

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

2012 年半年度报告摘要

2012 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年八月二十七日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 3 月 29 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安标普全球石油指数（QDII-LOF）
基金主代码	160416
交易代码	160416
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月29日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	371,171,297.85份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2012年5月2日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪，追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以标普全球石油指数成分股构成及其权重等指标为基础构建指数化投资组合。选择以“跟踪偏离度的绝对值”作为投资组合管理的主要标准，控制基金相对指数的偏离风险。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过6%（以美元资产计价）。
业绩比较基准	标普全球石油净总收益指数收益率（S&P Global Oil Index Net Total Return）
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高预期收益的基金品种，其风险和预期收益高于货币市场基金、债券

	型基金和混合型基金。
--	------------

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	fengying@huan.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275853

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
办公地址		One Lincoln Street, Boston, Massachusetts 02111, United States of America
邮政编码		02111

2.5 信息披露方式

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012 年 3 月 29 日(基金合同生效日)至 2012 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	467,651.70

本期利润	-8,657,438.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0198
本期基金份额净值增长率	-2.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	-0.0197
期末基金资产净值	363,851,472.42
期末基金份额净值	0.980

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）。

4. 本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，截至本报告期末，本基金未满一个完整半年度。

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
过去一个月	3.27%	1.23%	4.94%	1.70%	-1.67%	-0.47%
过去三个月	-2.00%	0.83%	-8.22%	1.39%	6.22%	-0.56%
自基金合 同生效起 至今	-2.00%	0.81%	-8.10%	1.36%	6.10%	-0.55%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）



注：1. 本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2. 根据《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》规定，本基金建仓期不超过 6 个月。截至本报告期期末，本基金的投资组合比例尚未符合基金合同第十三部分“基金的投资”中投资范围、投资限制的有关约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2012 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上

证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月月鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级等 29 只开放式基金，管理资产规模达到 854.82 亿人民币。

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		
徐宜宜	本基金的基金经理	2012-03-29	-	6 年	管理学硕士，CFA（国际金融分析师），FRM(金融风险管理师)，6 年证券、基金行业从业经历，具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011 年 1 月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011 年 5 月起担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理职务。2012 年 3 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《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：

在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。

在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进

行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。

（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 MSN 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。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 2 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，

也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2012 年上半年油价总体走势前高后低。第一季度主要受经济利好和对货币宽松的预期影响，油价出现大幅上涨。此外，伊朗对封锁霍尔姆斯海峡的言论和叙利亚战争的爆发也促使布伦特油价一度触及 125 美元一桶。国内油价也突破 8 元大关。二季度以来，欧债危机的加剧导致美元走强，而石油需求因价格高企而走软，供应也较为充裕，此外中东不稳定局势得到了暂时的缓解。这些原因导致油价短时间内出现大幅度下跌。二季度末，希腊第二轮选举结束以及欧央行的一系列救助决定使得市场悲观情绪得以缓解，油价出现一定幅度的回升，也带动了石油股票价格的回升。总体来说，上半年石油指数的走势和油价高度吻合，呈现前高后低翘尾的态势。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金成立日为 2012 年 3 月 29 日。截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.980 元，本报告期份额净值增长率为-2.00%，成立日至 6 月 30 日的业绩比较基准增长率为 -8.10%。2012 年上半年，由于新基金建仓因素，使得累计偏离度为 6.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来一段时间，欧债危机依然有继续恶化的可能，市场情绪依旧脆弱。而美国经济表现也在逐步走弱，第三轮量化宽松推出的概率有所增加。叙利亚战争进入白热化阶段，中东局势不稳。中国经济放缓则对大宗商品的价格产生压制。综合来看，预计油价将震荡，突破上半年的上下区间的概率较小。

作为标普石油指数基金的管理人，我们继续坚持积极将基金回报与指数相拟合的原则，降低跟踪偏离和跟踪误差，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

宋磊，投资研究部联席总监，工学硕士，曾在鹏华证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、投资研究部联席总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

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

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

（2）托管银行

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

（3）会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2012 年 6 月 30 日
资 产：	
银行存款	61,647,778.38
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	295,759,934.23
其中：股票投资	258,717,746.27
基金投资	37,042,187.96
债券投资	-
资产支持证券投资	-
衍生金融资产	17,487.08
买入返售金融资产	-
应收证券清算款	12,004,743.17
应收利息	3,021.98
应收股利	267,627.50
应收申购款	308,190.66
递延所得税资产	-
其他资产	171,930.26
资产总计	370,180,713.26
负债和所有者权益	本期末 2012 年 6 月 30 日
负 债：	
短期借款	-
交易性金融负债	-
衍生金融负债	-
卖出回购金融资产款	-
应付证券清算款	-
应付赎回款	5,604,331.15
应付管理人报酬	296,427.50
应付托管费	82,999.71
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	345,482.48
负债合计	6,329,240.84
所有者权益：	
实收基金	371,171,297.85
未分配利润	-7,319,825.43
所有者权益合计	363,851,472.42
负债和所有者权益总计	370,180,713.26

注：

1. 报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.980 元，基金份额总额 371,171,297.85 份。

2. 本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 6 月 30 日）数据。

6.2 利润表

会计主体：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	-6,725,172.30
1.利息收入	1,068,806.71
其中：存款利息收入	210,089.70
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	858,717.01
其他利息收入	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	2,239,886.59
其中：股票投资收益	199,335.45
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	-
股利收益	2,040,551.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-9,125,090.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-1,108,068.35
5.其他收入（损失以“-”号填列）	199,293.02
减：二、费用	1,932,266.27
1. 管理人报酬	1,101,192.27
2. 托管费	308,333.86
3. 销售服务费	-
4. 交易费用	298,851.48
5. 利息支出	-
其中：卖出回购金融资产支出	-
6. 其他费用	223,888.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-8,657,438.57
减：所得税费用	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-8,657,438.57

注：本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

本报告期：2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	529,058,682.11	-	529,058,682.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,657,438.57	-8,657,438.57
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”	-157,887,384.26	1,337,613.14	-156,549,771.12

号填列)			
其中：1. 基金申购款	2,981,466.06	-98,300.08	2,883,165.98
2. 基金赎回款	-160,868,850.32	1,435,913.22	-159,432,937.10
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)	371,171,297.85	-7,319,825.43	363,851,472.42

注：本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：赵敏，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）（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 1475 号《关于核准华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）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《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）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 528,753,887.81 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(2012)第 92 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2012 年 3 月 29 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 529,058,682.11 份基金份额，其中认购资金利息折合 304,794.30 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为道富银行。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》的有关规定，本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股，与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类证券、

货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股的比例不低于基金资产净值的 80%；投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的 20%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以相应调整本基金的投资范围、投资比例规定。本基金业绩比较基准为：标普全球石油净总收益指数收益率（S&P Global Oil Index Net Total Return）。

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 2012 年 8 月 24 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则——基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2012 年 3 月 29 日（基金合同生效日）至 2012 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

本基金目前持有的股票投资、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、买入返售金融资产和各类应收款项等。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各类应付款项等。

6.4.4.4 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，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行

后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）。

6.4.4.9 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；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，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（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）为正数，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（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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[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，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

华安基金管理有限公司（“华安基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
道富银行（State Street Bank and Trust Company）	境外资产托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无通过关联方交易单元进行的交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无通过关联方交易单元进行的股票交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无通过关联方交易单元进行的权证交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.1.3 债券交易

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无通过关联方交易单元进行的债券交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.1.4 债券回购交易

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.1.5 基金交易

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无通过关联方交易单元进行的基金交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）无支付关联方的佣金。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,101,192.27
其中：支付销售机构的客户维护费	766,393.92

注：1）支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 1% / 当年天数。

2）本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	308,333.86

注：1）支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.28% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.28% / 当年天数。

2）本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内（2012 年 3 月 29 日至 2012 年 6 月 30 日）没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2012年3月29日（基金合同生效日）至2012年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银	12,147,247.83	195,643.80

行		
美国道富银行	49,500,530.55	1,847.41

注：1）本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人美国道富银行保管，按适用利率或约定利率计息。

2）本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，因此无上年度可比期间（2011 年 3 月 29 日至 2011 年 6 月 30 日）数据。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 06 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2012 年 06 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	258,717,746.27	69.89
	其中：普通股	246,093,751.86	66.48
	存托凭证	12,623,994.41	3.41

	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	37,042,187.96	10.01
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	17,487.08	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	17,487.08	-
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	61,647,778.38	16.65
8	其他各项资产	12,755,513.57	3.45
9	合计	370,180,713.26	100.00

7.2 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（%）
美国	152,584,816.80	41.94
英国	29,544,091.81	8.12
中国香港	24,084,875.98	6.62
法国	22,998,668.45	6.32
加拿大	10,948,925.89	3.01
澳大利亚	10,932,831.58	3.00
意大利	7,623,535.76	2.10
合计	258,717,746.27	71.11

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

7.3.1 指数投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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（%）
电信服务	-	-

工业	-	-
信息技术	-	-
非必需消费品	-	-
能源	257,561,428.05	70.79
保健	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
合计	257,561,428.05	70.79

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.3.2 积极投资报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

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（%）
电信服务	-	-
工业	-	-
信息技术	-	-
非必需消费品	-	-
能源	1,156,318.22	0.32
保健	-	-
公用事业	-	-
金融	-	-
必需消费品	-	-
材料	-	-
合计	1,156,318.22	0.32

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 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

7.4.1 指数投资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	EXXON MOBIL	艾克森美	XOM	纽	美	68,500	37,073,685.97	10.19

	CORP	孚石油	US	约 交 易 所	国			
2	CHEVRON CORP	雪 佛 龙 德 士 古	CVX US	纽 约 交 易 所	美 国	43,500	29,026,547.33	7.98
3	TOTAL SA	道达尔	FP FP	法 国 交 易 所	法 国	80,000	22,353,640.00	6.14
4	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	荷 兰 皇 家 壳 牌	RDSA LN	伦 敦 交 易 所	英 国	62,380	13,150,822.32	3.61
5	SCHLUMBERGER LTD	斯伦贝谢	SLB US	纽 约 交 易 所	美 国	24,000	9,853,182.22	2.71
6	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	COP US	纽 约 交 易 所	美 国	24,500	8,659,167.59	2.38
7	PETROCHINA CO LTD-H	中 国 石 油 天 然 气	857 HK	香 港 交 易 所	中 国	1,050,000	8,517,010.95	2.34
8	ANADARKO PETROLEUM CORP	阿 纳 达 科 石 油	APC US	纽 约 交 易 所	美 国	19,500	8,164,813.41	2.24
9	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	西方石油	OXY US	纽 约 交 易 所	美 国	14,000	7,594,813.42	2.09

10	WOODSIDE PETROLEUM LTD	伍德赛德 石油有限 公司	WPL AU	澳 大 利 亚 交 易 所	澳 大 利 亚	36,500	7,186,716.70	1.98
----	---------------------------	--------------------	-----------	---------------------------------	------------------	--------	--------------	------

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于 www.huaan.com.cn 网站的半年度报告正文。

7.4.2 积极投资期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权益投资明细

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	PHILLIPS 66	菲 利 普 66	PSX US	纽约	美国	5,500	1,156,318.22	0.32

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于 www.huaan.com.cn 网站的半年度报告正文。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资 产净值比例 (%)
1	EXXON MOBIL CORP	XOM US	36,596,906.56	10.06
2	CHEVRON CORP	CVX US	28,722,321.18	7.89
3	TOTAL SA	FP FP	23,764,237.57	6.53
4	CHINA OILFIELD SERVI	2883 HK	17,477,700.06	4.80
5	ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	RDSA LN	12,835,825.39	3.53
6	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	12,543,041.75	3.45
7	SCHLUMBERGER LTD	SLB US	10,540,807.81	2.90

8	CONNOCOPHILLIPS	COP US	9,428,684.64	2.59
9	PETROLEO BRASILEIRO S.A.-ADR	PBR US	9,202,098.89	2.53
10	ANADARKO PETROLEUM CORP	APC US	8,643,648.27	2.38
11	WOODSIDE PETROLEUM LTD	WPL AU	8,059,286.24	2.21
12	CNOOC LTD	883 HK	8,006,341.47	2.20
13	OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	OXY US	7,275,304.72	2.00
14	ENI SPA	ENI IM	6,741,789.62	1.85
15	BG GROUP PLC	BG/ LN	6,531,106.93	1.79
16	CHINA PETROLEUM & CH	386 HK	6,522,716.03	1.79
17	BP PLC	BP/ LN	6,039,152.07	1.66
18	CANADIAN NATURAL RESOURCES	CNQ CN	5,486,450.82	1.51
19	HALLIBURTON CO	HAL US	5,406,020.28	1.49
20	APACHE CORP	APA US	4,563,125.75	1.25

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

7.5.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	CHINA OILFIELD SERVI	2883 HK	10,736,215.46	2.95
2	CNOOC LTD	883 HK	5,198,384.63	1.43
3	PETROCHINA CO LTD-H	857 HK	3,947,419.73	1.08
4	EL PASO CORP	EP US	184,151.44	0.05

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

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	286,462,343.49
卖出收入（成交）总额	20,066,171.26

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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

金额单位：人民币元

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	权证	KMI/WS US	17,487.08	0.00

7.10 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

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	Energy Select Sector SPDR Fund	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	12,383,616.58	3.40
2	SPDR S&P Oil & Gas Exploration & Production ETF	ETF	开放式	State Street Bank and Trust Company	10,678,961.16	2.93
3	United States	ETF	开放式	United States	10,670,043.05	2.93

	Oil Fund LP			Commodities Fund LLC		
4	Proshare ULT DJ-UBS Crude Oil	ETF	开放式	Proshares Trust	3,309,567.17	0.91

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	12,004,743.17
3	应收股利	267,627.50
4	应收利息	3,021.98
5	应收申购款	308,190.66
6	其他应收款	119,143.66
7	待摊费用	52,786.60
8	其他	-
9	合计	12,755,513.57

7.11.4 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。

7.11.5 期末指数股票投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数股票前十名中不存在流通受限情况。

7.11.5.1 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他需要说明的事项

无。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
6,119	60,658.82	3,311,881.69	0.89%	367,859,416.16	99.11%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	马辰浩	200,066.00	4.05%
2	祝玉娟	200,027.00	4.05%
3	郭萍	200,016.00	4.05%
4	张兰芬	200,008.00	4.05%
5	陈琴芬	120,014.00	2.43%
6	于礼平	118,009.00	2.39%
7	杨秋梅	100,013.00	2.03%
8	娄玉芝	100,012.00	2.03%
9	崔连生	100,012.00	2.03%
10	高丽华	100,010.00	2.03%

8.3 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	452,757.56	0.1220%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 3 月 29 日）基金份额总额	529,058,682.11
基金合同生效日（2012 年 3 月 29 日）起至报告期期末基金总申购份额	2,981,466.06
减：基金合同生效日（2012 年 3 月 29 日）起至报告期期末基金总赎回份额	160,868,850.32
基金合同生效日（2012 年 3 月 29 日）起	-

至报告期期末基金拆分变动份额	
本报告期期末基金份额总额	371,171,297.85

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	44,842,545.69	14.63%	13,091.32	13.20%	-
Nomura International Plc.	-	60,118,025.67	19.61%	28,235.92	28.46%	-
Morgan Stanley & Co. International PLC	-	86,309,872.94	28.16%	22,068.29	22.25%	-
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	-	30,540,677.92	9.96%	11,744.97	11.84%	-
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	84,386,942.32	27.53%	24,058.60	24.25%	-
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corp.	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-

Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities(Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities Company Limited.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
UOB KayHian HK Ltd	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Asia Limited.	-	-	-	-	-	-
BMO Nesbitt Burns Inc.	-	-	-	-	-	-

注：本基金于 2012 年 3 月 29 日成立，以上券商均为本报告期间新增券商。

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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		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
兴业证券股份有限公司	-	-	1,634,500,000.00	100.00%	-	-	-	-
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International Plc.	-	-	-	-	-	-	6,093,095.98	15.91%

Morgan Stanley & Co. International PLC	-	-	-	-	-	-	14,186,638.76	37.03%
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	-	-	-	-	-	-	8,398,458.84	21.92%
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	-	-	-	-	-	9,628,810.32	25.14%
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
SinoPac Securities Corp.	-	-	-	-	-	-	-	-
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities	-	-	-	-	-	-	-	-

Company Limited.								
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
UOB KayHian HK Ltd	-	-	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Asia Limited.	-	-	-	-	-	-	-	-
BMO Nesbitt Burns Inc.	-	-	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一二年八月二十七日