

# 华安升级主题股票型证券投资基金 2013 年年度报告摘要

2013 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一四年三月三十一日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 18 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安升级主题股票
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	718, 534, 237. 98 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@huan.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

登载基金年度报告正文的互联网网址	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013 年	2012 年	2011 年 4 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2011 年 12 月 31 日
本期已实现收益	204,392,685.95	-243,432,150.58	-144,001,207.19
本期利润	291,955,061.67	51,264,812.11	-343,756,172.44
加权平均基金份额本期利润	0.2609	0.0317	-0.1379
本期基金份额净值增长率	21.75%	4.32%	-18.90%
3.1.2 期末数据和指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0227	-0.2225	-0.1891
期末基金资产净值	739,900,404.61	1,237,046,218.65	1,422,014,855.78
期末基金份额净值	1.030	0.846	0.811

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	-6.96%	1.31%	-3.25%	0.90%	-3.71%	0.41%
过去六个 月	1.68%	1.43%	3.56%	1.03%	-1.88%	0.40%
过去一年	21.75%	1.44%	-7.17%	1.12%	28.92%	0.32%
自基金合 同生效起 至今	3.00%	1.25%	-24.57%	1.06%	27.57%	0.19%

注：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%

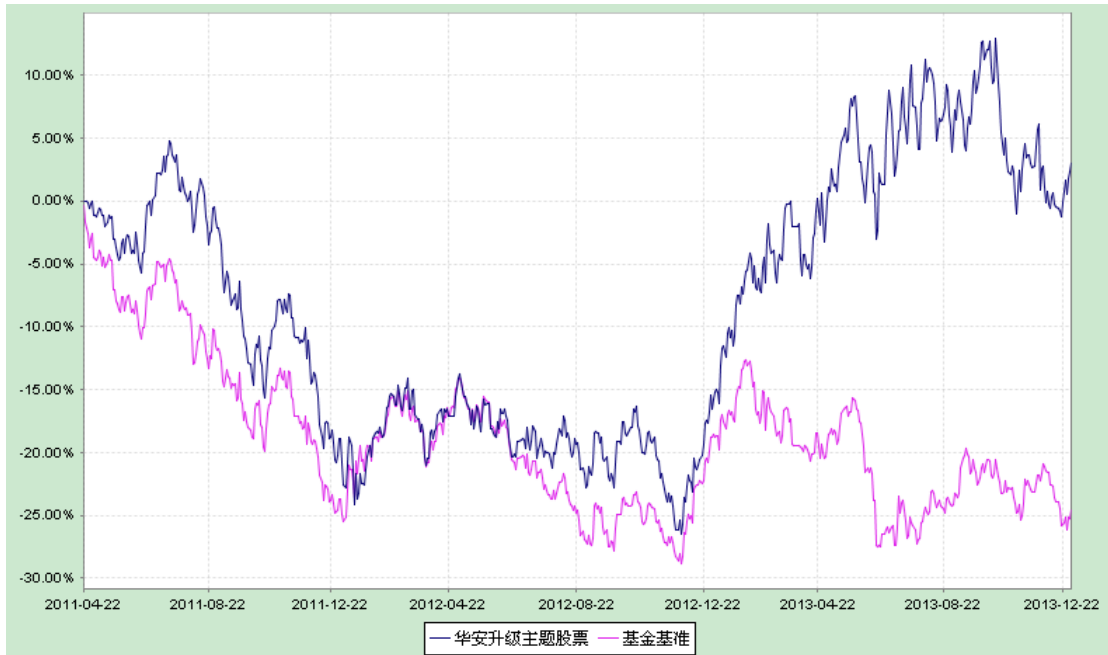
根据基金合同的规定：本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括 A 股股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、货币市场工具和资产支持证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为 60%~95%，其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业和传统行业中的技术升级相关行业的比例不低于股票投资的 80%；债券、权证、现金、货币市场工具和资产支持证券占基金资产的比例范围为 5~40%，其中权证投资占基金资产净值的比例范围为 0~3%；现金或者到期日在 1 年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

### 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 12 月 31 日）

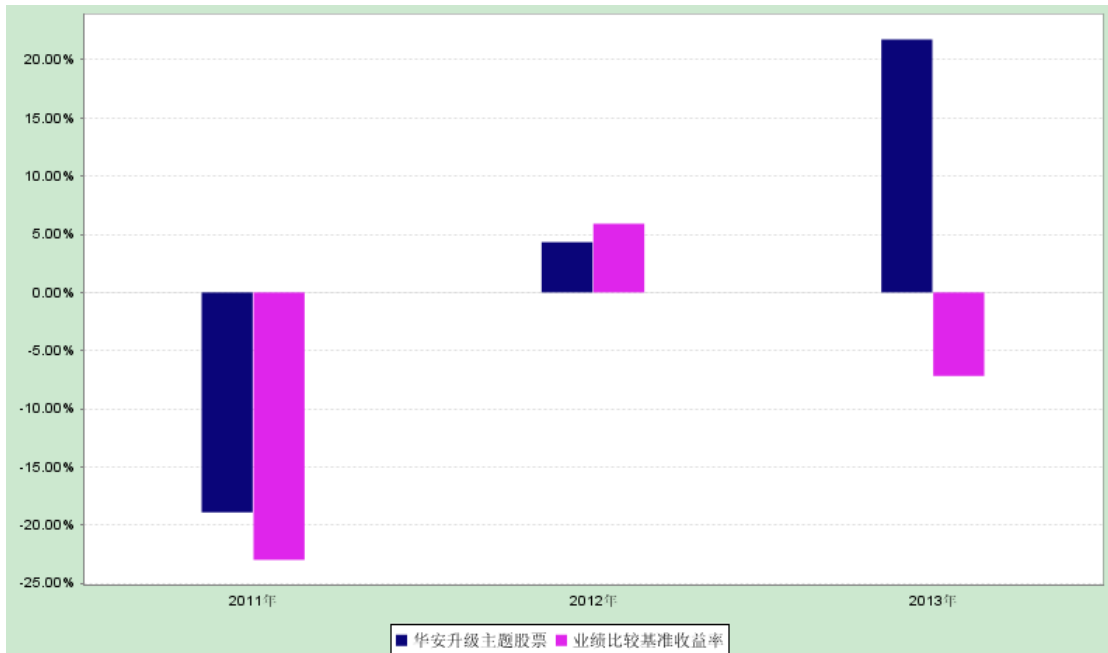


注：根据《华安升级主题股票型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓期不超过 6 个月。截至本报告期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分“基金的投资”中投资范围、投资限制的有关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 华安升级主题股票型证券投资基金

合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注：本基金基金合同生效日为 2011 年 4 月 22 日，合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2013 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安顺封闭 1 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安月安鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利债券、华安安信消费股票、华安纳斯达克 100 指数、华安黄金易（ETF）、华安黄金 ETF 联接、华安沪深 300 量化指数、华安年年红债券、华安生态优先股票、华安中证细分地产 ETF、华安中证细分医药 ETF 等 46 只开放式基金。管理资产规模达到 838.62 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈俏宇	本基金的基金经理、投资研究部副总监	2011-04-22	-	18 年	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，18 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：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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统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。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 3 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2013 年市场，我们发现这是颠覆性的一年，其中有对新兴行业市场空间和企业竞争力认知的颠覆，更有对估值体系和价值观的某种颠覆。尽管我们依旧对其中的部分不能认知，但不可否认这种改变是伴随着我国经济转型带来的理念上的积极改变，是对过往经济发展模式的反思，同时也是对经济转型的向往与支持。我们可以用几个指数年度表现的差异来说明市场的结构性分化，比如沪深 300 指数跌幅为 7.65%，上证 50 指数跌幅则为 15.23%，与此同时中证 500 指数的涨幅为 16.89%，创业板综指的涨幅则高达 74.73%。

从全年来看，本基金在行业配置上把握的关键词是幸福，因为我们认为向往更可持续的经济发展模式，更有安全感的生活环境和方式，是每个人追求的最简单真实的理想生活，民众的幸福感也是一国核心竞争力的最终体现。所以组合的整体配置方向主要集中于长期有刚性需求支撑的医药及医疗服务行业，出现消费新趋势的电子行业，以及对经济有明显制约的环保行业，而这些板块亦有稳定增长的业绩支持。应该说整个组合阶段性取得了良好的收益，但对更新兴的、市场空间有更广阔想象力的传媒和软件等行业，本组合则接近于零的配置，也使组合未能充分分享结构性牛市的盛宴。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.03 元，本报告期份额净值增长率为 21.75%，同期业绩比较基准增长率为-7.17%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

正如前述所言，我们认为市场正在发生的改变折射的是对过往赶超型经济战略的某种反思，以及对未来可持续发展的向往。所以我们认为经济数据本身带来的习惯性博弈会变少，但是对于我们而言，更大的挑战则是来自于那些被市场更为追捧的新成长板块，坦率说由于个人的理解力，这些转变甚至让我们有些许不安。三中全会之后，我们似乎已经看到了市场仍将会如 2013 年那样，积极地在成长板块中寻找投资标的。但是，显然市场初期由于对经济不确定性的判断，已从稳定增长的偏好性阶段转向对成长速率更为推崇的阶段，即防御性进攻转向于进攻性防御的风格。我们反思自己偏保守的风格中缺少进攻性，需要在新阶段对这部分投资标的有更开放和深入的理解与挖掘。

投资策略方面，我们计划保留稳定增长型品种作为组合的基础配置，因为我们相信业绩增长的稳定性是估值最有力的支撑，尤其是在泡沫化的后端。与此同时，我们亦需要将更多的时间和精力去解读如互联网等新兴行业创造出的市场空间和盈利模式的突破。虽然竞争格局极不稳定，但相关新兴行业发展空间的几何级爆发，带来的吸引力的确极具诱惑性。可以说，相较 2013 年对估值的挑战性，2014 年对风险收益比的理解和挑战性更大。

#### 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验的描述

###### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、首席投资官。

翁启森，基金投资部兼全球投资部总监，工业工程学硕士。曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信任基金经理。2008 年 4 月加入华安基金管理有限公司，现华安香港精选、华安大中华升级基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选的基金经理，投资研究部总监。

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

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理，指数投资部总监。

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

## （2）托管银行

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

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

**4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期不进行收益分配。

**§ 5 托管人报告**

**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

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

## § 6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,注册会计师汪棣、傅琛慧签字出具了普华永道中天审字(2014)第 20835 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华安升级主题股票型证券投资基金

报告截止日：2013 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
<b>资 产:</b>		
银行存款	42,040,145.77	23,003,298.27
结算备付金	539,834.56	550,134.67
存出保证金	186,576.33	115,206.28
交易性金融资产	669,450,083.27	1,176,151,463.40
其中：股票投资	669,450,083.27	1,116,133,463.40
基金投资	-	-
债券投资	-	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	30,000,000.00	39,600,000.00
应收证券清算款	755,019.33	2,106,648.26
应收利息	16,536.77	372,500.39
应收股利	-	-
应收申购款	157,489.88	41,621.98
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	743,145,685.91	1,241,940,873.25
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 2013年12月31日</b>	<b>上年度末 2012年12月31日</b>
<b>负 债:</b>		

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	1,324,140.90	1,434,707.73
应付管理人报酬	981,347.93	1,483,126.35
应付托管费	163,557.98	247,187.72
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	382,233.72	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	394,000.77	395,837.87
负债合计	3,245,281.30	4,894,654.60
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	718,534,237.98	1,461,688,937.84
未分配利润	21,366,166.63	-224,642,719.19
所有者权益合计	739,900,404.61	1,237,046,218.65
负债和所有者权益总计	743,145,685.91	1,241,940,873.25

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.030 元，基金份额总额 718,534,237.98 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

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 12月31日	2012年1月1日至2012年 12月31日
一、收入	<b>317,354,139.39</b>	<b>78,040,759.85</b>
1. 利息收入	2,404,589.13	3,039,054.55
其中：存款利息收入	370,359.96	407,261.87

债券利息收入	1,569,116.01	2,510,086.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	465,113.16	121,706.60
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	226,986,400.92	-219,892,900.84
其中：股票投资收益	220,815,805.49	-236,790,454.17
基金投资收益	-	-
债券投资收益	209,860.43	445,511.95
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	5,960,735.00	16,452,041.38
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	87,562,375.72	294,696,962.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	400,773.62	197,643.45
<b>减：二、费用</b>	<b>25,399,077.72</b>	<b>26,775,947.74</b>
1. 管理人报酬	16,911,391.36	19,633,581.52
2. 托管费	2,818,565.22	3,272,263.69
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	5,256,501.44	3,456,853.90
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	412,619.70	413,248.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>291,955,061.67</b>	<b>51,264,812.11</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>291,955,061.67</b>	<b>51,264,812.11</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	291,955,061.67	291,955,061.67
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)	-743,154,699.86	-45,946,175.85	-789,100,875.71
其中：1. 基金申购款	401,845,142.28	5,423,867.23	407,269,009.51
2. 基金赎回款	-1,144,999,842.14	-51,370,043.08	-1,196,369,885.22
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)	718,534,237.98	21,366,166.63	739,900,404.61
项目	上年度可比期间 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)	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)	-	51,264,812.11	51,264,812.11
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)	-291,838,986.31	55,605,537.07	-236,233,449.24
其中：1. 基金申购款	22,035,238.25	-4,149,983.30	17,885,254.95
2. 基金赎回款	-313,874,224.56	59,755,520.37	-254,118,704.19
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)	1,461,688,937.84	-224,642,719.19	1,237,046,218.65

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：



基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安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基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 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(以下简称“中国建设银行”)。

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，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票资产的投资比例占基金资产的 60%-95%，其中投资于战略性新兴产业、消费升级行业 and 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的投资比例占基金资产的 5%-40%；权证的投资比例占基金资产净值的 0%-3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为： $80\% \times$  沪深 300 指数收益率  $+ 20\% \times$  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 2014 年 3 月 28 日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安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 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 2013 年度 财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了

本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明**

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **7.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **7.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **7.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **7.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从上市公司取得的股息红利所得，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。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金公司”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.8.1.1 股票交易

无。

##### 7.4.8.1.2 权证交易

无。

##### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年12月 31日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	16,911,391.36	19,633,581.52
其中：支付销售机构的客户 维护费	6,199,379.30	8,531,773.06

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。

**7.4.8.2.2 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12月31日	2012年1月1日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,818,565.22	3,272,263.69

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。

**7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

无。

**7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**
**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

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

无。

**7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2013年1月1日至2013年12月31日		2012年1月1日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	42,040,145.77	332,905.93	23,003,298.27	392,482.13

注：本基金的银行存款由基金托管人建设银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**7.4.9 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券**
**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
000625	长安汽车	2013-12-31	公告 重大 事项	11.45	2014-01-03	11.72	800,000	10,089,542.54	9,160,000.00	-
002022	科华生物	2013-12-20	公告 重大 事项	16.82	2014-01-27	18.50	330,000	5,211,506.40	5,550,600.00	-

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2013 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。

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2013 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。

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量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 654,739,483.27 元，属于第二层级的余额为 14,710,600.00 元，无属于第三层级的余额(2012 年 12 月 31 日：第一层级 1,116,133,463.40 元，第二层级 60,018,000.00 元，无属于第三层级的余额)。

(ii) 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。

(iii) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	669,450,083.27	90.08
	其中：股票	669,450,083.27	90.08
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	30,000,000.00	4.04
	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	42,579,980.33	5.73

6	其他各项资产	1,115,622.31	0.15
7	合计	743,145,685.91	100.00

## 8.2 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	514,004,360.85	69.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,076,800.00	1.63
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	45,322.42	0.01
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	66,090,900.00	8.93
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	28,693,000.00	3.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	27,651,100.00	3.74
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	20,888,600.00	2.82
	合计	669,450,083.27	90.48

## 8.3 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	002250	联化科技	3,150,000	66,118,500.00	8.94

2	600867	通化东宝	3,850,000	58,943,500.00	7.97
3	002450	康得新	2,350,000	57,105,000.00	7.72
4	300146	汤臣倍健	760,000	55,396,400.00	7.49
5	600887	伊利股份	1,000,000	39,080,000.00	5.28
6	002038	双鹭药业	646,000	32,655,300.00	4.41
7	600518	康美药业	1,682,169	30,279,042.00	4.09
8	300070	碧水源	700,000	28,693,000.00	3.88
9	002241	歌尔声学	800,333	28,075,681.64	3.79
10	300273	和佳股份	1,051,495	27,244,235.45	3.68

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

#### 8.4 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	002008	大族激光	62,939,310.54	5.09
2	002415	海康威视	42,744,805.78	3.46
3	002241	歌尔声学	40,949,361.75	3.31
4	600518	康美药业	32,464,177.66	2.62
5	000999	华润三九	31,689,040.57	2.56
6	002570	贝因美	29,882,613.38	2.42
7	601166	兴业银行	28,988,253.94	2.34
8	600256	广汇能源	28,644,756.33	2.32
9	600316	洪都航空	28,207,462.08	2.28
10	600594	益佰制药	28,127,114.71	2.27
11	300090	盛运股份	28,118,763.86	2.27
12	300273	和佳股份	26,062,776.83	2.11
13	002456	欧菲光	25,794,692.11	2.09
14	300070	碧水源	24,415,570.49	1.97
15	002385	大北农	24,314,026.61	1.97
16	600703	三安光电	23,849,943.15	1.93



17	600867	通化东宝	23,223,506.93	1.88
18	002255	海陆重工	22,347,845.33	1.81
19	300079	数码视讯	21,887,656.64	1.77
20	000625	长安汽车	20,294,639.76	1.64

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	002450	康得新	102,327,803.54	8.27
2	600016	民生银行	87,814,198.99	7.10
3	600741	华域汽车	65,003,564.55	5.25
4	600104	上汽集团	61,971,869.68	5.01
5	601318	中国平安	55,272,824.36	4.47
6	002415	海康威视	46,823,445.51	3.79
7	600157	永泰能源	46,427,606.17	3.75
8	002250	联化科技	45,466,319.02	3.68
9	002008	大族激光	45,395,936.57	3.67
10	600332	白云山	41,056,996.63	3.32
11	002570	贝因美	39,618,914.65	3.20
12	002311	海大集团	37,231,427.28	3.01
13	002456	欧菲光	36,410,850.75	2.94
14	002001	新和成	34,957,685.64	2.83
15	000858	五粮液	34,749,831.24	2.81
16	600315	上海家化	33,163,454.92	2.68
17	600594	益佰制药	31,897,043.73	2.58
18	600887	伊利股份	31,848,450.84	2.57
19	000999	华润三九	30,901,335.96	2.50
20	600316	洪都航空	30,620,302.38	2.48
21	600518	康美药业	29,799,430.91	2.41
22	600570	恒生电子	28,890,686.97	2.34

23	600000	浦发银行	28,660,277.00	2.32
24	601166	兴业银行	27,208,104.88	2.20
25	600703	三安光电	25,373,874.85	2.05

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	1,263,613,168.64
卖出股票的收入（成交）总额	2,018,624,089.98

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

无。

#### 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

无。

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.9.1 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。

##### 8.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 8.10.1 本基金投资国债期货的投资政策

无。

### 8.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资国债期货。

### 8.10.3 本基金投资国债期货的投资评价

无。

## 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1** 本报告期内，基金投资的前十名其他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。

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

### 8.11.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	186,576.33
2	应收证券清算款	755,019.33
3	应收股利	-
4	应收利息	16,536.77
5	应收申购款	157,489.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,115,622.31

### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转债。

### 8.11.5 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
16,345	43,960.49	101,110,417.49	14.07%	617,423,820.49	85.93%

## 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	1,330,322.09	0.19%

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 万至 100 万份。

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(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	401,845,142.28
减：本报告期基金总赎回份额	1,144,999,842.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	718,534,237.98

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

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

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本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为人民币 93,000.00 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

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。

### 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	
齐鲁证券有限公司	1	658,053,206.10	20.34%	582,311.76	20.12%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	495,230,682.80	15.31%	438,229.86	15.14%	-
瑞银证券有限责任公司	1	348,653,770.40	10.78%	308,523.91	10.66%	-
东北证券股份有限公司	1	245,334,854.90	7.58%	223,352.07	7.72%	-
申银万国证券股份有限公司	1	199,127,836.40	6.16%	176,208.29	6.09%	-

上海证券有 限责任公司	1	165,723,565.70	5.12%	150,874.64	5.21%	-
方正证券股 份有限公司	1	140,834,528.10	4.35%	124,625.05	4.31%	-
兴业证券股 份有限公司	1	134,138,367.10	4.15%	122,118.81	4.22%	-
万联证券有 限责任公司	1	133,986,355.80	4.14%	121,981.05	4.22%	-
国信证券股 份有限公司	1	104,638,527.20	3.23%	95,262.99	3.29%	-
湘财证券有 限责任公司	1	96,679,854.36	2.99%	85,552.45	2.96%	-
新时代证券 有限责任公司	1	71,898,537.72	2.22%	65,456.27	2.26%	-
长江证券股 份有限公司	1	61,534,564.64	1.90%	56,021.04	1.94%	-
中信证券股 份有限公司	1	59,428,053.68	1.84%	54,102.98	1.87%	-
华安证券有 限责任公司	1	59,077,982.85	1.83%	53,784.54	1.86%	-
广州证券有 限责任公司	1	58,252,463.41	1.80%	53,032.89	1.83%	-
光大证券股 份有限公司	1	54,978,826.71	1.70%	48,651.17	1.68%	-
长城证券有 限责任公司	1	53,309,812.36	1.65%	48,532.77	1.68%	-
中国国际金 融有限公司	1	29,501,065.94	0.91%	26,857.63	0.93%	-
中国银河证 券股份有限 公司	1	25,802,416.05	0.80%	23,490.29	0.81%	-
德邦证券有 限责任公司	1	23,339,381.58	0.72%	21,247.83	0.73%	-
宏源证券股 份有限公司	1	7,695,561.81	0.24%	6,809.87	0.24%	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	7,370,363.00	0.23%	6,709.99	0.23%	-
广发证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财达证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
联讯证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
天风证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 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)协议签署并通知托管人

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；

**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
齐鲁证券有限公司	-	-	3,801,000.00	0.41%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	30,000,000.00	3.27%	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	50,000,000.00	5.44%	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	88,000,000.00	9.58%	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	149,900,000.00	16.32%	-	-
国信证券股	-	-	-	-	-	-



份有限公司						
湘财证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
新时代证券 有限责任公 司	7,906,080.00	100.00%	-	-	-	-
长江证券股 份有限公司	-	-	92,000,000.00	10.02%	-	-
中信证券股 份有限公司	-	-	74,900,000.00	8.15%	-	-
华安证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
广州证券有 限责任公司	-	-	40,000,000.00	4.35%	-	-
光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金 融有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证 券股份有限 公司	-	-	200,000,000.00	21.77%	-	-
德邦证券有 限责任公司	-	-	50,000,000.00	5.44%	-	-
宏源证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证 券有限责任 公司	-	-	68,000,000.00	7.40%	-	-
广发证券股 份有限公司	-	-	72,000,000.00	7.84%	-	-
海通证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
财达证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
财富证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

联讯证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
天风证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中山证券有 限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-

**§ 12 影响投资者决策的其他重要信息**

无。

华安基金管理有限公司  
二〇一四年三月三十一日