

**华安升级主题股票型证券投资基金**  
**2013 年半年度报告摘要**  
**2013 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

## § 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2013 年 8 月 20 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安升级主题股票
基金主代码	040020
交易代码	040020
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年4月22日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,132,613,965.53份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点投资于受益于产业结构升级、消费升级和技术升级的行业，分享中国经济结构转型过程中的投资收益。在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略。即：采取“自上而下”的方式选择行业，挖掘并投资于集中代表整个经济发展趋势的行业或主题；根据上述“自上而下”策略选择行业的基础上，采取“自下而上”的方法，运用基本面分析和实地调研相结合的研究方法选择个股。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于证券投资基金中的高风险投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

### 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的 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、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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	103,721,644.79
本期利润	251,134,284.16
加权平均基金份额本期利润	0.1855
本期基金份额净值增长率	19.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.1336
期末基金资产净值	1,147,149,847.67
期末基金份额净值	1.013

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 1 个月	-5.15%	1.96%	-12.59%	1.51%	7.44%	0.45%
过去 3 个月	3.37%	1.57%	-9.43%	1.17%	12.80%	0.40%
过去 6 个月	19.74%	1.46%	-10.13%	1.20%	29.87%	0.26%
过去一年	25.22%	1.29%	-8.68%	1.09%	33.90%	0.20%
自基金成立起至今	1.30%	1.21%	-26.52%	1.07%	27.82%	0.14%

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

根据基金合同的规定：本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%~95%，其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5~40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

#### 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

华安升级主题股票型证券投资基金

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

(2011 年 4 月 22 日至 2013 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 2013 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安顺封闭 1 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安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、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利、华安安信消费等 38 只开放式基金。管理资产规模达到 782.67 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		
陈俏宇	本基金的基金经理、投资研究部副总监	2011-04-22	-	17 年	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，17 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、安顺证券投资基金和华安宏利基金经理助理，2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任安顺证券投资基金、华安宏利基金经理，2008 年 2 月起担任安信证券投资基金的基金经理，2008 年 10 月起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。2011 年 4 月起同时担任本基金的基金经理。2012 年 9 月起兼任投资研究部副总监。

注: 1) 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。  
2) 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作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《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》、《华安升级主题股票型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益, 不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 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 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单只股票的数量极少，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

我们借用《双城记》中的名言“这是最好的时代，这是最坏的时代；这是信仰的时期，这是怀疑的时期”来描述上半年的 A 股市场。传统蓝筹板块在年初有短暂表现后，投资者开始意识到中国经济将进入弱复苏和窄周期的阶段，市场随即进入以成长为主要配置方向的积极防御阶段。尽管期间部分经济数据仍低于预期，但市场并未如原先那样博弈基于流动性预期放松的周期板块，而是仍旧坚守在如传媒、电子、医药、大众消费品和环保等行业内，这种选择既是对过往经济发展模式的反思，也是基于对转型经济的向往与信心。

本基金在行业配置上把握的关键词是“幸福”，我们始终认为经济转型是解决长期矛盾的真正出路，所以配置方向主要集中于民心所向行业，这其中既有受益于消费新趋势的电子行业，或消费长趋势的医药医疗服务行业，也有瓶颈行业，如环保和新材料行业等。我们在这些行业具体的个股选择中，坚守的关键词则是“核心竞争力”和“企业家精神”。这个阶段与其说是对成长理念的坚持，不如说是持续学习的过程。尽管我们在传媒行业的理解出现偏差，但在其余板块的有效配置，令组合整体绩效仍较为理想。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.013 元，本报告期份额净值增长率为 19.74%，同期业绩比较基准增长率为-10.13%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们现阶段对经济数据和流动性的关注度明显下降，因为我们放弃了对短期政策预期的博弈，常识告诉我们，经济发展模式中累积的问题需要新方式去解决，历史规律可能是投资中最需要摆脱的束缚。我们认为某些因素只是长期发展中的干扰音，经济转型是主旋律。面对新时代，我们需要的是学习、理解和接纳，既包括投资的新领域、新盈利模式、也包括估值体系的新视角。

投资策略方面，我们遵循本基金合同要求的主要投资方向，即受益于经济转

型的产业升级、技术升级和消费升级板块仍将是组合积极布局和持有的重点。未来的挑战在于我们需要进一步对部分新兴板块，如传媒行业及公司的盈利模式有更深入的理解和选择；另一方面对具体公司的投资中，我们将提高选择的标准，以期控制整体风险。这种高标准并非来自于静态低估值，相反更多来自于对行业空间和竞争格局的分析，对企业家战略和精神的尊重与认同，以期通过相对较长的投资期限来分享成长的收益。

#### 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副总经理、首席投资官。

翁启森，工业工程学硕士，曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，负责 QDII 基金的投资管理工作。现任华安香港精选基金(QDII)、华安大中华升级基金(QDII)的基金经理、全球投资部总监、基金投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选基金经理、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、华安 7 日鑫短期理财的基金经理、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，华安中国 A 股增强指数。现任华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理,指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，现任基金运营部总经理。

## (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

**4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期不进行收益分配。

## **5 托管人报告**

**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

**5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明**

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华安升级主题股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	39,913,404.31	23,003,298.27
结算备付金	1,870,169.31	550,134.67
存出保证金	292,755.75	115,206.28
交易性金融资产	1,032,227,683.30	1,176,151,463.40
其中：股票投资	972,491,683.30	1,116,133,463.40
基金投资	-	-
债券投资	59,736,000.00	60,018,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	70,000,000.00	39,600,000.00
应收证券清算款	5,191,418.00	2,106,648.26
应收利息	1,358,056.11	372,500.39
应收股利	-	-
应收申购款	1,190,966.04	41,621.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,152,044,452.82	1,241,940,873.25
负债和所有者权益	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日

负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	965,684.62
应付赎回款	1,923,392.63	1,434,707.73
应付管理人报酬	1,391,939.14	1,483,126.35
应付托管费	231,989.85	247,187.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,050,676.52	368,110.31
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	296,607.01	395,837.87
负债合计	4,894,605.15	4,894,654.60
所有者权益：		
实收基金	1,132,613,965.53	1,461,688,937.84
未分配利润	14,535,882.14	-224,642,719.19
所有者权益合计	1,147,149,847.67	1,237,046,218.65
负债和所有者权益总计	1,152,044,452.82	1,241,940,873.25

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.013 元，基金份额总额 1,132,613,965.53 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安升级主题股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	<b>265,964,971.23</b>	<b>13,184,025.91</b>
1.利息收入	1,509,819.74	1,550,275.27
其中：存款利息收入	176,949.29	181,670.13
债券利息收入	998,239.29	1,368,605.14
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	334,631.16	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	116,894,310.13	-133,285,911.03
其中：股票投资收益	110,842,815.95	-145,108,604.72
基金投资收益	-	-
债券投资收益	302,580.43	445,002.39
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,748,913.75	11,377,691.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	147,412,639.37	144,800,852.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	148,201.99	118,808.78
<b>减：二、费用</b>	<b>14,830,687.07</b>	<b>14,355,772.91</b>
1. 管理人报酬	9,712,042.55	10,347,837.98
2. 托管费	1,618,673.78	1,724,639.70
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	3,299,992.08	2,078,183.66
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	199,978.66	205,111.57
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>251,134,284.16</b>	<b>-1,171,747.00</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>251,134,284.16</b>	<b>-1,171,747.00</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安升级主题股票型证券投资基金

本报告期：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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)	1,461,688,937.84	-224,642,719.19	1,237,046,218.65
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	251,134,284.16	251,134,284.16
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)	-329,074,972.31	-11,955,682.83	-341,030,655.14
其中：1.基金申购款	246,753,555.77	-2,955,461.07	243,798,094.70
2.基金赎回款	-575,828,528.08	-9,000,221.76	-584,828,749.84
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)	1,132,613,965.53	14,535,882.14	1,147,149,847.67
项目	上年度可比期间 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)	1,753,527,924.15	-331,513,068.37	1,422,014,855.78
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本期 利润)	-	-1,171,747.00	-1,171,747.00
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)	-148,288,862.24	26,080,429.10	-122,208,433.14
其中：1.基金申购款	13,477,111.81	-2,399,883.08	11,077,228.73
2.基金赎回款	-161,765,974.05	28,480,312.18	-133,285,661.87
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)	1,605,239,061.91	-306,604,386.27	1,298,634,675.64

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：李劼，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安升级主题股票型证券投资基金(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”)证监许可[2011]317 号《关于核准华安升级主题股票型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。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 4,118,599,416.41 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第 134 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 4 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 4,119,090,620.47 份基金份额,其中认购资金利息折合 491,204.06 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括 A 股股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%~95%,其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%;债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5~40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%;现金或者到期日在 1 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: 80%×沪深 300 指数收益率+20%×中国债券总指数收益率。

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 8 月 23 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《企业会计准则一

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》、《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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 重要会计政策和会计估计

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

本会计期间不存在差错更正。

#### 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》、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》及其他相关税务法规和实务操作, 主要税项列示如下:

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围, 不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征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。2013 年 1 月 1 日以前, 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。自 2013 年 1 月 1 日起, 对基金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。

(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 关联方关系

**6.4.7.1 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。

#### 6.4.7.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构

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。

#### 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.8.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.8.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.8.2 关联方报酬

###### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,712,042.55	10,347,837.98
其中：支付销售机构的客户维护费	3,792,714.47	4,937,741.39

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 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,618,673.78	1,724,639.70

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	2012年1月1日至2012年6月30日	2012年1月1日至2012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
中国建设银行	39,913,404.31	154,368.52	74,006,140.13	172,628.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.9 期末（2013年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000999	华润三九	2013-06-03	重大资产 重组	29.60	2013-08-19	26.51	390,000	11,031,093.91	11,544,000.00	-

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.10 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	972,491,683.30	84.41
	其中：股票	972,491,683.30	84.41
2	固定收益投资	59,736,000.00	5.19
	其中：债券	59,736,000.00	5.19
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	70,000,000.00	6.08
	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	41,783,573.62	3.63
6	其他各项资产	8,033,195.90	0.70
7	合计	1,152,044,452.82	100.00

## 7.2 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	采矿业	-	-
C	制造业	808,225,310.92	70.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	13,224,188.50	1.15
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,888,473.36	3.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,602,069.52	2.41
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	19,259,641.00	1.68
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	59,292,000.00	5.17
	合计	972,491,683.30	84.77

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002450	康得新	4,083,398	114,253,476.04	9.96
2	002250	联化科技	4,050,000	80,959,500.00	7.06
3	600867	通化东宝	4,730,000	70,429,700.00	6.14
4	600256	广汇能源	4,575,000	59,292,000.00	5.17
5	002038	双鹭药业	960,000	56,256,000.00	4.90
6	600332	广州药业	1,230,000	42,139,800.00	3.67
7	300146	汤臣倍健	931,382	40,971,494.18	3.57

8	002456	欧菲光	730,000	34,791,800.00	3.03
9	002241	歌尔声学	932,292	33,832,876.68	2.95
10	600887	伊利股份	1,000,000	31,280,000.00	2.73

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 <http://www.huaan.com.cn> 网站的半年度报告正文。

#### 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	002008	大族激光	40,080,940.99	3.24
2	002241	歌尔声学	34,976,461.75	2.83
3	000999	华润三九	28,783,940.57	2.33
4	600594	益佰制药	28,127,114.71	2.27
5	002456	欧菲光	25,794,692.11	2.09
6	002415	海康威视	25,160,763.00	2.03
7	002570	贝因美	25,119,450.58	2.03
8	600256	广汇能源	25,036,811.64	2.02
9	002385	大北农	24,314,026.61	1.97
10	600316	洪都航空	23,826,494.75	1.93
11	300070	碧水源	23,625,570.49	1.91
12	600867	通化东宝	23,223,506.93	1.88
13	601166	兴业银行	22,916,253.94	1.85
14	002255	海陆重工	22,347,845.33	1.81
15	300273	和佳股份	22,144,498.25	1.79
16	002185	华天科技	17,371,735.62	1.40
17	000050	深天马 A	16,774,733.55	1.36
18	000001	平安银行	16,328,162.40	1.32
19	600329	中新药业	14,309,198.18	1.16
20	300088	长信科技	14,186,902.14	1.15

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	600016	民生银行	87,814,198.99	7.10



2	600741	华域汽车	65,003,564.55	5.25
3	600104	上汽集团	61,971,869.68	5.01
4	601318	中国平安	55,272,824.36	4.47
5	002450	康得新	52,649,101.72	4.26
6	600157	永泰能源	46,427,606.17	3.75
7	002311	海大集团	37,231,427.28	3.01
8	002001	新 和 成	34,957,685.64	2.83
9	000858	五 粮 液	34,749,831.24	2.81
10	600315	上海家化	33,163,454.92	2.68
11	600518	康美药业	29,799,430.91	2.41
12	600570	恒生电子	28,890,686.97	2.34
13	600000	浦发银行	28,660,277.00	2.32
14	002415	海康威视	28,132,316.06	2.27
15	600887	伊利股份	26,511,543.65	2.14
16	002250	联化科技	26,121,523.26	2.11
17	002501	利源铝业	24,693,437.12	2.00
18	002376	新北洋	22,327,752.88	1.80
19	000625	长安汽车	21,941,462.55	1.77
20	601166	兴业银行	21,334,388.88	1.72

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	832,845,280.19
卖出股票的收入（成交）总额	1,235,024,515.61

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	-	-
3	金融债券	59,736,000.00	5.21
	其中：政策性金融债	59,736,000.00	5.21
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-

8	其他	-	-
9	合计	59,736,000.00	5.21

### 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	120318	12 进出 18	600,000	59,736,000.00	5.21

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

#### 7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.10.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.10.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	292,755.75

2	应收证券清算款	5,191,418.00
3	应收股利	-
4	应收利息	1,358,056.11
5	应收申购款	1,190,966.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,033,195.90

#### 7.10.4 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。

#### 7.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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
22,205	51,007.16	123,386,246.52	10.89%	1,009,227,719.01	89.11%

#### 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
基金管理人所有从业人员持有 本基金	5,512,338.15	0.48669%

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 50 万份至 100 万份（含）；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 100 万份以上。

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 4 月 22 日）基金份额总额	4,119,090,620.47
本报告期期初基金份额总额	1,461,688,937.84
本报告期基金总申购份额	246,753,555.77
减：本报告期基金总赎回份额	575,828,528.08
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,132,613,965.53

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本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：

无。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

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

本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

本报告期内无管理人、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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
齐鲁证券有限公司	1	445,284,582.44	21.70%	394,032.42	21.43%	-
瑞银证券有限责任公司	1	347,923,770.38	16.96%	307,877.94	16.74%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	238,295,712.95	11.61%	210,867.54	11.47%	-
东北证券股份有限公司	1	204,279,561.72	9.96%	185,976.05	10.11%	-
兴业证券股份有限公司	1	134,138,367.11	6.54%	122,118.81	6.64%	-
上海证券有限责任公司	1	113,559,490.22	5.53%	103,384.74	5.62%	-
国信证券股份有限公司	1	104,638,527.20	5.10%	95,262.99	5.18%	-
申银万国证券股份有限公司	1	84,602,399.43	4.12%	74,864.77	4.07%	-
新时代证券有限责任公司	1	71,898,537.72	3.50%	65,456.27	3.56%	-
万联证券有限责任公司	1	61,062,802.46	2.98%	55,591.54	3.02%	-

中信证券股份有限公司	1	59,428,053.68	2.90%	54,102.98	2.94%	-
华安证券有限责任公司	1	59,077,982.85	2.88%	53,784.54	2.93%	-
中国国际金融有限公司	1	29,501,065.94	1.44%	26,857.63	1.46%	-
长江证券股份有限公司	1	29,037,900.11	1.42%	26,436.10	1.44%	-
光大证券股份有限公司	1	26,334,395.61	1.28%	23,303.57	1.27%	-
德邦证券有限责任公司	1	23,339,381.58	1.14%	21,247.83	1.16%	-
中国银河证券股份有限公司	1	11,929,371.20	0.58%	10,860.41	0.59%	-
中银国际证券有限责任公司	1	7,370,363.00	0.36%	6,709.99	0.36%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
广州证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任	1	-	-	-	-	-

公司						
财富证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财达证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
长城证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

(1) 新增光大证券股份有限公司深圳交易单元 1 个；

(2) 新增长城证券有限责任公司上海交易单元 1 个；

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
齐鲁证券有限公司	-	-	3,801,000.00	0.66%	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-



证券股份 有限公司						
东北证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
兴业证 券股份 有限公 司	-	-	88,000,000.00	15.23%	-	-
上海证 券有限 责任公 司	-	-	50,000,000.00	8.65%	-	-
国信证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
申银万 国证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
新时代 证 券有限 责任公 司	7,906,080.00	100.00%	-	-	-	-
万联证 券有限 责任公 司	-	-	79,000,000.00	13.67%	-	-
中信证 券股份 有限公 司	-	-	74,900,000.00	12.97%	-	-
华安证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 有限公 司	-	-	-	-	-	-
长江证 券股份 有限公 司	-	-	92,000,000.00	15.93%	-	-
光大证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-
德邦证 券有限 责任公 司	-	-	50,000,000.00	8.65%	-	-
中国银 河证 券股份 有限公 司	-	-	-	-	-	-

中银国际 证券有限 责任公司	-	-	68,000,000.00	11.77%	-	-
广发证券 股份有限 公司	-	-	72,000,000.00	12.46%	-	-
广州证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
湘财证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
宏源证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中山证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
财富证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
天风证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
方正证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
联讯证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
招商证券 股份有限	-	-	-	-	-	-

公司						
财达证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司  
二〇一三年八月二十四日