750	江中药业	487,791	9,619,238.52	0.15
153	002041	登海种业	405,953	9,580,490.80	0.15
154	600642	申能股份	2,162,930	9,560,150.60	0.15
155	601618	中国中冶	4,216,343	9,528,935.18	0.15
156	600177	雅戈尔	1,202,740	9,501,646.00	0.15
157	601898	中煤能源	1,213,411	9,488,874.02	0.15
158	601186	中国铁建	1,591,689	9,343,214.43	0.14
159	600252	中恒集团	1,023,153	9,341,386.89	0.14

160	000625	长安汽车	1,397,855	9,295,735.75	0.14
161	000768	中航飞机	1,109,107	9,227,770.24	0.14
162	601958	金钼股份	785,807	9,201,799.97	0.14
163	600660	福耀玻璃	1,020,120	8,946,452.40	0.14
164	600458	时代新材	684,442	8,931,968.10	0.14
165	601872	招商轮船	3,470,760	8,885,145.60	0.14
166	601877	正泰电器	460,384	8,457,254.08	0.13
167	600150	中国船舶	360,156	8,370,025.44	0.13
168	000963	华东医药	244,848	8,324,832.00	0.13
169	600718	东软集团	1,081,245	8,314,774.05	0.13
170	002353	杰瑞股份	170,133	8,105,136.12	0.12
171	000039	中集集团	702,555	8,100,459.15	0.12
172	000425	徐工机械	696,809	8,034,207.77	0.12
173	002069	獐子岛	506,457	7,991,891.46	0.12
174	600143	金发科技	1,463,746	7,889,590.94	0.12
175	000562	宏源证券	416,142	7,844,276.70	0.12
176	600366	宁波韵升	489,295	7,765,111.65	0.12
177	002001	新和成	411,748	7,740,862.40	0.12
178	600582	天地科技	679,953	7,717,466.55	0.12
179	601688	华泰证券	783,619	7,679,466.20	0.12
180	600673	东阳光铝	1,000,850	7,566,426.00	0.12
181	000718	苏宁环球	952,591	7,554,046.63	0.12
182	000729	燕京啤酒	1,327,047	7,484,545.08	0.11
183	600674	川投能源	874,257	7,308,788.52	0.11
184	600879	航天电子	1,112,805	7,255,488.60	0.11
185	000932	华菱钢铁	3,109,328	7,120,361.12	0.11
186	000012	南玻 A	854,520	7,049,790.00	0.11
187	600497	驰宏锌锗	495,561	7,012,188.15	0.11
188	600498	烽火通信	303,693	6,912,052.68	0.11
189	600893	航空动力	539,351	6,812,003.13	0.10
190	600649	城投控股	1,230,139	6,728,860.33	0.10

191	600170	上海建工	860,445	6,720,075.45	0.10
192	002431	棕榈园林	290,131	6,673,013.00	0.10
193	600415	小商品城	1,001,391	6,649,236.24	0.10
194	600839	四川长虹	3,191,937	6,575,390.22	0.10
195	600108	亚盛集团	944,174	6,448,708.42	0.10
196	002024	苏宁电器	957,071	6,364,522.15	0.10
197	600970	中材国际	515,741	6,353,929.12	0.10
198	600125	铁龙物流	876,872	6,304,709.68	0.10
199	600271	航天信息	418,727	6,205,534.14	0.10
200	600895	张江高科	880,140	6,178,582.80	0.09
201	600655	豫园商城	859,694	6,172,602.92	0.09
202	601717	郑煤机	597,305	6,164,187.60	0.09
203	600694	大商股份	174,603	6,158,247.81	0.09
204	600161	天坛生物	490,757	6,105,017.08	0.09
205	600637	百视通	381,567	6,055,468.29	0.09
206	002152	广电运通	424,605	6,025,144.95	0.09
207	600717	天津港	990,801	5,984,438.04	0.09
208	600820	隧道股份	649,738	5,912,615.80	0.09
209	600018	上港集团	2,241,997	5,896,452.11	0.09
210	002004	华邦制药	366,920	5,892,735.20	0.09
211	000998	隆平高科	287,007	5,877,903.36	0.09
212	600115	东方航空	1,664,788	5,843,405.88	0.09
213	000860	顺鑫农业	433,112	5,782,045.20	0.09
214	600811	东方集团	1,054,197	5,724,289.71	0.09
215	600467	好当家	780,783	5,715,331.56	0.09
216	000869	张裕 A	120,885	5,681,595.00	0.09
217	600801	华新水泥	372,926	5,657,287.42	0.09
218	600216	浙江医药	269,017	5,654,737.34	0.09
219	002081	金螳螂	126,938	5,587,810.76	0.09
220	600827	友谊股份	638,104	5,474,932.32	0.08
221	600320	振华重工	1,613,037	5,468,195.43	0.08

222	002422	科伦药业	97,449	5,459,092.98	0.08
223	600008	首创股份	1,248,781	5,457,172.97	0.08
224	600997	开滦股份	531,773	5,434,720.06	0.08
225	000962	东方钨业	433,053	5,430,484.62	0.08
226	000960	锡业股份	271,211	5,391,674.68	0.08
227	000709	河北钢铁	2,000,000	5,360,000.00	0.08
228	600221	海南航空	1,260,353	5,331,293.19	0.08
229	000726	鲁泰 A	803,068	5,292,218.12	0.08
230	601866	中海集运	2,144,842	5,233,414.48	0.08
231	600978	宜华木业	1,058,278	5,206,727.76	0.08
232	601939	建设银行	1,127,239	5,185,299.40	0.08
233	002022	科华生物	493,025	5,176,762.50	0.08
234	600598	北大荒	630,539	5,145,198.24	0.08
235	000539	粤电力 A	868,221	5,139,868.32	0.08
236	600005	武钢股份	1,839,747	5,096,099.19	0.08
237	000652	泰达股份	1,430,001	5,090,803.56	0.08
238	002063	远光软件	345,682	5,067,698.12	0.08
239	600011	华能国际	705,297	5,035,820.58	0.08
240	600432	吉恩镍业	372,548	5,029,398.00	0.08
241	601001	大同煤业	542,236	5,010,260.64	0.08
242	000046	泛海建设	927,453	5,008,246.20	0.08
243	002065	东华软件	355,756	5,001,929.36	0.08
244	002028	思源电气	357,653	4,989,259.35	0.08
245	600160	巨化股份	539,071	4,981,016.04	0.08
246	600886	国投电力	860,908	4,958,830.08	0.08
247	002465	海格通信	171,110	4,936,523.50	0.08
248	600307	酒钢宏兴	1,503,896	4,932,778.88	0.08
249	000969	安泰科技	460,650	4,864,464.00	0.07
250	000559	万向钱潮	1,070,872	4,808,215.28	0.07
251	600867	通化东宝	500,000	4,750,000.00	0.07
252	002142	宁波银行	439,802	4,688,289.32	0.07

253	600499	科达机电	535,190	4,688,264.40	0.07
254	000933	神火股份	620,339	4,671,152.67	0.07
255	002129	中环股份	363,007	4,628,339.25	0.07
256	600428	中远航运	1,177,397	4,627,170.21	0.07
257	600085	同仁堂	259,598	4,626,036.36	0.07
258	600500	中化国际	788,131	4,555,397.18	0.07
259	002051	中工国际	154,884	4,553,589.60	0.07
260	000876	新希望	361,593	4,516,296.57	0.07
261	000513	丽珠集团	127,825	4,448,310.00	0.07
262	002007	华兰生物	209,878	4,415,833.12	0.07
263	000807	云铝股份	836,919	4,410,563.13	0.07
264	000878	云南铜业	291,450	4,409,638.50	0.07
265	600737	中粮屯河	838,624	4,394,389.76	0.07
266	600009	上海机场	347,575	4,330,784.50	0.07
267	600195	中牧股份	338,389	4,270,469.18	0.07
268	000762	西藏矿业	338,279	4,184,511.23	0.06
269	601101	昊华能源	313,874	4,180,801.68	0.06
270	600770	综艺股份	672,980	4,165,746.20	0.06
271	000839	中信国安	687,740	4,140,194.80	0.06
272	000680	山推股份	847,789	4,128,732.43	0.06
273	000983	西山煤电	295,913	4,116,149.83	0.06
274	600261	阳光照明	459,373	3,978,170.18	0.06
275	000939	凯迪电力	592,888	3,960,491.84	0.06
276	600269	赣粤高速	1,143,742	3,911,597.64	0.06
277	000793	华闻传媒	586,009	3,885,239.67	0.06
278	000900	现代投资	441,831	3,870,439.56	0.06
279	002344	海宁皮城	145,076	3,856,120.08	0.06
280	002294	信立泰	100,619	3,853,707.70	0.06
281	002385	大北农	178,136	3,847,737.60	0.06
282	600037	歌华有线	570,938	3,825,284.60	0.06
283	600098	广州控股	501,398	3,800,596.84	0.06

284	000825	太钢不锈	1,038,615	3,749,400.15	0.06
285	000816	江淮动力	686,858	3,736,507.52	0.06
286	600038	哈飞股份	197,677	3,720,281.14	0.06
287	002140	东华科技	168,417	3,701,805.66	0.06
288	600517	置信电气	267,863	3,696,509.40	0.06
289	600267	海正药业	248,063	3,693,658.07	0.06
290	600816	安信信托	278,115	3,668,336.85	0.06
291	600787	中储股份	468,585	3,622,162.05	0.06
292	002277	友阿股份	400,000	3,616,000.00	0.06
293	600236	桂冠电力	908,296	3,615,018.08	0.06
294	600312	平高电气	496,559	3,609,983.93	0.06
295	600219	南山铝业	526,591	3,591,350.62	0.06
296	600064	南京高科	293,123	3,567,306.91	0.05
297	002223	鱼跃医疗	230,097	3,566,503.50	0.05
298	600266	北京城建	239,498	3,566,125.22	0.05
299	600863	内蒙华电	474,235	3,556,762.50	0.05
300	600220	江苏阳光	1,258,756	3,537,104.36	0.05
301	002179	中航光电	257,442	3,501,211.20	0.05
302	002230	科大讯飞	115,516	3,500,134.80	0.05
303	600704	物产中大	479,211	3,498,240.30	0.05
304	600572	康恩贝	354,164	3,453,099.00	0.05
305	000006	深振业 A	696,062	3,445,506.90	0.05
306	601669	中国水电	901,612	3,444,157.84	0.05
307	000690	宝新能源	765,926	3,431,348.48	0.05
308	002161	远望谷	553,300	3,397,262.00	0.05
309	600702	沱牌舍得	116,773	3,364,230.13	0.05
310	000501	鄂武商 A	284,329	3,269,783.50	0.05
311	601002	晋亿实业	315,763	3,249,201.27	0.05
312	600804	鹏博士	538,250	3,207,970.00	0.05
313	600316	洪都航空	231,343	3,174,025.96	0.05
314	600369	西南证券	354,144	3,162,505.92	0.05

315	601991	大唐发电	784,406	3,161,156.18	0.05
316	600720	祁连山	296,316	3,140,949.60	0.05
317	600409	三友化工	822,906	3,127,042.80	0.05
318	600436	片仔癀	28,357	3,088,644.44	0.05
319	600511	国药股份	210,709	3,070,030.13	0.05
320	000088	盐田港	754,866	3,057,207.30	0.05
321	000612	焦作万方	278,388	3,014,942.04	0.05
322	002029	七匹狼	159,187	3,005,450.56	0.05
323	600176	中国玻纤	294,406	2,988,220.90	0.05
324	000089	深圳机场	766,290	2,950,216.50	0.05
325	002237	恒邦股份	124,813	2,891,917.21	0.04
326	601588	北辰实业	945,440	2,883,592.00	0.04
327	600880	博瑞传播	295,535	2,848,957.40	0.04
328	600004	白云机场	399,224	2,830,498.16	0.04
329	600210	紫江企业	801,782	2,814,254.82	0.04
330	600096	云天化	216,953	2,811,710.88	0.04
331	600183	生益科技	665,077	2,799,974.17	0.04
332	000417	合肥百货	400,000	2,796,000.00	0.04
333	600270	外运发展	392,441	2,782,406.69	0.04
334	000061	农产品	485,259	2,765,976.30	0.04
335	600315	上海家化	52,896	2,697,167.04	0.04
336	600332	广州药业	138,700	2,693,554.00	0.04
337	600331	宏达股份	401,660	2,687,105.40	0.04
338	600858	银座股份	286,047	2,680,260.39	0.04
339	600118	中国卫星	216,744	2,650,779.12	0.04
340	600815	厦工股份	378,495	2,645,680.05	0.04
341	002168	深圳惠程	352,405	2,569,032.45	0.04
342	000550	江铃汽车	141,430	2,542,911.40	0.04
343	600418	江淮汽车	371,911	2,540,152.13	0.04
344	600888	新疆众和	268,207	2,529,192.01	0.04
345	000968	煤气化	203,404	2,510,005.36	0.04

346	601718	际华集团	827,807	2,491,699.07	0.04
347	002408	齐翔腾达	147,735	2,476,038.60	0.04
348	601179	中国西电	710,364	2,472,066.72	0.04
349	000830	鲁西化工	599,568	2,398,272.00	0.04
350	600435	北方导航	289,465	2,393,875.55	0.04
351	600251	冠农股份	146,184	2,391,570.24	0.04
352	600123	兰花科创	116,764	2,369,141.56	0.04
353	600026	中海发展	506,654	2,350,874.56	0.04
354	600663	陆家嘴	193,662	2,304,577.80	0.04
355	601666	平煤股份	269,472	2,301,290.88	0.04
356	000021	长城开发	487,526	2,296,247.46	0.04
357	600481	双良节能	329,985	2,290,095.90	0.04
358	000988	华工科技	395,589	2,191,563.06	0.03
359	600072	中船股份	154,871	2,152,706.90	0.03
360	600755	厦门国贸	484,438	2,146,060.34	0.03
361	600595	中孚实业	417,767	2,063,768.98	0.03
362	600783	鲁信创投	181,845	2,009,387.25	0.03
363	600456	宝钛股份	112,981	2,004,282.94	0.03
364	000541	佛山照明	291,766	1,934,408.58	0.03
365	600029	南方航空	491,858	1,923,164.78	0.03
366	002310	东方园林	30,412	1,906,528.28	0.03
367	600971	恒源煤电	144,373	1,859,524.24	0.03
368	600812	华北制药	330,237	1,836,117.72	0.03
369	000598	兴蓉投资	246,128	1,818,885.92	0.03
370	000686	东北证券	98,876	1,651,229.20	0.03
371	002405	四维图新	138,902	1,629,320.46	0.03
372	002056	横店东磁	114,021	1,600,854.84	0.02
373	002250	联化科技	76,697	1,495,591.50	0.02
374	601106	中国一重	514,775	1,451,665.50	0.02
375	600027	华电国际	362,043	1,426,449.42	0.02
376	601678	滨化股份	136,042	1,356,338.74	0.02

377	600380	健康元	298,602	1,343,709.00	0.02
378	600298	安琪酵母	80,686	1,317,602.38	0.02
379	002122	天马股份	216,939	1,197,503.28	0.02
380	600844	丹化科技	108,170	1,197,441.90	0.02
381	000887	中鼎股份	124,182	1,148,683.50	0.02
382	002092	中泰化学	155,847	1,109,630.64	0.02
383	600825	新华传媒	212,748	1,036,082.76	0.02
384	600132	重庆啤酒	66,812	1,026,900.44	0.02
385	600169	太原重工	280,580	1,018,505.40	0.02
386	600078	澄星股份	114,392	968,900.24	0.01
387	000650	仁和药业	173,413	967,644.54	0.01
388	000655	金岭矿业	77,483	960,789.20	0.01
389	600664	哈药股份	145,497	899,171.46	0.01
390	000059	辽通化工	84,877	578,012.37	0.01

8.3.2 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	600067	冠城大通	1,300,000	8,528,000.00	0.13
2	000671	阳光城	398,879	6,182,624.50	0.09
3	600742	一汽富维	200,000	3,540,000.00	0.05
4	000050	深天马 A	198,432	1,569,597.12	0.02
5	600584	长电科技	103,785	440,048.40	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601166	兴业银行	223,377,266.04	5.19
2	600519	贵州茅台	205,133,108.17	4.77
3	000858	五 粮 液	175,065,286.00	4.07
4	600030	中信证券	174,658,436.92	4.06
5	600837	海通证券	163,019,627.20	3.79
6	000002	万 科 A	139,603,771.28	3.25
7	601628	中国人寿	136,330,085.83	3.17
8	601318	中国平安	131,983,365.69	3.07
9	600048	保利地产	127,575,851.37	2.97
10	600000	浦发银行	125,262,030.11	2.91
11	600028	中国石化	118,482,637.37	2.75
12	600016	民生银行	115,291,799.11	2.68
13	600015	华夏银行	107,672,172.05	2.50
14	000401	冀东水泥	97,254,039.81	2.26
15	601088	中国神华	89,385,596.45	2.08
16	600383	金地集团	87,436,058.18	2.03
17	600104	上汽集团	80,602,774.73	1.87
18	000776	广发证券	77,943,072.17	1.81
19	600887	伊利股份	75,995,995.67	1.77
20	600036	招商银行	71,678,575.64	1.67

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。

8.4.2 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	601166	兴业银行	148,630,661.65	3.46
2	601601	中国太保	121,866,990.23	2.83
3	000858	五 粮 液	121,195,479.83	2.82
4	600519	贵州茅台	117,115,635.41	2.72

5	601628	中国人寿	106,672,245.14	2.48
6	600028	中国石化	99,731,427.06	2.32
7	600048	保利地产	97,960,603.95	2.28
8	000001	平安银行	96,634,018.27	2.25
9	600383	金地集团	91,417,202.63	2.13
10	600887	伊利股份	89,516,843.45	2.08
11	600837	海通证券	83,377,185.23	1.94
12	600030	中信证券	80,266,279.96	1.87
13	600015	华夏银行	78,924,278.55	1.83
14	600000	浦发银行	78,336,176.88	1.82
15	000002	万科A	72,549,209.60	1.69
16	600104	上汽集团	72,534,889.28	1.69
17	600036	招商银行	67,173,880.88	1.56
18	000401	冀东水泥	66,748,176.74	1.55
19	000024	招商地产	63,194,831.66	1.47
20	600016	民生银行	59,280,659.72	1.38

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。

8.4.3 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	6,246,831,156.32
卖出股票的收入（成交）总额	4,610,084,232.73

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。

8.5 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	120,084,000.00	1.84
2	央行票据	-	-

3	金融债券	50,065,000.00	0.77
	其中：政策性金融债	50,065,000.00	0.77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,743,133.50	0.03
8	其他	-	-
9	合计	171,892,133.50	2.64

8.6 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	120019	12 国债 19	1,200,000	120,084,000.00	1.84
2	110307	11 进出 07	500,000	50,065,000.00	0.77
3	110020	南山转债	13,790	1,462,429.50	0.02
4	110022	同仁转债	2,400	280,704.00	0.00

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	1,096,607.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,976,063.34
5	应收申购款	9,074,587.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,147,258.18

8.9.4 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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	158,070,078.76	2.43	重大事项停牌

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

§ 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	持有份额	占总份

			额比例		比例
206,908	60,947.44	6,383,893,662.67	50.62%	6,226,618,957.04	49.38%

9.2 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	3,808,394.60	0.03%

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(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	11,184,175,797.46
减：本报告期基金总赎回份额	5,272,997,356.46
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,610,512,619.71

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1)2012年2月3日 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)2012年9月24日 关于基金行业高级管理人员变更公告，秦军先生任华安基金管理有限公司副总经理。秦军先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(3)2012年9月24日 关于基金行业高级管理人员变更公告，章国富先生不再担任华安基金管理有限公司督察长，转任华安基金管理有限公司副总经理。章国富先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

(4)2012 年 9 月 24 日 关于基金行业高级管理人员变更公告，薛珍女士任华安基金管理有限公司督察长。薛珍女士经中国证监会核准取得高管任职资格。

(5) 2012 年 12 月 22 日 华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理变更公告，许之彦先生不再担任本基金的基金经理，牛勇先生继续担任本基金的基金经理。

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：
无。

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 109,000.00 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	
中国银河证券股份有限公司	1	4,863,846,891.03	44.84%	4,257,213.03	44.83%	-
招商证券股份有限公司	1	2,897,966,563.76	26.72%	2,488,948.52	26.21%	-

申银万国 证券股份 有限公司	1	1,311,306,592.80	12.09%	1,175,766.89	12.38%	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	885,962,736.14	8.17%	797,741.92	8.40%	-
中信建投 证券有限 责任公司	1	523,554,514.53	4.83%	475,247.69	5.00%	-
广发证券 股份有限 公司	1	364,959,050.39	3.36%	300,917.75	3.17%	-

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

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

(5) 通知托管人

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	
	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	25.11%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	726,371.02	9.82%	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	789,037.80	10.66%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	4,025,973.00	54.41%	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行有限责任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	2012-01-04
2	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
3	华安基金管理有限公司关于新增财通	《上海证券报》、	2012-01-16

	证券有限责任公司为代销机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
4	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。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-02-03
5	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
6	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
7	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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	关于旗下部分基金参加华融证券定投	《上海证券报》、	2012-05-31

	及非现场申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
14	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
15	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
16	关于电子直销平台开通“智能再平衡”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	2012-07-03
17	关于电子直销平台开通“农行机构电子直销”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-07-20
18	关于基金行业高级管理人员变更公告，秦军先生任华安基金管理有限公司副总经理。秦军先生经中国证监会核准取得高管任职资格。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-09-24
19	关于基金行业高级管理人员变更公告，章国富先生不再担任华安基金管理有限公司督察长，转任华安基金管理有限公司副总经理。章国富先生经中国证监会核准取得高管任职资格。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-09-24
20	关于基金行业高级管理人员变更公告，薛珍女士任华安基金管理有限公司督察长。薛珍女士经中国证监会核准取得高管任职资格。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-09-24
21	关于基金电子交易平台延长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	2012-11-03
22	华安基金管理有限公司关于华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金分红公告，向基金持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 1.63 元。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-11-06

23	关于旗下部分基金参加中国银行股份有限公司代销业务优惠营销活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-11-30
24	关于电子直销平台开通“货币通”货币基金份额电子支付业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-03
25	关于电子直销平台开通“支付宝”资金结算方式的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-12
26	华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金基金经理变更公告,许之彦先生不再担任本基金的基金经理,牛勇先生继续担任本基金的基金经理。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-22
27	关于旗下部分基金参加中国工商银行定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-12-28
28	关于旗下部分基金参加邮储银行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	2012-12-31

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 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；

12.2 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>。

12.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一三年三月二十七日