

**华安大中华升级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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2014 年 3 月 14 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       | 华安大中华升级股票（QDII） |
| 基金主代码      | 040021          |
| 交易代码       | 040021          |
| 基金运作方式     | 契约型开放式          |
| 基金合同生效日    | 2011年5月17日      |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司      |
| 基金托管人      | 中国银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 53,735,886.67份  |
| 基金合同存续期    | 不定期             |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 在合理控制投资风险和保障基金资产流动性的基础上，追求中长期资本增值，力求为投资者获取超越业绩比较基准的回报。   |
| 投资策略   | <p>本基金以价值和成长投资理念为导向，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。</p> <p>行业层面以经济升级受益作为行业配置和个股挖掘的主要线索。通过对于经济结构调整的跟踪和研究，以及对于地区资源禀赋比较，对各行业的发展趋势和发展阶段进行预期，选择优势行业作为主要投资目标。</p> <p>个股方面通过对大中华地区的股票基本面的分析和研究，考察公司的产业竞争环境、业务模式、盈利模式和增长模式、公司治理结构以及公司股票的估值水平，挖掘受益于中国地区经济升级，并具备中长期持续增长或阶段性高速增长、且股票估值水平偏低的上市公司进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金业绩比较基准是MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)   |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的股票型基金，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            | 中国银行股份有限公司           |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 冯颖                    | 唐州徽                  |
|         | 联系电话 | 021-38969999          | 010-66594855         |
|         | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn | fcid@bankofchina.com |
| 客户服务电话  |      | 4008850099            | 95566                |
| 传真      |      | 021-68863414          | 010-66594942         |

## 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

| 项目   |    | 境外资产托管人                           |
|------|----|-----------------------------------|
| 名称   | 英文 | Bank of China (Hong Kong) Limited |
|      | 中文 | 中国银行(香港)有限公司                      |
| 注册地址 |    | 香港花园道 1 号中银大厦                     |
| 办公地址 |    | 香港花园道 1 号中银大厦                     |
| 邮政编码 |    | -                                 |

## 2.5 信息披露方式

|                     |                             |
|---------------------|-----------------------------|
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.huaan.com.cn            |
| 基金年度报告备置地点          | 上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、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 5 月 17 日(基金合同生效日)至 2011 年 12 月 31 日 |
|---------------|---------------|---------------|--|
| 本期已实现收益       | 10,224,014.45 | -8,617,896.46 | -6,465,900.03                              |
| 本期利润          | 13,351,212.54 | 15,342,026.53 | -24,017,600.01                             |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1712        | 0.1413        | -0.1333                                    |
| 本期基金份额净值增长率   | 19.64%        | 18.05%        | -20.20%                                    |
| 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  | 0.0039        | -0.1269       | -0.2024                                    |
| 期末基金资产净值      | 60,539,018.27 | 97,240,324.93 | 90,664,672.69                              |
| 期末基金份额净值      | 1.127         | 0.942         | 0.798                                      |

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益

水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

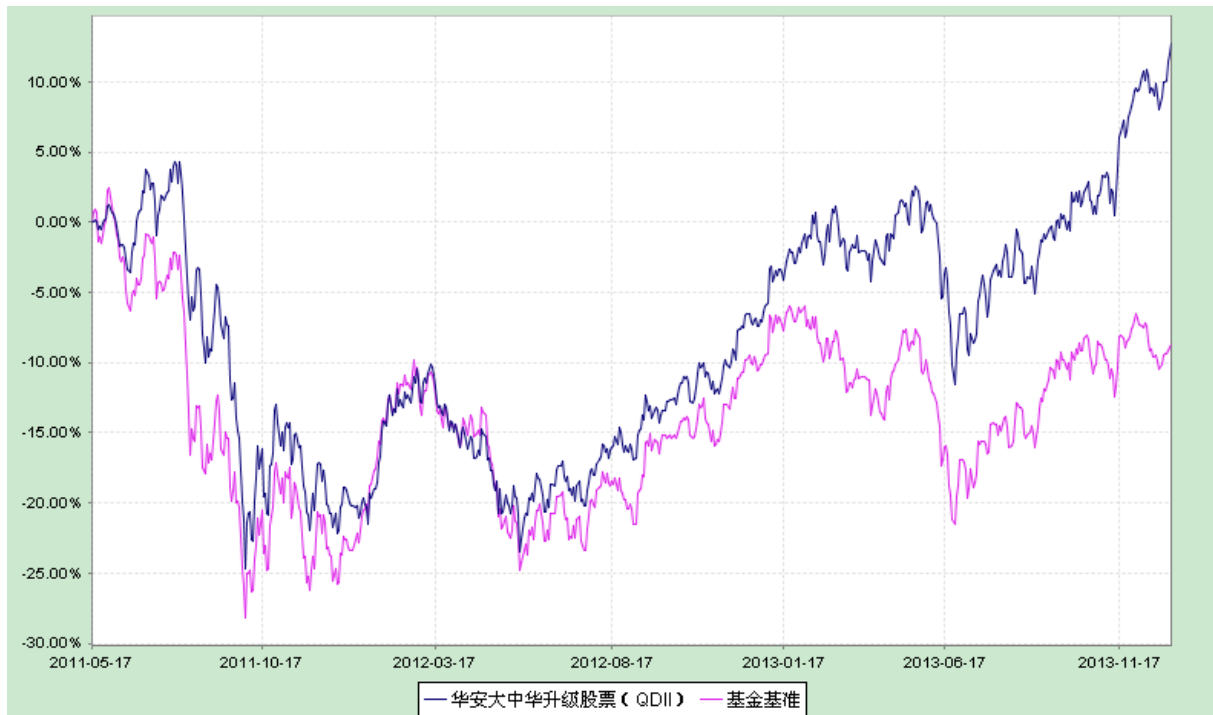
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去 3 个月    | 13.38%   | 0.86%       | 2.85%      | 0.76%         | 10.53% | 0.10%  |
| 过去 6 个月    | 20.53%   | 0.91%       | 9.99%      | 0.86%         | 10.54% | 0.05%  |
| 过去 1 年     | 19.64%   | 0.97%       | 0.80%      | 0.93%         | 18.84% | 0.04%  |
| 自基金合同生效起至今 | 12.70%   | 1.14%       | -8.68%     | 1.18%         | 21.38% | -0.04% |

注：本基金业绩比较基准：MSCI 金龙净总收益指数(MSCI Golden Dragon Net Total Return Index)

根据基金合同的规定：本基金投资范围为大中华地区企业，包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场（如香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场）发行的股票、存托凭证及其他衍生产品等；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于东亚及东盟区域市场，包括韩国、印尼、马来西亚、菲律宾、泰国等证券市场交易的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等；投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金所指的大中华地区企业是企业注册地或企业主营业务收入主要来源地属于中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区区域范畴内。

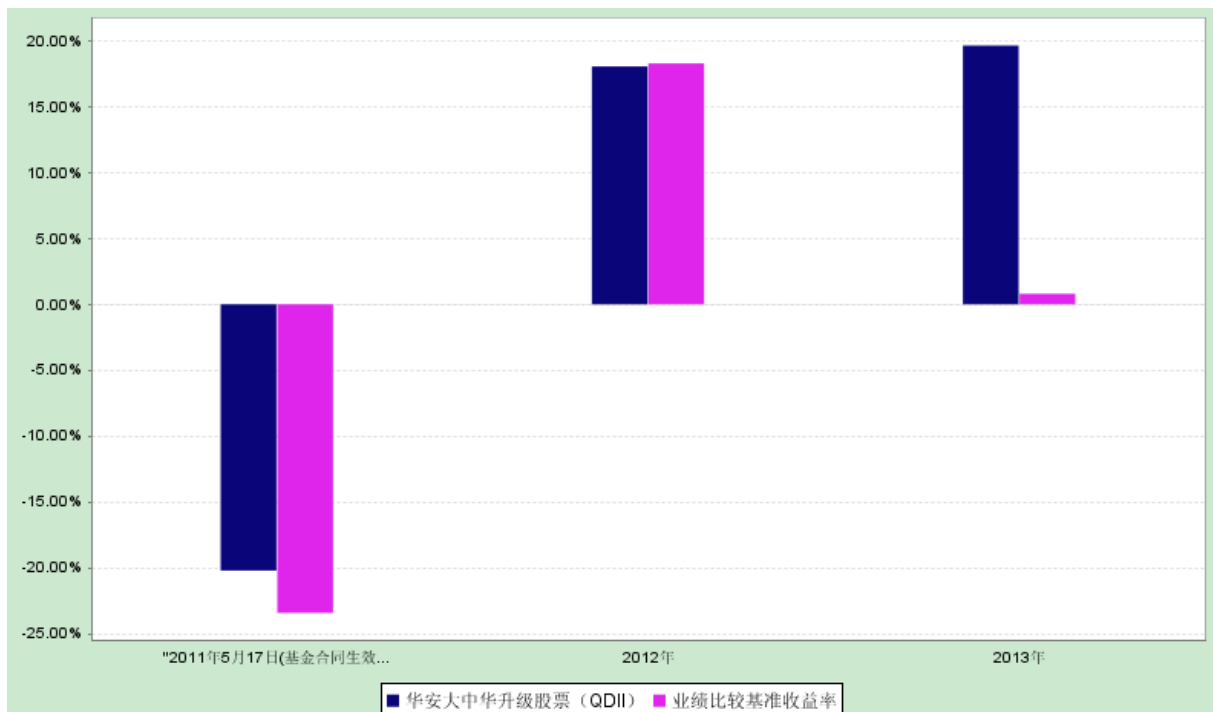
本基金的投资组合比例限制为：股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 85% 的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业，不高于 15% 的股票资产投资于东亚及东盟区域市场；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

#### 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



注：根据《华安大中华升级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十四部分“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



注：本基金于 2011 年 5 月 17 日成立，合同生效当年按实际存续期计算，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

本基金过去三年没有利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 姓名  | 职务                     | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明   |
|-----|------------------------|-----------------|------|--------|--|
|     |                        | 任职日期            | 离任日期 |        |  |
| 翁启森 | 本基金的基金经理，基金投资部兼全球投资部总监 | 2011-05-17      | -    | 17 年   | 工业工程学硕士，17 年证券、基金行业从业经历，具有中国大陆基金从业资格。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，任全球投资部副总经理。2010 年 9 月起担任华安香港精选投票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任本基金的基金经理。2013 年 6 月起担任基金投资部兼全球投资部总监。                             |
| 苏圻涵 | 本基金的基金经理 | 2011-05-17 | - | 9 年 | 博士研究生，9 年证券、基金从业经历，持有基金从业执业证书。2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾先后于研究发展部、战略策划部工作，担任行业研究员和产品经理职务。目前任职于全球投资部，担任基金经理职务。2010 年 9 月起担任华安香港精选投票型证券投资基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任本基金的基金经理。 |

注：1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《大中华升级股票型证券投资基金基金合同》、《大中华升级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品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 3 次。原

因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2013 年 5 月，伴随着 QE4 的到期，市场对于美国经济周期性复苏，美联储退出 QE，货币政策转向的预期，成为主导全球资本市场，尤其是新兴市场的重要因素。我们认为从该时点开始，新兴市场进入危机模式——经济增速放缓，资金外流，风险资产价格重估。2008 年美国经历了私人部门的去杠杆，2011 年欧洲经历了主权债务的去杠杆，目前新兴市场正在经历去除量化宽松时期，廉价资金形成的高杠杆。新兴市场的加息潮，有助于抵御资本外逃，加速去杠杆，但终将付出实体经济增速放缓的代价。

2013 年下半年，全球股票市场表现出现明显分化，发达市场明显跑赢新兴市场，资金流出新兴市场。期内 S&P500 指数累计上涨 13.34%，纳斯达克综合指数累计上涨 20.85%，而 MSCI 新兴市场指数下跌 0.61%。

受到国内“钱荒”，以及宏观经济的持续疲弱，期内香港市场显著跑输发达市场，恒生指数上涨 4.08%，恒生国企指数上涨 2.05%，并呈现出显著的结构行情特征，大市值蓝筹，周期类个股显著走弱，新兴产业大幅走强。行业层面，信息技术业、服务业、综合企业等防御性板块领先，原材料、地产业、电信行业、能源等周期性行业落后。台湾市场走势同样弱于发达市场，期内，台湾加权指数上涨 4.32%。

报告期内，基金超配盈利增长确定，估值合理，受益于中国经济结构转型和消费升级的，信息技术、医药、可选消费、环保，低配银行、地产、电信、能源和原材料板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.127 元，净值增长率为 19.64%，同期比较基准收益率为 0.80%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们认为 2013 年以来港股的结构行情仍将持续，从基本面来看，在经济调结构、挤泡沫、去产能，以及打击腐败的影响下，投资和消费都将不同程度受到负面影响，经济增速放缓已成为共识。从资金面来看，在联储退出 QE，全球流动性状况边际上开始转弱的背景下，资金流出新兴市场（香港）的趋势明显。

我们认为 2014 年香港市场整体系统性机会不大，经济转型的结构机会大于系统性的机会。自下而上，选择估值合理，盈利成长确定性高，受益于经济结构转型的个股，仍是我们的主要策略。基于对于经济周期下行的观点，我们看好需求稳定，能够穿越或者逆周期的行业和个股，如医药、必选消费、彩票等。同时，考虑到社会实际利率的系统性上升，我们更偏向于轻资产、低杠杆的服务类企业，回避重资产、高杠杆行业。对

于环保类企业，我们持续看好。除了直接进行污染治理，三废处理的企业，我们认为环保行业的范畴还应扩展到，改善能源消费结构的新能源行业，提高能源使用效率的节能减排类股。

2014 年发达经济体经济出现周期性复苏的走势，作为外向型经济为主的台湾，必然受益于外需复苏。同时相较于其他新兴市场，受制于次贷危机后地区经济的显著减速，和产业外迁，QE 浪潮中进入台湾的资金并不显著，反应在经济层面，并未出现显著的投资、消费的加杠杆现象，因此在 QE 退出，新兴市场危机中，从金融系统稳定层面，台湾相较于其他新兴市场具有一定的防御性。因此对于台湾市场我们相对乐观，我们看好具有技术优势的消费电子产业链公司，以及在中国大陆具有品牌和渠道优势的中概股。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

##### 3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

###### (1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华安大中华升级股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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 20848 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：华安大中华升级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<br>2013 年 12 月 31 日 | 上年度末<br>2012 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------|--------------------------|
| 资 产：    |                         |                          |
| 银行存款    | 6,366,679.00            | 12,065,596.13            |
| 结算备付金   | -                       | -                        |
| 存出保证金   | -                       | -                        |
| 交易性金融资产 | 55,252,428.39           | 85,279,948.19            |
| 其中：股票投资 | 55,252,428.39           | 85,279,948.19            |
| 基金投资    | -                       | -                        |
| 债券投资    | -                       | -                        |

|                   |                                 |                                  |
|-------------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产支持证券投资          | -                               | -                                |
| 衍生金融资产            | -                               | -                                |
| 买入返售金融资产          | -                               | -                                |
| 应收证券清算款           | -                               | 955,093.08                       |
| 应收利息              | 423.86                          | 277.75                           |
| 应收股利              | -                               | 17,571.83                        |
| 应收申购款             | 59,989.78                       | 40,558.07                        |
| 递延所得税资产           | -                               | -                                |
| 其他资产              | -                               | -                                |
| <b>资产总计</b>       | <b>61,679,521.03</b>            | <b>98,359,045.05</b>             |
| <b>负债和所有者权益</b>   | <b>本期末<br/>2013 年 12 月 31 日</b> | <b>上年度末<br/>2012 年 12 月 31 日</b> |
| 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           | 338,581.59                      | 463,928.88                       |
| 应付赎回款             | 402,077.98                      | 201,329.86                       |
| 应付管理人报酬           | 77,197.35                       | 121,507.74                       |
| 应付托管费             | 15,439.47                       | 24,301.57                        |
| 应付销售服务费           | -                               | -                                |
| 应付交易费用            | -                               | -                                |
| 应交税费              | -                               | -                                |
| 应付利息              | -                               | -                                |
| 应付利润              | -                               | -                                |
| 递延所得税负债           | -                               | -                                |
| 其他负债              | 307,206.37                      | 307,652.07                       |
| <b>负债合计</b>       | <b>1,140,502.76</b>             | <b>1,118,720.12</b>              |
| <b>所有者权益:</b>     |                                 |                                  |
| 实收基金              | 53,735,886.67                   | 103,216,895.19                   |
| 未分配利润             | 6,803,131.60                    | -5,976,570.26                    |
| 所有者权益合计           | 60,539,018.27                   | 97,240,324.93                    |
| <b>负债和所有者权益总计</b> | <b>61,679,521.03</b>            | <b>98,359,045.05</b>             |

注: 报告截止日 2013 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.127 元, 基金份额总额 53,735,886.67 份。

## 7.2 利润表

会计主体: 华安大中华升级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<br>2013 年 12 月 31 日 | 2012 年 1 月 1 日至<br>2012 年 12 月 31 日 |
|----------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                | <b>15,511,082.42</b>                | <b>17,692,905.62</b>                |
| 1.利息收入                     | 11,453.11                           | 7,588.21                            |
| 其中：存款利息收入                  | 11,453.11                           | 7,588.21                            |
| 债券利息收入                     | -                                   | -                                   |
| 资产支持证券利息收入                 | -                                   | -                                   |
| 买入返售金融资产收入                 | -                                   | -                                   |
| 其他利息收入                     | -                                   | -                                   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）           | 13,118,614.11                       | -6,589,051.55                       |
| 其中：股票投资收益                  | 11,743,727.96                       | -8,671,637.31                       |
| 基金投资收益                     | -                                   | -                                   |
| 债券投资收益                     | -                                   | -                                   |
| 资产支持证券投资收益                 | -                                   | -                                   |
| 衍生工具收益                     | 6,280.75                            | 13,205.54                           |
| 股利收益                       | 1,368,605.40                        | 2,069,380.22                        |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）      | 3,127,198.09                        | 23,959,922.99                       |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）          | -760,791.62                         | 301,278.51                          |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）          | 14,608.73                           | 13,167.46                           |
| <b>减：二、费用</b>              | <b>2,159,869.88</b>                 | <b>2,350,879.09</b>                 |
| 1. 管理人报酬                   | 1,168,579.78                        | 1,386,824.89                        |
| 2. 托管费                     | 233,716.01                          | 277,365.02                          |
| 3. 销售服务费                   | -                                   | -                                   |
| 4. 交易费用                    | 421,354.28                          | 349,181.10                          |
| 5. 利息支出                    | -                                   | -                                   |
| 其中：卖出回购金融资产支出              | -                                   | -                                   |
| 6. 其他费用                    | 336,219.81                          | 337,508.08                          |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> | <b>13,351,212.54</b>                | <b>15,342,026.53</b>                |
| 减：所得税费用                    | -                                   | -                                   |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   | <b>13,351,212.54</b>                | <b>15,342,026.53</b>                |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安大中华升级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<br>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 | 103,216,895.19                         | -5,976,570.26 | 97,240,324.93 |



|  |                                  |                |                |
|--|----------------------------------|----------------|----------------|
| (基金净值)                                 |                                  |                |                |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                | 13,351,212.54  | 13,351,212.54  |
| 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)      | -49,481,008.52                   | -571,510.68    | -50,052,519.20 |
| 其中：1.基金申购款                             | 5,940,081.49                     | 99,703.49      | 6,039,784.98   |
| 2.基金赎回款                                | -55,421,090.01                   | -671,214.17    | -56,092,304.18 |
| 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)                        | 53,735,886.67                    | 6,803,131.60   | 60,539,018.27  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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)                        | 113,671,624.72                   | -23,006,952.03 | 90,664,672.69  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                | 15,342,026.53  | 15,342,026.53  |
| 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)      | -10,454,729.53                   | 1,688,355.24   | -8,766,374.29  |
| 其中：1.基金申购款                             | 7,687,010.10                     | -1,020,276.74  | 6,666,733.36   |
| 2.基金赎回款                                | -18,141,739.63                   | 2,708,631.98   | -15,433,107.65 |
| 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)                        | 103,216,895.19                   | -5,976,570.26  | 97,240,324.93  |

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

华安大中华升级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]第 328 号《关于核准华安大中华升级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《华安大中华升级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 434,522,995.91 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 178 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》于 2011 年 5 月 17 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 434,578,142.49 份基金份额,其中认购资金利息折合 55,146.58 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,基金托管人为中国银行股份有限公司,境外资产托管人为中国银行(香港)有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安大中华升级股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资范围为大中华地区企业,包括中国大陆、香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区企业在境外几个主要证券市场(如香港、台湾、新加坡、美国、英国等证券市场)发行的股票、存托凭证及其他衍生产品等;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于东亚及东盟区域市场,包括韩国、印尼、马来西亚、菲律宾、泰国等证券市场交易的普通股、优先股、存托凭证及其他衍生产品等;投资范围亦包括债券、货币市场工具和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为:股票资产不低于基金资产的 60%,其中不低于 85%的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业,不高于 15%的股票资产投资于东亚及东盟区域市场;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%。本基金业绩比较基准为:MSCI 金龙净总收益指数。

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》、《华安大中华升级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。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2013 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2013 年 12 月 31 日的财务状况以及 2013 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内不予征收营业税且暂不征收企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂不征收个人所得税和企业所得税。

### 7.4.7 关联方关系

| 关联方名称                | 与本基金的关系             |
|----------------------|---------------------|
| 华安基金管理有限公司(“华安基金公司”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国银行股份有限公司(“中国银行”)   | 基金托管人、基金代销机构        |
| 中国银行(香港)有限公司(“中银香港”) | 境外资产托管人             |

|                |          |
|----------------|----------|
| 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<br>2013年1月1日至2013年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月<br>31日 |
|-----------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 1,168,579.78                    | 1,386,824.89                         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 387,691.08                      | 494,642.23                           |

注：支付基金管理人 华安基金公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 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 × 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<br>2013年1月1日至2013年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月<br>31日 |
|------------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付 | 233,716.01                      | 277,365.02                           |

|      |  |  |
|------|--|--|
| 的托管费 |  |  |
|------|--|--|

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.3% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.3% / 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**

份额单位：份

| 项目                | 本期<br>2013年1月1日至2013年12月31日 | 上年度可比期间<br>2012年1月1日至2012年12月31日 |
|-------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 期初持有的基金份额         | 14,999,000.00               | 14,999,000.00                    |
| 期间申购/买入总份额        | -                           | -                                |
| 期间因拆分变动份额         | -                           | -                                |
| 减：期间赎回/卖出总份额      | -                           | -                                |
| 期末持有的基金份额         | 14,999,000.00               | 14,999,000.00                    |
| 期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 27.91%                      | 14.53%                           |

**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<br>2013年1月1日至2013年12月31日 |           | 上年度可比期间<br>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   |
| 中国银行  | 1,071,089.85                | 11,449.08 | 1,176,466.80                     | 7,574.84 |
| 中银香港  | 5,295,589.15                | 0.30      | 10,889,129.33                    | -        |

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国银行和境外资产托管人中银香港保管，按适用利率或约定利率计息。

**7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**  
 无。

**7.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

无。

#### **7.4.9 期末（2013 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券**

##### **7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

无。

##### **7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

无。

##### **7.4.9.3 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**

无。

###### **7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

#### **7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### **(1) 公允价值**

###### **(a) 不以公允价值计量的金融工具**

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

###### **(b) 以公允价值计量的金融工具**

###### **(i) 金融工具公允价值计量的方法**

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

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

###### **(ii) 各层级金融工具公允价值**

于 2013 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量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 55,252,428.39 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2012

年 12 月 31 日：第一层级 85,279,948.19 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iv) 第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额            | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 55,252,428.39 | 89.58         |
|    | 其中：普通股            | 55,252,428.39 | 89.58         |
|    | 存托凭证              | -             | -             |
|    | 优先股               | -             | -             |
|    | 房地产信托             | -             | -             |
| 2  | 基金投资              | -             | -             |
| 3  | 固定收益投资            | -             | -             |
|    | 其中：债券             | -             | -             |
|    | 资产支持证券            | -             | -             |
| 4  | 金融衍生品投资           | -             | -             |
|    | 其中：远期             | -             | -             |
|    | 期货                | -             | -             |
|    | 期权                | -             | -             |
|    | 权证                | -             | -             |
| 5  | 买入返售金融资产          | -             | -             |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | -             | -             |
| 6  | 货币市场工具            | -             | -             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 6,366,679.00  | 10.32         |
| 8  | 其他各项资产            | 60,413.64     | 0.10          |
| 9  | 合计                | 61,679,521.03 | 100.00        |



## 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 中国香港   | 39,714,472.43 | 65.60        |
| 中国台湾   | 15,537,955.96 | 25.67        |
| 合计     | 55,252,428.39 | 91.27        |

## 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

| 行业类别   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|---------------|--------------|
| 非必需消费品 | 5,692,943.23  | 9.40         |
| 必需消费品  | 3,654,445.84  | 6.04         |
| 能源     | 4,436,186.42  | 7.33         |
| 金融     | 10,159,532.83 | 16.78        |
| 保健     | 4,002,174.10  | 6.61         |
| 工业     | 3,547,422.59  | 5.86         |
| 信息技术   | 16,487,481.13 | 27.23        |
| 材料     | 1,311,038.53  | 2.17         |
| 公用事业   | 5,961,203.72  | 9.85         |
| 合计     | 55,252,428.39 | 91.27        |

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

## 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）                       | 公司名称（中文）   | 证券代码    | 所在证券市场 | 所属国家（地区） | 数量（股）     | 公允价值         | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------------------------------|------------|---------|--------|----------|-----------|--------------|--------------|
| 1  | Largan Precision Co.,Ltd.      | 大立光电股份有限公司 | 3008 TT | 台湾     | 中国台湾     | 14,000    | 3,479,308.72 | 5.75         |
| 2  | Ct Environmental Group Limited | 中滔环保集团有限公司 | 1363 HK | 香港     | 中国香港     | 1,084,000 | 3,306,820.48 | 5.46         |
| 3  | Tencent Holdings Limited       | 腾讯控股有限公司   | 700 HK  | 香港     | 中国香港     | 7,400     | 2,877,633.25 | 4.75         |
| 4  | Media Tek Inc.                 | 联发科技股份有限公司 | 2454 TT | 台湾     | 中国台湾     | 24,000    | 2,177,175.90 | 3.60         |
| 5  | CATCHER TECHNOLOGY CO.,LTD.    | 可成科技股份有限公司 | 2474 TT | 台湾     | 中国台湾     | 48,000    | 1,899,813.01 | 3.14         |

|    |   |                  |         |    |      |         |              |      |
|----|---|------------------|---------|----|------|---------|--------------|------|
| 6  | China Singyes Solar Technologies Holdings Limited | 中国兴业太阳能技术控股有限公司  | 750 HK  | 香港 | 中国香港 | 288,000 | 1,766,187.07 | 2.92 |
| 7  | Beijing Jingneng Clean Energy Co., Limited        | 北京京能清洁能源电力股份有限公司 | 579 HK  | 香港 | 中国香港 | 446,000 | 1,427,180.42 | 2.36 |
| 8  | Fubon Financial Holding Co., Ltd                  | 富邦金融控股公司         | 2881 TT | 台湾 | 中国台湾 | 160,000 | 1,426,905.21 | 2.36 |
| 9  | Hilong Holding Limited                            | 海隆控股有限公司         | 1623 HK | 香港 | 中国香港 | 272,000 | 1,419,994.28 | 2.35 |
| 10 | China Cinda Asset Management Corporation          | 中国信达资产管理股份有限公司   | 1359 HK | 香港 | 中国香港 | 365,000 | 1,388,953.92 | 2.29 |

注：1. 所用证券代码采用彭博代码。

2. 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。

## 8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）  | 证券代码    | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|---|---------|--------------|----------------|
| 1  | Tianjin Development Holdings Limited              | 882 HK  | 2,892,755.69 | 2.97           |
| 2  | EGALAX_EMPIA Technology Inc.                      | 3556 TT | 2,509,509.74 | 2.58           |
| 3  | Industrial And Commercial Bank Of China Limited   | 1398 HK | 2,465,548.90 | 2.54           |
| 4  | China Singyes Solar Technologies Holdings Limited | 750 HK  | 2,375,258.49 | 2.44           |
| 5  | Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.  | 2318 HK | 2,309,613.14 | 2.38           |
| 6  | Largan Precision Co.,Ltd.                         | 3008 TT | 2,239,105.87 | 2.30           |
| 7  | China Pacific Insurance(group) Co., Ltd.          | 2601 HK | 2,040,409.74 | 2.10           |
| 8  | Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co.,Ltd.    | 2196 HK | 1,823,387.71 | 1.88           |
| 9  | Citic Securities Company Limited                  | 6030 HK | 1,717,588.87 | 1.77           |
| 10 | Cheng Shin Rubber Industry Co., Ltd               | 2105 TT | 1,699,331.28 | 1.75           |
| 11 | Ct Environmental Group Limited                    | 1363 HK | 1,656,861.22 | 1.70           |
| 12 | Fubon Financial Holding Co., Ltd                  | 2881 TT | 1,636,761.43 | 1.68           |
| 13 | Hisense Kelon Electrical Holdings Co.,ltd.        | 921 HK  | 1,635,492.84 | 1.68           |
| 14 | Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd.         | 460 HK  | 1,489,315.27 | 1.53           |
| 15 | Mega Financial Holding Co., Ltd                   | 2886 TT | 1,456,896.07 | 1.50           |
| 16 | Biostime International Holdings Limited           | 1112 HK | 1,380,933.55 | 1.42           |
| 17 | China Cinda Asset Management Corporation          | 1359 HK | 1,311,640.57 | 1.35           |
| 18 | China Mengniu Dairy Company Limited               | 2319 HK | 1,297,083.04 | 1.33           |

|    |                        |         |              |      |
|----|------------------------|---------|--------------|------|
| 19 | Hilong Holding Limited | 1623 HK | 1,261,164.07 | 1.30 |
| 20 | CNOOC Limited          | 883 HK  | 1,245,417.34 | 1.28 |

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 公司名称（英文）   | 证券代码    | 本期累计卖出金额     | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--|---------|--------------|----------------|
| 1  | Sino Biopharmaceutical Limited                   | 1177 HK | 5,459,000.01 | 5.61           |
| 2  | Capella Microsystems (Taiwan) Inc.               | 3582 TT | 4,141,314.47 | 4.26           |
| 3  | CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED           | 257 HK  | 3,990,489.85 | 4.10           |
| 4  | TPK Holding Co Ltd                               | 3673 TT | 3,603,855.54 | 3.71           |
| 5  | Hisense Kelon Electrical Holdings Co.,ltd.       | 921 HK  | 2,954,318.48 | 3.04           |
| 6  | Wei chuan food corp                              | 1201 TT | 2,802,537.17 | 2.88           |
| 7  | Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.            | 322 HK  | 2,702,621.39 | 2.78           |
| 8  | Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd. | 2318 HK | 2,593,836.02 | 2.67           |
| 9  | China Life Insurance Company Limited             | 2628 HK | 2,559,999.15 | 2.63           |
| 10 | China Petroleum & Chemical Corporation           | 386 HK  | 2,452,265.29 | 2.52           |
| 11 | Media Tek Inc.                                   | 2454 TT | 2,447,599.81 | 2.52           |
| 12 | Mega Financial Holding Co., Ltd                  | 2886 TT | 2,340,634.54 | 2.41           |
| 13 | Sinopharm Group Co., Ltd.                        | 1099 HK | 2,326,321.18 | 2.39           |
| 14 | Shenzhou International Group Holdings Ltd.       | 2313 HK | 2,224,338.12 | 2.29           |
| 15 | Industrial And Commercial Bank Of China Limited  | 1398 HK | 2,218,079.27 | 2.28           |
| 16 | CNOOC Limited                                    | 883 HK  | 2,193,473.63 | 2.26           |
| 17 | E.Sun Financial Holding Company Ltd.             | 2884 TT | 2,152,940.61 | 2.21           |
| 18 | Cheng Shin Rubber Industry Co., Ltd              | 2105 TT | 2,042,015.75 | 2.10           |
| 19 | Tianneng Power International Limited             | 819 HK  | 1,935,256.62 | 1.99           |
| 20 | Sunny Optical Technology (Group) Company Limited | 2382 HK | 1,929,704.31 | 1.98           |

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

|            |                |
|------------|----------------|
| 买入成本（成交）总额 | 79,544,755.22  |
| 卖出收入（成交）总额 | 124,443,201.07 |

### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

### 8.11 投资组合报告附注

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

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

#### 8.11.3 其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额        |
|----|---------|-----------|
| 1  | 存出保证金   | -         |
| 2  | 应收证券清算款 | -         |
| 3  | 应收股利    | -         |
| 4  | 应收利息    | 423.86    |
| 5  | 应收申购款   | 59,989.78 |
| 6  | 其他应收款   | -         |
| 7  | 待摊费用    | -         |
| 8  | 其他      | -         |
| 9  | 合计      | 60,413.64 |

#### 8.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券明细。

#### 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 |
| 1,449     | 37,084.81 | 14,999,000.00 | 27.91% | 38,736,886.67 | 72.09% |

### 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 | 1,406,268.14 | 2.62%    |

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本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 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2011 年 5 月 17 日)基金份额总额 | 434,578,142.49 |
| 本报告期期初基金份额总额                   | 103,216,895.19 |
| 本报告期基金总申购份额                    | 5,940,081.49   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                  | 55,421,090.01  |
| 本报告期基金拆分变动份额                   | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                   | 53,735,886.67  |

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

无。

2、本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：

2013 年 3 月 17 日中国银行股份有限公司公告，肖钢先生辞去中国银行股份有限公司董事长职务。

2013 年 6 月 1 日中国银行股份有限公司公告，自 2013 年 5 月 31 日起，田国立先生就任本行董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 67,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 |    |
| Deutsche Securities Asia Limited                 | -      | 41,095,425.70 | 19.79%       | 20,547.79 | 11.98%     | -  |
| Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated | -      | 40,954,750.71 | 19.72%       | 27,875.93 | 16.25%     | -  |
| Credit Suisse(Hong Kong) Limited                 | -      | 37,566,280.64 | 18.09%       | 18,783.18 | 10.95%     | -  |
| Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company   | -      | 35,811,356.31 | 17.25%       | 22,949.37 | 13.38%     | -  |
| Morgan Stanley & Co.                             | -      | 29,326,751.88 | 14.12%       | 48,896.93 | 28.51%     | -  |

|   |   |               |       |           |        |   |
|---|---|---------------|-------|-----------|--------|---|
| International PLC                                     |   |               |       |           |        |   |
| MasterLink Securities Corp                            | - | 15,084,892.87 | 7.27% | 21,111.68 | 12.31% | - |
| Cathay Securities Corporation                         | - | 3,984,528.88  | 1.92% | 5,976.67  | 3.49%  | - |
| SinoPac Securities Corp.                              | - | 3,812,489.74  | 1.84% | 5,353.72  | 3.12%  | - |
| Nomura International Plc.                             | - | -             | -     | -         | -      | - |
| CCB International Securities Limited                  | - | -             | -     | -         | -      | - |
| Yuanta Securities Company Limited.                    | - | -             | -     | -         | -      | - |
| UBS Securities Asia Limited                           | - | -             | -     | -         | -      | - |
| China International Capital Corporation (HKS) Ltd     | - | -             | -     | -         | -      | - |
| CLSA Limited  | - | -             | -     | -         | -      | - |
| CMB International Securities Limited                  | - | -             | -     | -         | -      | - |
| Guotai Junan Securities(Hong Kong) Limited            | - | -             | -     | -         | -      | - |
| The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited | - | -             | -     | -         | -      | - |
| Mizuho Securities Asia Limited                        | - | -             | -     | -         | -      | - |
| BNP Paribas   | - | -             | -     | -         | -      | - |



|  |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|
| Securities (Asia) Ltd                    |   |   |   |   |   |   |
| UOB KayHian HK Ltd                       | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Asia Limited.           | - | - | - | - | - | - |
| BMO Nesbitt Burns Inc.                   | - | - | - | - | - | - |
| China Everbright Secutities(HK) Limited. | - | - | - | - | - | - |
| BOCI Securities Ltd.                     | - | - | - | - | - | - |
| Shenyin Wanguo Securities(HK) Ltd.       | - | - | - | - | - | - |

注：1、券商专用交易单元选择标准：

选择能够提供高质量的研究服务、交易服务和清算支持，具有良好声誉和财务状况的国内外经纪商。具体标准如下：

- (1) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；
- (2) 具备高效、安全的通讯条件；可靠、诚信，能够公平对待所有客户，有效执行投资指令，取得较高质量的交易成交结果，交易差错少，并能满足基金运作高度保密的要求；
- (3) 交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；
- (4) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；
- (5) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

- (1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估  
由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。
- (2) 填写《新增交易单元申请审核表》  
牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的的必要性和合规性进行阐述。
- (3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批  
公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。
- (4) 协议签署及通知托管人  
基金管理人 与 被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称  | 债券交易 |              | 回购交易 |              | 权证交易 |              | 基金交易 |              |
|---|------|--------------|------|--------------|------|--------------|------|--------------|
|   | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期基金成交总额的比例 |
| Deutsche Securities Asia Limited                  | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated  | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Credit Suisse(Hong Kong) Limited                  | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company    | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Morgan Stanley & Co. International PLC            | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| MasterLink Securities Corp                        | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Cathay Securities Corporation                     | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| SinoPac Securities Corp.                          | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Nomura International Plc.                         | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| CCB International Securities Limited              | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Yuanta Securities Company Limited.                | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| UBS Securities Asia Limited                       | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| China International Capital Corporation (HKS) Ltd | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| CLSA Limited                                      | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| CMB International Securities Limited              | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| Guotai Junan Securities(Hong Kong) Limited        | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |
| The Hongkong and Shanghai Banking                 | -    | -            | -    | -            | -    | -            | -    | -            |

|  |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
|--|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Corporation Limited                      |   |   |   |   |   |   |   |   |   |
| Mizuho Securities Asia Limited           | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BNP Paribas Securities (Asia) Ltd        | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| UOB KayHian HK Ltd                       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Barclays Capital Asia Limited.           | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BMO Nesbitt Burns Inc.                   | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| China Everbright Securities(HK) Limited. | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BOCI Securities Ltd.                     | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| Shenyin Wanguo Securities(HK) Ltd.       | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

华安基金管理有限公司  
 二〇一四年三月三十一日