

华安大中华升级股票型证券投资基金

2013 年年度报告

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。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 管理层对财务报表的责任	16
6.2 注册会计师的责任	17
6.3 审计意见	17
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	40
8.1 期末基金资产组合情况	40
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	41
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	41
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	42
8.5 报告期内股票投资组合的重大变动	46
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	48
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	48

8.8	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	48
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	48
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	48
8.11	投资组合报告附注	48
§9	基金份额持有人信息	49
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
§10	开放式基金份额变动	49
§11	重大事件揭示	49
11.1	基金份额持有人大会决议	49
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	50
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4	基金投资策略的改变	50
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
11.8	其他重大事件	54
§13	备查文件目录	58
13.1	备查文件目录	58
13.2	存放地点	58
13.3	查阅方式	58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安大中华升级股票型证券投资基金
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
注册地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31 层、32 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		李勃	田国立

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

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、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
本期加权平均净值利润率	17.25%	16.61%	-14.18%
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
期末可供分配利润	210,127.24	-13,094,897.57	-23,006,952.03
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
3.1.3 累计期末指标	2013 年末	2012 年末	2011 年末
基金份额累计净值增长率	12.70%	-5.80%	-20.20%

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。

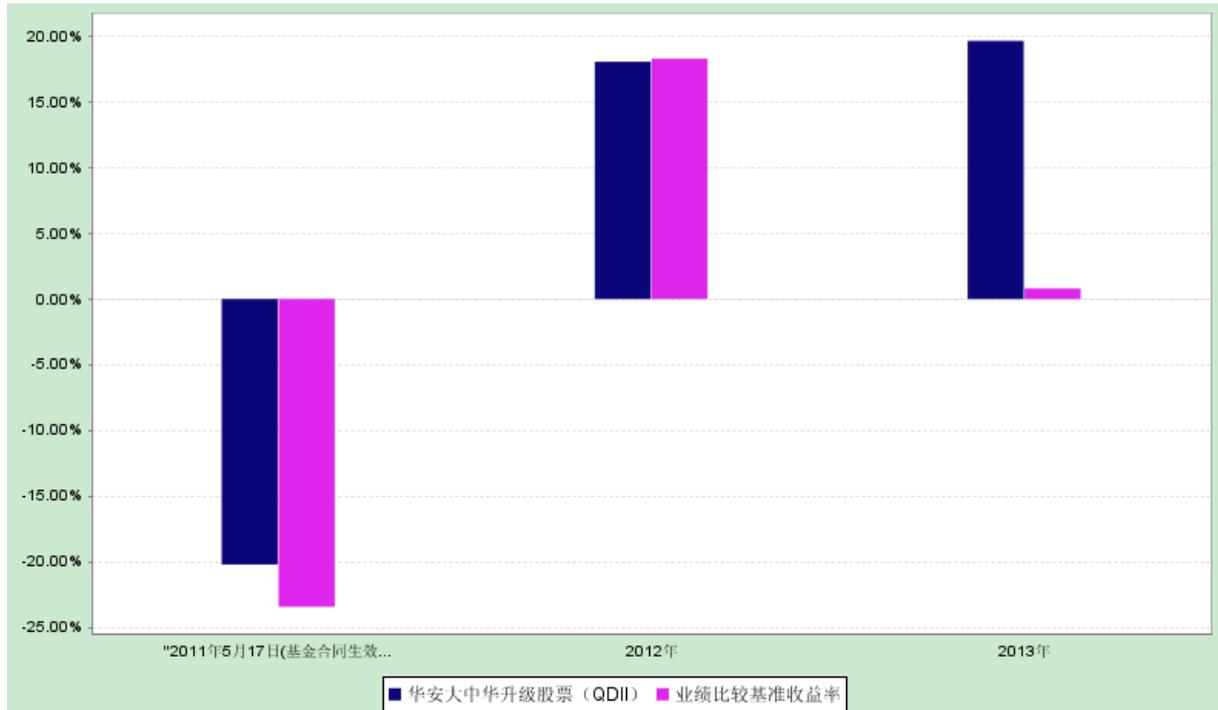
本基金的投资组合比例限制为：股票资产不低于基金资产的 60%，其中不低于 85% 的股票资产投资于在香港、台湾、新加坡、美国、英国证券市场交易的大中华地区企业，不高于 15% 的股票资产投资于东亚及东盟区域市场；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

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市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同

投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

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性的行情特征，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 年以来港股的结构性行情仍将持续，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，经济转型的结构性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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察稽核部从维护基金份额持有人利益、保障基金的合规运作出发，重点在法律事务、合规管理、内部稽核、信息披露、反洗钱、员工行为规范等方面开展工作，从维护基金持有的利益、保障基金的合规运作出发，深化员工的合规意识，推动公司的合规文化和内部风险控制机制的完善与优化。

监察稽核工作重点集中于以下几个方面：

(1) 结合《证券投资基金法》的实施，推动相关制度流程的建立、修订和完善，适应公司产品与业务创新发展的需要。

(2) 深化“主动合规”的管理理念，坚守“三条底线”，强化全体员工的合规意

识和风险控制意识，通过定期组织员工进行职业道德规范、反洗钱、防范利益冲突、客户信息保密、销售适用性等方面的合规培训和内部审计，推动公司建立良好的内控环境和合规文化。

(3) 做好在新基金产品开发、新投资品种、及其他创新业务中法律、合规及风险控制方面的支持，坚持定期对投资、研究、交易、核算、销售等相关业务活动的日常合规性检查。

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

(5) 按照法规的要求，做好旗下各只基金的信息披露工作，做到信息披露的真实、完整、准确、及时。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

尚志民，首席投资官，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，

华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司副总裁、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。

4.8 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

普华永道中天审字(2014)第 20848 号

华安大中华升级股票型证券投资基金 全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安大中华升级股票型证券投资基金(以下简称“华安大中华升级基金”)的财务报表，包括 2013 年 12 月 31 日的资产负债表、2013 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是 华安大中华升级基金 的基金管理人 华安基金管理有 限公司 管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

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

6.2 注册会计师的责任

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

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

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述 华安大中华升级基金 的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了 华安大中华升级基金 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。

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) 注册会计师 汪棣 傅琛慧
上海市浦东新区
陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼
2014-03-25

§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	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
-----	-----	-------------------------	--------------------------

资产:			
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	955,093.08
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-
资产总计		61,679,521.03	98,359,045.05
负债和所有者权益	附注号	本期末 2013 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
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	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	307,206.37	307,652.07
负债合计		1,140,502.76	1,118,720.12
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	53,735,886.67	103,216,895.19
未分配利润	7.4.7.10	6,803,131.60	-5,976,570.26
所有者权益合计		60,539,018.27	97,240,324.93
负债和所有者权益总计		61,679,521.03	98,359,045.05

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	附注号	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
一、收入		15,511,082.42	17,692,905.62
1.利息收入		11,453.11	7,588.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	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	7.4.7.12	11,743,727.96	-8,671,637.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	6,280.75	13,205.54
股利收益	7.4.7.15	1,368,605.40	2,069,380.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	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）	7.4.7.17	14,608.73	13,167.46
减：二、费用		2,159,869.88	2,350,879.09
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	7.4.7.18	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	7.4.7.19	336,219.81	337,508.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,351,212.54	15,342,026.53
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,351,212.54	15,342,026.53

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 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）	103,216,895.19	-5,976,570.26	97,240,324.93
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 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	103,216,895.19	-5,976,570.26	97,240,324.93

(基金净值)			
--------	--	--	--

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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易

的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
活期存款	6,366,679.00	12,065,596.13
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	6,366,679.00	12,065,596.13

注：于 2013 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 1,068,593.81 元，美元活期存款 500.26 元(折合人民币 3,050.03 元)、港币活期存款 4,589,079.76 元(折合人民币 3,608,072.18 元)和新台币活期存款 8,247,397.00 元(折合人民币 1,686,962.98 元)。

于 2012 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 1,176,058.96 元，美元活期存款 16.71 元(折合人民币 105.03 元)、港币活期存款 8,766,443.86 元(折合人民币 7,108,271.01 元)和新台币活期存款 17,465,128.00 元(折合人民币 3,781,161.13 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2013 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		45,717,007.29	55,252,428.39	9,535,421.10
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	债券合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		45,717,007.29	55,252,428.39	9,535,421.10
项目		上年度末 2012 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		78,871,725.18	85,279,948.19	6,408,223.01
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	债券合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		78,871,725.18	85,279,948.19	6,408,223.01

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	423.86	277.75
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利	-	-

息		
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	423.86	277.75

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	206.37	652.07
预提费用	307,000.00	307,000.00
合计	307,206.37	307,652.07

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	103,216,895.19	103,216,895.19
本期申购	5,940,081.49	5,940,081.49
本期赎回（以“-”号填列）	-55,421,090.01	-55,421,090.01
本期末	53,735,886.67	53,735,886.67

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-13,094,897.57	7,118,327.31	-5,976,570.26
本期利润	10,224,014.45	3,127,198.09	13,351,212.54
本期基金份额交易产生的变动数	3,081,010.36	-3,652,521.04	-571,510.68
其中：基金申购款	-346,403.75	446,107.24	99,703.49
基金赎回款	3,427,414.11	-4,098,628.28	-671,214.17

本期已分配利润	-	-	-
本期末	210,127.24	6,593,004.36	6,803,131.60

7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	11,449.38	7,574.84
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	-
其他	3.73	13.37
合计	11,453.11	7,588.21

7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	124,443,201.07	94,843,213.90
减：卖出股票成本总额	112,699,473.11	103,514,851.21
买卖股票差价收入	11,743,727.96	-8,671,637.31

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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
卖出权证成交总额	6,280.75	13,205.54
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	6,280.75	13,205.54

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	1,368,605.40	2,069,380.22
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,368,605.40	2,069,380.22

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1.交易性金融资产	3,127,198.09	23,959,922.99
——股票投资	3,127,198.09	23,959,922.99
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
合计	3,127,198.09	23,959,922.99

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	14,608.73	13,167.46
其他收入	-	-
合计	14,608.73	13,167.46

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	421,354.28	349,181.10
银行间市场交易费用	-	-
合计	421,354.28	349,181.10

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	67,000.00	67,000.00
信息披露费	240,000.00	240,000.00
其他	26,249.33	28,194.38
银行汇划费	2,970.48	2,313.70
合计	336,219.81	337,508.08

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	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。

7.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	233,716.01	277,365.02

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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
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%

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

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 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	
	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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
 无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明
 无。

7.4.11 利润分配情况
 无。

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

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券
 无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票
 无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购
 无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为区域性股票型证券投资基金，基金投资风险收益水平高于债券型基金和平衡型基金。由于投资国家与地区市场的分散，风险低于投资单一市场的股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行 中国银行以及境外次托管行中银香港，与该等银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2012 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

于 2013 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2013 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,366,679.00	-	-	-	6,366,679.00
交易性金融资产	-	-	-	55,252,428.39	55,252,428.39
应收利息	-	-	-	423.86	423.86
应收申购款	-	-	-	59,989.78	59,989.78
资产总计	6,366,679.00	-	-	55,312,842.03	61,679,521.03
负债					
应付证券清算款	-	-	-	338,581.59	338,581.59
应付赎回款	-	-	-	402,077.98	402,077.98
应付管理人报酬	-	-	-	77,197.35	77,197.35
应付托管费	-	-	-	15,439.47	15,439.47
其他负债	-	-	-	307,206.37	307,206.37
负债总计	-	-	-	1,140,502.76	1,140,502.76
利率敏感度缺口	6,366,679.00	-	-	54,172,339.27	60,539,018.27
上年度末2012年12月 31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,065,596.13	-	-	-	12,065,596.13
交易性金融资产	-	-	-	85,279,948.19	85,279,948.19
应收股利	-	-	-	17,571.83	17,571.83
应收证券清算款	-	-	-	955,093.08	955,093.08

应收利息	-	-	-	277.75	277.75
应收申购款	20,129.23	-	-	20,428.84	40,558.07
资产总计	12,085,725.36	-	-	86,273,319.69	98,359,045.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	463,928.88	463,928.88
应付赎回款	-	-	-	201,329.86	201,329.86
应付管理人报酬	-	-	-	121,507.74	121,507.74
应付托管费	-	-	-	24,301.57	24,301.57
其他负债	-	-	-	307,652.07	307,652.07
负债总计	-	-	-	1,118,720.12	1,118,720.12
利率敏感度缺口	12,085,725.36	-	-	85,154,599.57	97,240,324.93

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2013 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
银行存款	3,050.03	3,608,072.18	1,686,962.98	5,298,085.19
交易性金融资产	-	39,714,472.43	15,537,955.96	55,252,428.39
应收利息	-	0.33	-	0.33
资产合计	3,050.03	43,322,544.94	17,224,918.94	60,550,513.91
应付证券清算款	-	338,581.59	-	338,581.59
负债合计	-	338,581.59	-	338,581.59
资产负债表外汇	3,050.03	42,983,963.35	17,224,918.94	60,211,932.32

风险敞口净额				
项目	上年度末 2012年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
银行存款	105.03	7,108,271.01	3,781,161.13	10,889,537.17
交易性金融资产	-	61,782,339.12	23,497,609.07	85,279,948.19
应收股利	-	17,571.83	-	17,571.83
应收证券清算款	-	-	955,093.08	955,093.08
资产合计	105.03	68,908,181.96	28,233,863.28	97,142,150.27
应付证券清算款	-	463,928.88	-	463,928.88
负债合计	-	463,928.88	-	463,928.88
资产负债表外汇 风险敞口净额	105.03	68,444,253.08	28,233,863.28	96,678,221.39

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	增加约301.00万元	增加约483.00万元
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约301.00万元	减少约483.00万元

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”和“自下而上”相结合的选股策略。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；通过对单个证券的定性分析及定量分析，对上市公司进行筛选，并通过估值模型精选出投入产出效率得到提升和经营效率得到提高的优势企业进行重点投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013 年 12 月 31 日		上年度末 2012 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	55,252,428.39	91.27	85,279,948.19	87.70
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	55,252,428.39	91.27	85,279,948.19	87.70

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2013 年 12 月 31 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降 5%	减少约 280.00 万元	减少约 412.00 万元
	业绩比较基准上升 5%	增加约 280.00 万元	增加约 412.00 万元

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

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

(b) 以公允价值计量的金融工具

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

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

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

(ii) 各层级金融工具公允价值

于 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所有权益投资明细

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
11	Anhui Conch Cement Company Limited	安徽海螺水泥股份有限公司	914 HK	香港	中国香港	58,000	1,311,038.53	2.17
12	Goodbaby International Holdings Limited	好孩子国际控股有限公司	1086 HK	香港	中国香港	372,000	1,257,653.51	2.08
13	Shanghai Fosun Pharmaceutical (Group) Co.,Ltd.	上海复星医药(集团)股份有限公司	2196 HK	香港	中国香港	66,500	1,220,838.29	2.02
14	EGALAX_EMPIA Technology Inc.	禾瑞亚科技股份有限公司	3556 TT	台湾	中国台湾	64,540	1,214,522.15	2.01
15	Sinopec Kantons	中石化冠德控	934 HK	香港	中国香港	176,000	1,192,805.26	1.97

	Holdings Limited	股有限公司						
16	China Pacific Insurance(group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	香港	中国香港	47,400	1,132,925.98	1.87
17	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港	中国香港	214,400	1,067,033.62	1.76
18	Tianjin Development Holdings Limited	天津发展控股有限公司	882 HK	香港	中国香港	214,000	991,011.47	1.64
19	Techtronic Industries Co. Ltd.	创科实业有限公司	669 HK	香港	中国香港	56,500	977,283.89	1.61
20	Shandong Weigao Group Medical Polymer Company Limited	山东威高集团医用高分子制品股份有限公司	1066 HK	香港	中国香港	116,000	953,980.03	1.58
21	WOWPRIME CORP	王品餐饮股份有限公司	2727 TT	台湾	中国台湾	9,400	951,747.41	1.57
22	Tenwow International Holdings Limited	天喔国际控股有限公司	1219 HK	香港	中国香港	333,000	932,059.94	1.54
23	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	香港	中国香港	29,600	905,296.67	1.50
24	China Longyuan Power Group Corporation Limited	龙源电力集团股份有限公司	916 HK	香港	中国香港	113,000	887,551.46	1.47
25	GCL-Poly Energy Holdings Ltd.	保利协鑫能源控股有限公司	3800 HK	香港	中国香港	470,000	886,867.44	1.46
26	WING HANG BANK,Limited	永亨银行有限公司	302 HK	香港	中国香港	9,000	827,900.19	1.37
27	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险(集团)股份有限公司	2318 HK	香港	中国香港	15,000	819,055.10	1.35
28	China Oilfield Services Limited	中海油田服务股份有限公司	2883 HK	香港	中国香港	40,000	756,353.26	1.25
29	EMEMORY TECHNOLOGY INC	力旺电子股份有限公司	3529 TT	台湾	中国台湾	45,000	727,157.11	1.20
30	Biostime International Holdings Limited	合生元国际控股有限公司	1112 HK	香港	中国香港	13,000	706,781.46	1.17
31	EPISTAR COPR	晶元光电股份有限公司	2448 TT	台湾	中国台湾	57,000	669,230.00	1.11

32	BYD Electronic (International) Co.,Ltd.	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	香港	中国香港	188,500	668,401.64	1.10
33	Aac Technologies Holdings Inc.	瑞声科技控股有限公司	2018 HK	香港	中国香港	22,500	666,035.09	1.10
34	Capella Microsystems (Taiwan) Inc.	凌耀科技股份有限公司	3582 TT	台湾	中国台湾	28,304	665,785.46	1.10
35	China Overseas Land And Investment Ltd.	中国海外发展有限公司	688 HK	香港	中国香港	36,000	617,033.30	1.02
36	China Mengniu Dairy Company Limited	中国蒙牛乳业公司	2319 HK	香港	中国香港	21,000	607,598.54	1.00
37	Citic Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	6030 HK	香港	中国香港	36,500	606,949.90	1.00
38	Baoxin Auto Group Limited	宝信汽车集团有限公司	1293 HK	香港	中国香港	102,000	603,871.81	1.00
39	ACTRON TECHNOLOGY CORP	朋程科技股份有限公司	8255 TT	台湾	中国台湾	26,000	587,657.49	0.97
40	Yashili International Holdings Ltd	雅士利国际控股有限公司	1230 HK	香港	中国香港	155,000	578,861.84	0.96
41	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd.	四环医药控股集团有限公司	460 HK	香港	中国香港	96,000	534,384.81	0.88
42	Mega Financial Holding Co., Ltd	兆丰金融控股股份有限公司	2886 TT	台湾	中国台湾	103,129	529,472.22	0.87
43	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港	中国香港	108,000	522,213.97	0.86
44	E.Sun Financial Holding Company Ltd.	玉山金融控股股份有限公司	2884 TT	台湾	中国台湾	115,685	468,522.98	0.77
45	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	香港	中国香港	19,000	434,706.57	0.72
46	Rexlot Holdings Limited	御泰中彩控股有限公司	555 HK	香港	中国香港	525,000	433,409.29	0.72
47	China Traditional Chinese Medicine	中国中药有限公司	570 HK	香港	中国香港	172,000	420,570.15	0.69

	Co.Limited							
48	Sunac China Holdings Limited	融创中国控股有限公司	1918 HK	香港	中国香港	102,000	372,908.89	0.62
49	China Resources Gas Group Limited	华润燃气控股有限公司	1193 HK	香港	中国香港	16,000	339,651.36	0.56
50	Want Want China Holdings Limited	中国旺旺控股有限公司	151 HK	香港	中国香港	37,000	325,813.71	0.54
51	China Modern Dairy Holdings Ltd.	中国现代牧业控股有限公司	1117 HK	香港	中国香港	94,000	310,403.60	0.51
52	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港	中国香港	74,000	304,868.54	0.50
53	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	香港	中国香港	20,000	302,226.81	0.50
54	Dawnrays Pharmaceutical (Holdings) Ltd.	东瑞制药(控股)有限公司	2348 HK	香港	中国香港	68,000	263,575.75	0.44
55	China Minsheng Banking Corp.,Ltd.	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	香港	中国香港	36,000	243,699.85	0.40
56	CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	中国光大国际有限公司	257 HK	香港	中国香港	29,000	236,670.95	0.39
57	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港	中国香港	39,000	231,198.79	0.38
58	China Machinery Engineering Corporation	中国机械设备工程股份有限公司	1829 HK	香港	中国香港	46,000	226,764.46	0.37
59	Cheng Shin Rubber Industry Co., Ltd	正新橡胶工业股份有限公司	2105 TT	台湾	中国台湾	14,001	223,378.98	0.37
60	PCHOME ONLINE INC	网路家庭国际资讯股份有限公司	8044 TT	台湾	中国台湾	4,000	195,544.92	0.32
61	Wei chuan food corp	味全食品工业股份有限公司	1201 TT	台湾	中国台湾	18,000	192,926.75	0.32
62	CSR Corporation Limited	中国南车股份有限公司	1766 HK	香港	中国香港	36,000	180,015.22	0.30
63	Intime Retail	银泰商业(集	1833 HK	香港	中国香港	25,000	158,621.90	0.26

	(group) Company Limited	团)有限公司						
64	Guangshen Railway Company Limited	广深铁路股份有限公司	525 HK	香港	中国香港	52,000	146,773.42	0.24
65	Country Garden Holdings Co. Ltd.	碧桂园控股有限公司	2007 HK	香港	中国香港	39,420	145,048.11	0.24
66	TPK Holding Co Ltd	宸鸿光电科技股份有限公司	3673 TT	台湾	中国台湾	3,578	128,807.65	0.21
67	Cspc Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	香港	中国香港	18,000	86,611.10	0.14
68	Far East Horizon Limited	远东宏信有限公司	3360 HK	香港	中国香港	13,000	67,765.16	0.11
69	Hisense Kelon Electrical Holdings Co.,ltd.	海信科龙电器股份有限公司	921 HK	香港	中国香港	7,000	64,612.38	0.11

注：所用证券代码采用彭博代码。

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。

8.9 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	-	35,811,356.31	17.25%	22,949.37	13.38%	-

Company						
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	29,326,751.88	14.12%	48,896.93	28.51%	-
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 Securities(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.	-	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于电子直销平台开通“赎回转申购”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-01-18
2	关于旗下部分开放式基金面向养老金客户实施特定申购费率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-01-24
3	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-05
4	关于旗下部分基金增加好买基金为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-22
5	关于旗下部分基金增加天天基金为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-25
6	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-25
7	关于旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-26
8	关于旗下部分基金参加上海好买基金销售有限公司申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-02-27
9	关于旗下部分基金增加数米基金为代销机构	《上海证券报》、《证券时报》、	2013-03-14

	并参加费率优惠活动的公告	《中国证券报》和公司网站	
10	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-03-26
11	关于华安旗下部分基金参加工商银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-03-28
12	关于电子直销平台开通“货币通：余额理财”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-03-28
13	关于电子直销平台开通“货币通：快速取现”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-04-10
14	关于华安旗下部分基金参加好买基金定期定额业务及参加基金定投申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-04-11
15	关于旗下基金增加上海长量基金为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-04-12
16	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-04
17	关于电子直销平台“货币通：快速取现”业务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-13
18	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-14
19	关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-18
20	华安基金管理有限公司关于放开港澳台居民开立证券投资基金账户的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-18
21	关于电子直销平台开通“货币通：跨行取现”业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-05-30
22	关于旗下部分基金增加诺亚正行（上海）基金为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-06-04
23	关于旗下部分基金增加光大证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-06-07
24	关于旗下部分基金增加中信万通证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-06-07
25	关于基金电子直销平台开展工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-06-17
26	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-06-26
27	关于华安旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网银申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-07-03
28	关于旗下部分基金增加万银财富（北京）基金销售有限公司为代销机构并开通基金定投、转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-07-10

29	关于旗下部分基金增加北京展恒基金销售有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-07-26
30	关于旗下部分基金增加上海农商行为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-01
31	关于旗下部分基金增加中期时代为代销机构并开通转换、参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-01
32	关于旗下部分基金参加上海农商银行费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-05
33	关于旗下部分基金增加浙江同花顺基金销售有限公司为代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-05
34	关于旗下部分基金增加众禄为代销机构并参加费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-15
35	关于电子直销平台“赎回转认购”交易费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-19
36	关于旗下部分基金参加诺亚正行申购、定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-20
37	关于旗下部分基金增加联讯证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-20
38	关于旗下部分基金参加万银财富申购定投费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-08-30
39	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-09-14
40	华安基金管理有限公司关于设立子公司的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-09-29
41	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-09-30
42	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-10-09
43	关于旗下部分基金增加宏源证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-11-13
44	关于旗下部分基金增加新时代证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-11-13
45	关于旗下部分基金增加中信建投证券为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-11-13
46	关于基金电子交易平台延长工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-12-13
47	华安基金管理有限公司关于华安大中华升级股票型证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-12-20
48	关于旗下部分基金参加中国工商银行定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2013-12-27

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

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

13.3 查阅方式

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

华安基金管理有限公司
二〇一四年三月三十一日