

华安香港精选股票型证券投资基金

2012 年半年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 17 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2012 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	境外资产托管人	5
2.5	信息披露方式	5
2.6	其他相关资料	5
3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现	6
4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1	资产负债表	15
6.2	利润表	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注	18
7	投资组合报告	33
7.1	期末基金资产组合情况	33
7.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	33
7.3	期末按行业分类的权益投资组合	34
7.4	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	34
7.5	报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	43
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	44
7.8	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	44
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	44
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	44
7.11	投资组合报告附注	44
8	基金份额持有人信息	45
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45

8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
9	开放式基金份额变动	45
10	重大事件揭示	45
10.1	基金份额持有人大会决议.....	45
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	46
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4	基金投资策略的改变	46
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8	其他重大事件	49
11	备查文件目录	51
11.1	备查文件目录	51
11.2	存放地点	51
11.3	查阅方式	51

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安香港精选股票型证券投资基金
基金简称	华安香港精选股票（QDII）
基金主代码	040018
交易代码	040018
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月19日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	296,104,198.65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	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。通过对于经济周期的跟踪和研究，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。同时通过对香港市场和具有中国概念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。
业绩比较基准	MSCI中华指数（MSCI Zhong Hua 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和债券型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008850099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		李勃	姜建清

2.4 境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	The Hong Kong and Shanghai Banking Corporation Limited
	中文	香港上海汇丰银行有限公司
注册地址		香港中环皇后大道中一号汇丰总行大厦
办公地址		香港九龙深旺道一号，汇丰中心一座六楼
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
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-12,388,276.24
本期利润	-164,781.57
加权平均基金份额本期利润	-0.0006
本期加权平均净值利润率	-0.08%
本期基金份额净值增长率	-0.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-67,483,197.53
期末可供分配基金份额利润	-0.2279
期末基金资产净值	228,621,001.12
期末基金份额净值	0.772
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2012 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-22.80%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去 1 个月	1.31%	1.20%	1.50%	1.32%	-0.19%	-0.12%
过去 3 个月	-5.28%	1.04%	-6.85%	1.19%	1.57%	-0.15%
过去 6 个月	-0.39%	1.04%	3.17%	1.14%	-3.56%	-0.10%

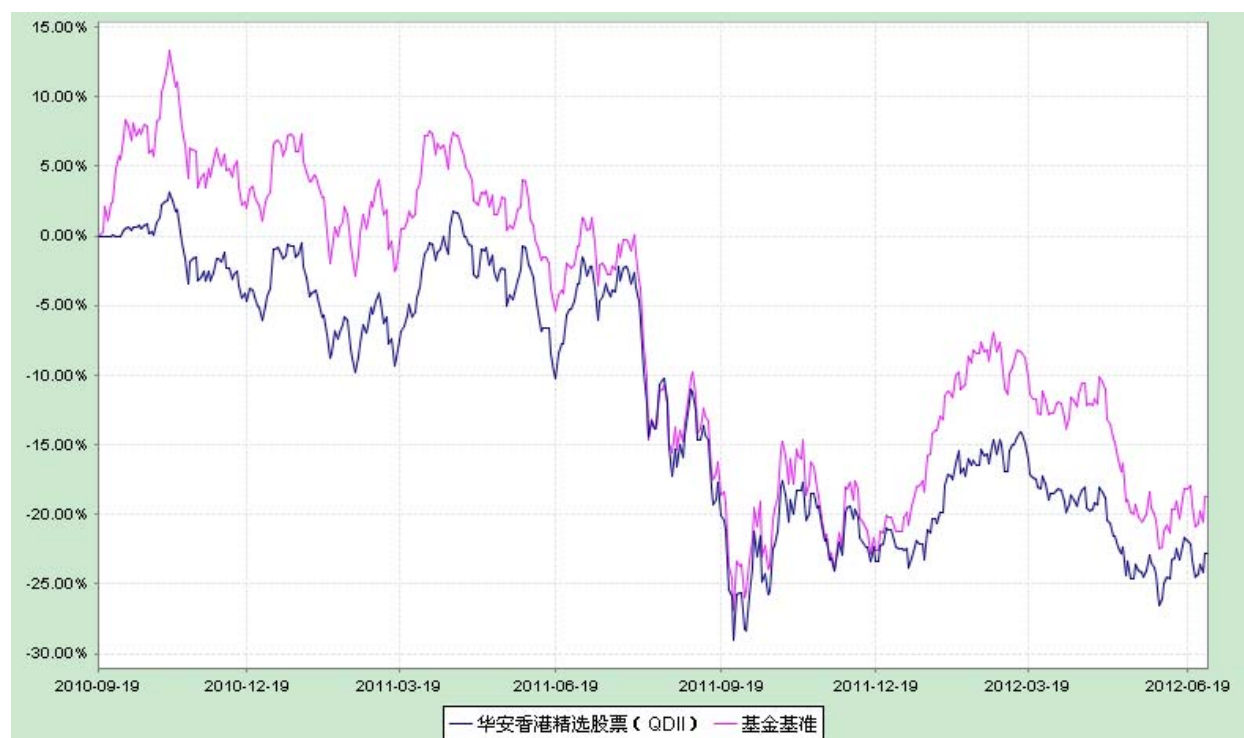
月						
过去 1 年	-20.08%	1.50%	-18.18%	1.62%	-1.90%	-0.12%
自基金成立起至今	-22.80%	1.28%	-18.74%	1.41%	-4.06%	-0.13%

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

华安香港精选股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2010 年 9 月 19 日至 2012 年 6 月 30 日)



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 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		
翁启森	本基金的基金经理，全球投资部总监	2010-09-19	-	15 年	工业工程学硕士，15 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，任全球投资部总监。2010 年 9 月起担任本基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。

苏圻涵	本基金的 基金经理	2010-09-19	-	8 年	博士研究生，8 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 月起担任本基金的基金经理。2011 年 5 月起同时担任华安大中华升级股票型证券投资基金的基金经理。
-----	--------------	------------	---	-----	---

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》、《华安香港精选股票型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统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，尤其是 3 月开始，避险情绪再次成为主导全球资本市场的主线。风险资产和避险资产走势出现显著差异。高风险资产，包括大宗商品、股票、公司债券等显著跑输避险资产，美国、德国、英国等国债收益率大幅下行，达到历史新低。

全球股票市场表现出现分化，发达市场明显跑赢新兴市场。美元期内表现相对强势，资金有流出新兴市场的迹象。同时由于对中国经济不确定性的担忧，以及台湾市场证交所税等利空政策的影响，香港、及台湾市场表现远远落后于发达市场。

报告期内，在欧债危机和国内经济下行趋势的市场环境中，我们较早的转向了盈利确定性较高的行业，包括泛消费行业、医疗、电信等，低配银行、地产、原材料等周期性行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为 0.772 元，本期基金净值增长率为-0.39%，同期比较基准收益率为 3.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为美国经济复苏的放缓，欧债问题的持续恶化，以及中国经济遭遇周期性和结构性双重压力，经济基本面持续疲弱的可能性较大。疲弱的经济基本面将对风险资产，包括股票的走势持续产生压力。

对于香港市场，我们维持中性观点，香港市场维持区间振荡走势的可能性较大，缺乏向上和向下突破的触发因素。从年初以来的市场运行特点来看，市场调整到达区间下限后，投资者寄希望于政策放松，市场回升后，投资者又回过头来，对经济基本面和企业盈利进行检验。市场在“政策底”和“经济顶”之间反复振荡。

在持续低靡的经济环境中，企业盈利的恢复需要一个长期的过程。因此，我们仍将坚

持通过寻找在经济下行周期中，盈利确定性高的行业和个股，包括消费、医药、电力、纺织等，作为基金的基础持股。同时，基于货币和财政政策开始实质性放松，我们也将对部分政策实质受益类个股，家电、环保、地产，以及业绩、估值处于历史低点，基本面阶段性改善的早周期个股，航空等进行关注。

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

2012 年上半年，本基金托管人在对华安香港精选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2012 年上半年，华安香港精选股票型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安香港精选股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安香港精选股票型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安香港精选股票型证券投资基金 2012 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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：华安香港精选股票型证券投资基金

报告截止日：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	21,718,642.51	28,532,222.58
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	208,128,952.83	177,888,525.18
其中：股票投资		208,128,952.83	177,888,525.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	2,175,514.71
应收利息	6.4.7.5	1,426.62	1,650.36
应收股利		1,761,542.00	26,396.39
应收申购款		15,282.82	59,237.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		231,625,846.78	208,683,546.56
负 债 和 所 有 者 权 益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		545,412.77	-
应付赎回款		1,957,117.24	254,819.05
应付管理人报酬		259,488.56	275,994.67
应付托管费		51,897.70	55,198.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-

应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	190,929.39	372,058.31
负债合计		3,004,845.66	958,070.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	296,104,198.65	268,098,557.57
未分配利润	6.4.7.10	-67,483,197.53	-60,373,081.96
所有者权益合计		228,621,001.12	207,725,475.61
负债和所有者权益总计		231,625,846.78	208,683,546.56

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.772 元，基金份额总额 296,104,198.65 份。

6.2 利润表

会计主体：华安香港精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
一、收入		2,284,881.78	6,529,463.25
1. 利息收入		12,067.50	36,020.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,067.50	36,020.97
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）		-9,778,908.15	-13,478,084.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-13,200,013.40	-16,194,120.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资		-	-

收益			
衍生工具收益	6.4.7.1 4	-	-
股利收益	6.4.7.1 5	3,421,105.25	2,716,036.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 6	12,223,494.67	20,456,382.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-187,320.83	-625,766.28
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.1 7	15,548.59	140,910.23
减：二、费用		2,449,663.35	3,966,634.60
1. 管理人报酬	6.4.10. 2.1	1,580,221.74	2,407,113.00
2. 托管费	6.4.10. 2.2	316,044.38	481,422.59
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.1 8	340,465.95	882,605.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.1 9	212,931.28	195,493.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-164,781.57	2,562,828.65
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-164,781.57	2,562,828.65

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安香港精选股票型证券投资基金

本报告期：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	268,098,557.57	-60,373,081.96	207,725,475.61
二、本期经营活动产生	-	-164,781.57	-164,781.57

的基金净值变动数(本期利润)			
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)	28,005,641.08	-6,945,334.00	21,060,307.08
其中: 1. 基金申购款	55,416,752.26	-12,559,548.69	42,857,203.57
2. 基金赎回款	-27,411,111.18	5,614,214.69	-21,796,896.49
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)	296,104,198.65	-67,483,197.53	228,621,001.12
项目	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	381,164,290.69	-14,533,877.67	366,630,413.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,562,828.65	2,562,828.65
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)	-87,376,039.17	2,103,744.38	-85,272,294.79
其中: 1. 基金申购款	28,153,782.87	-697,669.19	27,456,113.68
2. 基金赎回款	-115,529,822.04	2,801,413.57	-112,728,408.47
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)	293,788,251.52	-9,867,304.64	283,920,946.88

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人: 李勍, 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

华安香港精选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[2010]第 809 号《关于核准华安香港精选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《华安香港精选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 740,818,736.04 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(2010)第 239 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 740,895,365.72 份基金份额,其中认购资金利息折合 76,629.68 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为依法发行在香港证券市场交易的股票;同时为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于美国、新加坡、台湾等证券市场交易的在中国地区有重要经营活动(主营业务收入或利润的至少 50%来自于中国)的企业发行的股票或存托凭证;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 80%的股票资产投资于香港证券市场;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%。本基金的业绩比较基准为:MSCI 中华指数。

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 2011 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 号关于发布《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>》等问题的通知、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》、《华安香港精选股票型

证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 1 月 1 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 1 月 1 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 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。

6.4.5 差错更正的说明

无。

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》及其他境内外相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 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) 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，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
活期存款	21,718,642.51
定期存款	-

其他存款	-
合计	21,718,642.51

注：于 2012 年 6 月 30 日，活期存款包括人民币活期存款 6,691,441.31 元，美元活期存款 103.67 元(折合人民币 655.70 元)、港币活期存款 18,394,764.35 元(折合人民币 14,995,779.79 元)和新台币活期存款 145,304.00 元(折合人民币 30,765.71 元)。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		233,249,387.31	208,128,952.83	-25,120,434.48
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		233,249,387.31	208,128,952.83	-25,120,434.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,426.62
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	1,426.62

6.4.7.6 其他资产

无余额。

6.4.7.7 应付交易费用

无余额。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,932.53
预提费用	186,996.86
合计	190,929.39

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	268,098,557.57	268,098,557.57
本期申购	55,416,752.26	55,416,752.26
本期赎回（以“-”号填列）	-27,411,111.18	-27,411,111.18
本期末	296,104,198.65	296,104,198.65

6.4.7.10 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	-23,275,375.55	-37,097,706.41	-60,373,081.96
本期利润	-12,388,276.24	12,223,494.67	-164,781.57
本期基金份额交易产生的变动数	-3,760,390.04	-3,184,943.96	-6,945,334.00
其中：基金申购款	-7,077,859.05	-5,481,689.64	-12,559,548.69
基金赎回款	3,317,469.01	2,296,745.68	5,614,214.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,424,041.83	-28,059,155.70	-67,483,197.53

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12,056.05
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	11.45
合计	12,067.50

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	88,941,053.79
减：卖出股票成本总额	102,141,067.19
买卖股票差价收入	-13,200,013.40

6.4.7.13 债券投资收益

无。

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,421,105.25
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,421,105.25

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	12,223,494.67
——股票投资	12,223,494.67
——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	12,223,494.67

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	15,548.59

合计	15,548.59
----	-----------

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	340,465.95
银行间市场交易费用	-
合计	340,465.95

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	33,316.92
信息披露费	149,179.94
账户维护费	9,000.00
银行汇划费	149.00
其他	21,285.42
合计	212,931.28

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 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、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人、基金代销机构
香港上海汇丰银行有限公司 (The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited, “汇丰银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

无。

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,580,221.74	2,407,113.00
其中：支付销售机构的客户维护费	565,523.67	811,248.33

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	316,044.38	481,422.59

注：支付基金托管人中国工商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 X 0.3% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	19,999,000.00	19,999,000.00
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	19,999,000.00	19,999,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.75%	6.81%

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	6,691,656.26	12,056.05	6,603,750.63	35,671.68
香港上海汇丰银行有限公司	15,026,986.25	-	23,787,318.14	325.68

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人汇丰银行保管，按适用利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2012 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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、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。

6.4.13.2 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了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行以及境外次托管行汇丰银行，因而与该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，因此违约风险可能性很小。

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 2012 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2011 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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制的投资品种比例等。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值 10%，且本基金的基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10%以上具有投票权的证券发行总量。本基金所持证券均在证券交易所上市，金融资产均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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、结算备付金、债券投资等。本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,718,642.51	-	-	-	21,718,642.51
交易性金融资产	-	-	-	208,128,952.83	208,128,952.83
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,426.62	1,426.62
应收股利	-	-	-	1,761,542.00	1,761,542.00
应收申购款	894.27	-	-	14,388.55	15,282.82
资产总计	21,719,536.78	-	-	209,906,310.00	231,625,846.78
负债					
应付证券清算款	-	-	-	545,412.77	545,412.77
应付赎回款	-	-	-	1,957,117.24	1,957,117.24
应付管理人报酬	-	-	-	259,488.56	259,488.56
应付托管费	-	-	-	51,897.70	51,897.70
其他负债	-	-	-	190,929.39	190,929.39
负债总计	-	-	-	3,004,845.66	3,004,845.66
利率敏感度缺口	21,719,536.78	-	-	206,901,464.34	228,621,001.12
上年度末2011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	28,532,222.58	-	-	-	28,532,222.58
交易性金融资产	-	-	-	177,888,525.18	177,888,525.18
应收证券清算款	-	-	-	2,175,514.71	2,175,514.71
应收利息	-	-	-	1,650.36	1,650.36
应收股利	-	-	-	26,396.39	26,396.39
应收申购款	1,689.18	-	-	57,548.16	59,237.34
资产总计	28,533,911.76	-	-	180,149,634.80	208,683,546.56
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-

应付赎回款	-	-	-	254,819.05	254,819.05
应付管理人报酬	-	-	-	275,994.67	275,994.67
应付托管费	-	-	-	55,198.92	55,198.92
其他负债	-	-	-	372,058.31	372,058.31
负债总计	-	-	-	958,070.95	958,070.95
利率敏感度缺口	28,533,911.76	-	-	179,191,563.85	207,725,475.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 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(2011 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 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。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30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
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	655.70	14,995,779.79	30,765.71	15,027,201.20
交易性金融资产	1,945,410.53	199,435,895.40	6,747,646.90	208,128,952.83
应收股利	-	1,687,858.78	73,683.22	1,761,542.00
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-
资产合计	1,946,066.23	216,119,533.97	6,852,095.83	224,917,696.03
以外币计价的负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	545,412.77	-	545,412.77
负债合计	-	545,412.77	-	545,412.77
资产负债表外汇风险敞口净额	1,946,066.23	215,574,121.20	6,852,095.83	224,372,283.26
项目	上年度末			

	2011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
以外币计价的资产	-	-	-	-
银行存款	22,013.90	25,889,024.50	289,522.60	26,200,561.00
交易性金融资产	2,765,315.05	172,339,943.26	2,783,266.87	177,888,525.18
应收股利	-	26,396.39	-	26,396.39
应收证券清算款	-	2,175,514.71	-	2,175,514.71
应收利息	-	5.41	-	5.41
资产合计	2,787,328.95	200,430,884.27	3,072,789.47	206,291,002.69
以外币计价的负债	-	-	-	-
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	2,787,328.95	200,430,884.27	3,072,789.47	206,291,002.69

6.4.13.4.2.2 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）	
		本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	增加约1,122.00万元	增加约1,031.00万元
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约1,122.00万元	减少约1,031.00万元

6.4.13.4.3 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行

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投资比例不低于基金资产的 60%，其中不低于 80%的股票资产投资于香港证券市场。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	208,128,952.83	91.04	177,888,525.18	85.64
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	208,128,952.83	91.04	177,888,525.18	85.64

6.4.13.4.3.2 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）	
		本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升5%	增加约948.00万元	增加约926.00万元
	业绩比较基准下降5%	减少约948.00万元	减少约926.00万元

6.4.14 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	208,128,952.83	89.86
	其中：普通股	206,183,542.30	89.02
	存托凭证	1,945,410.53	0.84
	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	21,718,642.51	9.38
8	其他各项资产	1,778,251.44	0.77
9	合计	231,625,846.78	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 (%)
中国香港	199,435,895.40	87.23
中国台湾	6,747,646.90	2.95
美国	1,945,410.53	0.85
合计	208,128,952.83	91.04

7.3 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（%）
金融	60,627,045.37	26.52
非必需消费品	31,347,638.44	13.71
必需消费品	25,892,369.55	11.33
能源	21,529,091.98	9.42
保健	21,279,027.34	9.31
工业	17,151,266.84	7.50
信息技术	11,799,835.89	5.16
电信服务	8,910,028.51	3.90
材料	5,925,919.78	2.59
公用事业	3,666,729.13	1.60
合计	208,128,952.83	91.04

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	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	中国平安保险（集团）股份有限公司	2318 HK	中国香港	中国	159,000	7,997,552.77	3.50
2	Sinopharm Group Co., Ltd.	国药控股股份有限公司	1099 HK	中国香港	中国	452,400	7,855,557.75	3.44
3	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生物制药有限公司	1177 HK	中国香港	中国	3,324,000	7,560,317.67	3.31
4	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	康师傅控股有限公司	322 HK	中国香港	中国	444,000	7,174,001.22	3.14

				港				
5	AIA Group Limited	友邦保险控股有限公司	1299 HK	中国 香港	中国	324,400	7,008,120.25	3.07
6	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	728 HK	中国 香港	中国	2,496,000	6,857,239.33	3.00
7	Hengan International Group Company Limited	恒安国际集团有限公司	1044 HK	中国 香港	中国	111,500	6,812,732.40	2.98
8	CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	中国光大国际有限公司	257 HK	中国 香港	中国	2,161,000	6,394,936.22	2.80
9	Air China Limited	中国国际航空股份有限公司	753 HK	中国 香港	中国	1,664,000	6,158,628.40	2.69
10	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	中国 香港	中国	310,000	5,964,149.52	2.61
11	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	中国 香港	中国	463,000	5,812,681.64	2.54
12	Tsingtao Brewery Company Limited	青岛啤酒股份有限公司	168 HK	中国 香港	中国	156,000	5,602,028.80	2.45
13	Tianneng Power International Limited	天能动力国际有限公司	819 HK	中国 香港	中国	1,498,000	4,982,494.20	2.18
14	Skyworth Digital Holdings Limited	创维数码控股有限公司	751 HK	中国 香港	中国	1,724,000	4,806,602.34	2.10
15	Citic Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	6030 HK	中国	中国	356,000	4,718,949.88	2.06

				香港				
16	Haitong Securities CO., LTD.	海通证券股份有限公司	6837 HK	中国香港	中国	520,400	4,573,312.46	2.00
17	China Petroleum And Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	中国香港	中国	802,000	4,498,188.31	1.97
18	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	中国太平洋保险(集团)股份有限公司	2601 HK	中国香港	中国	198,600	4,031,377.03	1.76
19	Kunlun Energy Company Limited	昆仑能源有限公司	135 HK	中国香港	中国	396,000	3,983,686.66	1.74
20	Chaowei Power Holdings Limited	超威动力控股有限公司	951 HK	中国香港	中国	1,125,000	3,567,606.53	1.56
21	Picc Property And Casualty Company Limited.	中国人民财产保险股份有限公司	2328 HK	中国香港	中国	492,000	3,477,435.04	1.52
22	China Minsheng Banking Corp., Ltd.	中国民生银行股份有限公司	1988 HK	中国香港	中国	610,000	3,416,342.45	1.49
23	China Citic Bank Corporation Limited	中信银行股份有限公司	998 HK	中国香港	中国	1,057,800	3,406,241.88	1.49
24	Agricultural Bank Of China Limited	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	中国香港	中国	1,261,000	3,176,496.58	1.39
25	Belle International Holdings Limited	百丽国际控股有限公司	1880 HK	中国香港	中国	294,000	3,144,531.80	1.38
26	Techtronic Industries	创科实业有限	669	中	中	395,500	3,137,141.83	1.37

	Co. Ltd.	公司	HK	国 香 港	国			
27	China Oilfield Services Limited	中海油田服务股份有限公司	2883 HK	中 国 香 港	中 国	332,000	2,998,835.68	1.31
28	China Merchants Bank Co., Ltd.	招商银行股份有限公司	3968 HK	中 国 香 港	中 国	247,500	2,917,550.10	1.28
29	Shenguan Holdings (Group) Limited	神冠控股(集团)有限公司	829 HK	中 国 香 港	中 国	804,000	2,903,585.38	1.27
30	Shandong Chenming Paper Holdings Limited	山东晨鸣纸业集团股份有限公司	1812 HK	中 国 香 港	中 国	1,135,000	2,877,604.32	1.26
31	Country Garden Holdings Co. Ltd.	碧桂园控股有限公司	2007 HK	中 国 香 港	中 国	964,389	2,382,153.28	1.04
32	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	中 国 香 港	中 国	184,000	2,370,007.58	1.04
33	ZTE Corporation	中兴通讯股份有限公司	763 HK	中 国 香 港	中 国	191,600	2,333,570.51	1.02
34	China Resources Power Holdings Company Limited	华润电力控股有限公司	836 HK	中 国 香 港	中 国	176,000	2,281,311.65	1.00
35	CATCHER TECHNOLOGY CO., LTD.	可成科技股份有限公司	2474 TT	中 国 台 湾	中 国	54,000	2,269,570.27	0.99
36	Media Tek Inc.	联发科技股份有限公司	2454 TT	中 国 台 湾	中 国	39,000	2,254,325.47	0.99

37	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	中国神威药业集团有限公司	2877 HK	中国香港	中国	246,000	2,234,061.50	0.98
38	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	申洲国际集团控股有限公司	2313 HK	中国香港	中国	199,000	2,173,865.65	0.95
39	PetroChina Company Limited	中国石油天然气股份有限公司	857 HK	中国香港	中国	268,000	2,173,865.65	0.95
40	Zhuzhou CSR Times Electric Co., Ltd	株洲南车时代电气股份有限公司	3898 HK	中国香港	中国	127,000	2,169,015.09	0.95
41	ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LIMITED	中升集团控股有限公司	881 HK	中国香港	中国	284,500	2,168,546.34	0.95
42	Want Want China Holdings Limited	中国旺旺控股有限公司	151 HK	中国香港	中国	271,000	2,098,783.89	0.92
43	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	中国香港	中国	93,500	2,061,834.04	0.90
44	China Unicom (Hong Kong) Limited	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	762 HK	中国香港	中国	258,000	2,052,789.18	0.90
45	Capella Microsystems (Taiwan) Inc.	凌耀科技股份有限公司	3582 TT	中国台湾	中国	58,000	1,958,745.64	0.86
46	GCL-Poly Energy Holdings Ltd.	保利协鑫能源控股有限公司	3800 HK	中国香港	中国	1,300,000	1,780,440.48	0.78
47	L' OCCITANE INTERNATIONAL S. A.	L' OCCITANE INTERNATIONAL S. A.	973 HK	中国香港	中国	100,250	1,744,845.94	0.76

				港				
48	Luk Fook Holdings (International)Limited	六福集团(国际)有限公司	590 HK	中国香港	中国	131,000	1,715,108.75	0.75
49	Anhui Conch Cement Company Limited	安徽海螺水泥股份有限公司	914 HK	中国香港	中国	92,500	1,579,794.46	0.69
50	FAR EAST HORIZON LIMITED	远东宏信有限公司	3360 HK	中国香港	中国	354,000	1,572,803.95	0.69
51	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	中国香港	中国	212,000	1,475,939.51	0.65
52	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LIMITED	金鹰商贸集团有限公司	3308 HK	中国香港	中国	112,000	1,437,135.03	0.63
53	Huaneng Power International, Inc.	华能国际电力股份有限公司	902 HK	中国香港	中国	292,000	1,385,417.48	0.61
54	Sihuan Pharmaceutical Holdings Group Ltd.	四环医药控股集团有限公司	460 HK	中国香港	中国	574,000	1,310,221.58	0.57
55	Global Bio-chem Technology Group Company Limited	大成生化科技集团有限公司	809 HK	中国香港	中国	1,438,000	1,301,237.86	0.57
56	WING HANG BANK,Limited	永亨银行有限公司	302 HK	中国香港	中国	20,847	1,272,067.62	0.56
57	CIMC Enric Holdings Limited	中集安瑞科控股有限公司	3899 HK	中国香港	中国	370,000	1,248,754.00	0.55
58	Great Eagle Holdings Limited	鹰君集团有限公司	41 HK	中国	中国	67,077	1,081,620.09	0.47

				香港				
59	China Shanshui Cement Group Limited	中国山水水泥集团有限公司	691 HK	中国香港	中国	238,000	1,018,617.39	0.45
60	Visionchina Media Inc	华视传媒集团有限公司	VISN US	纳斯达克	美国	169,505	997,055.02	0.44
61	Airmedia Group Inc	航美传媒集团股份有限公司	AMCN US	纳斯达克	美国	63,000	948,355.51	0.41
62	Comba Telecom Systems Holdings Ltd.	京信通信系统控股有限公司	2342 HK	中国香港	中国	357,400	938,178.00	0.41
63	Guangshen Railway Company Limited	广深铁路股份有限公司	525 HK	中国香港	中国	430,000	809,758.03	0.35
64	Lijun International Pharmaceutical (Holding) Co., Ltd.	利君国际医药(控股)有限公司	2005 HK	中国香港	中国	405,000	686,741.33	0.30
65	Agile Property Holdings Limited	雅居乐地产控股有限公司	3383 HK	中国香港	中国	66,000	534,278.88	0.23
66	I.T Ltd.	I.T Limited	999 HK	中国香港	中国	192,000	524,349.50	0.23
67	Bank Of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	中国香港	中国	218,000	522,490.80	0.23
68	XINGDA INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	兴达国际控股有限公司	1899 HK	中国香港	中国	219,000	449,903.61	0.20
69	BOER POWER HOLDINGS	博耳电力控股	1685	中	中	176,000	370,175.10	0.16

	LIMITED	有限公司	HK	国 香 港	国			
70	Foxconn Technology Group	鸿海科技集团	2317 TT	中 国 台 湾	中 国	14,000	265,005.52	0.12
71	Mingyuan Medicare Development Co., Ltd.	铭源医疗发展 有限公司	233 HK	中 国 香 港	中 国	1,190,000	156,188.00	0.07
72	Bank Of Communications Co., Ltd.	交通银行股份 有限公司	3328 HK	中 国 香 港	中 国	30,000	126,929.75	0.06
73	Credit China Holdings Limited	中国信贷控股 有限公司	8207 HK	中 国 香 港	中 国	163,200	77,165.46	0.03

注：所用证券代码采用彭博代码。

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	Air China Limited	753 HK	6,176,804.84	2.97
2	CHINA EVERBRIGHT INTERNATIONAL LIMITED	257 HK	6,176,513.24	2.97
3	CNOOC Limited	883 HK	6,023,667.12	2.90
4	Citic Securities Company Limited	6030 HK	5,986,343.57	2.88
5	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	322 HK	5,905,893.30	2.84
6	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	2318 HK	5,082,028.01	2.45
7	Bank Of China Limited	3988 HK	4,878,287.80	2.35
8	Haitong Securities CO., LTD.	6837 HK	4,699,496.87	2.26
9	AIA Group Limited	1299 HK	4,476,260.23	2.15

10	China Oilfield Services Limited	2883 HK	4,259,805.28	2.05
11	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	2388 HK	4,219,494.06	2.03
12	Skyworth Digital Holdings Limited	751 HK	3,863,900.28	1.86
13	Shandong Chenming Paper Holdings Limited	1812 HK	3,824,013.42	1.84
14	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	3,677,585.31	1.77
15	Tsingtao Brewery Company Limited	168 HK	3,415,268.25	1.64
16	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	3,332,232.73	1.60
17	Techtronic Industries Co. Ltd.	669 HK	3,214,447.04	1.55
18	ZTE Corporation	763 HK	2,874,670.62	1.38
19	Country Garden Holdings Co. Ltd.	2007 HK	2,455,538.02	1.18
20	Global Bio-chem Technology Group Company Limited	809 HK	2,394,913.78	1.15

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

7.5.2 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	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	7,632,710.95	3.67
2	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd.	2601 HK	6,221,628.24	3.00
3	Want Want China Holdings Limited	151 HK	5,142,487.62	2.48
4	Picc Property And Casualty Company Limited.	2328 HK	4,541,408.42	2.19
5	Bank Of China Limited	3988 HK	4,118,642.34	1.98
6	Belle International Holdings Limited	1880 HK	3,944,512.89	1.90

7	China Gas Holdings Limited	384 HK	3,364,815.62	1.62
8	AJISEN (CHINA) HOLDINGS LIMITED	538 HK	3,094,755.04	1.49
9	Hengan International Group Company Limited	1044 HK	2,741,606.14	1.32
10	I. T Ltd.	999 HK	2,472,147.75	1.19
11	FAR EAST HORIZON LIMITED	3360 HK	2,352,035.13	1.13
12	China Merchants Bank Co., Ltd.	3968 HK	2,277,879.13	1.10
13	Ping An Insurance (Group) Company Of China, Ltd.	2318 HK	2,240,271.02	1.08
14	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	2,169,707.61	1.04
15	Anhui Conch Cement Company Limited	914 HK	2,053,695.24	0.99
16	China Southern Airlines Company Limited	1055 HK	1,884,856.14	0.91
17	China Citic Bank Corporation Limited	998 HK	1,741,998.59	0.84
18	China Shineway Pharmaceutical Group Ltd.	2877 HK	1,737,360.63	0.84
19	HTC Corporation	2498 TT	1,718,190.19	0.83
20	Comba Telecom Systems Holdings Ltd.	2342 HK	1,509,139.80	0.73

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

7.5.3 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	120,158,000.17
卖出收入（成交）总额	88,941,053.79

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 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。

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

本基金本报告期末未持有基金。

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 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,761,542.00
4	应收利息	1,426.62
5	应收申购款	15,282.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,778,251.44

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 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
6,510	45,484.52	72,312,010.01	24.42%	223,792,188.64	75.58%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	3,133,000.93	1.0581%

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 100 万份以上；

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（2010 年 9 月 19 日）基金份额总额	740,895,365.72
本报告期期初基金份额总额	268,098,557.57
本报告期基金总申购份额	55,416,752.26
减：本报告期基金总赎回份额	27,411,111.18
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	296,104,198.65

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，本基金管理人发布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、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：

无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

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	

Morgan Stanley & Co. International PLC	-	47,079,364.52	22.51%	25,944.99	22.10%	-
Nomura International Plc.	-	46,106,022.47	22.05%	23,053.01	19.64%	-
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	-	39,932,344.99	19.10%	19,966.18	17.01%	-
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	33,650,053.45	16.09%	16,825.03	14.33%	-
CCB International Securities Limited	-	28,397,159.95	13.58%	14,198.58	12.10%	-
Yuanta Securities Company Limited.	-	5,549,452.60	2.65%	8,324.28	7.09%	-
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	-	4,100,967.36	1.96%	5,973.67	5.09%	-
UBS Securities Asia Limited	-	3,251,435.63	1.55%	1,625.72	1.39%	-
SinoPac Securities Corp.	-	1,044,316.63	0.50%	1,461.77	1.25%	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	-
CLSA Limited	-	-	-	-	-	-
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	-
UOB KayHian HK Ltd	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Asia Limited.	-	-	-	-	-	新增
BMO Nesbitt Burns Inc.	-	-	-	-	-	新增

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

无。

10.8 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	华安基金管理有限公司关于新增财富里昂证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-01-09
2	华安基金管理有限公司关于新增财通证券有限责任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	2012-01-16
3	华安基金管理有限公司关于新增广州银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-02-20
4	关于旗下基金参加广州银行股份有限公司网上申购基金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	2012-02-28
5	关于新增中信（浙江）有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-13
6	华安基金管理有限公司关于华安香港精选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	2012-03-29
7	关于参加中国工商银行开展个人电子银行基金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	2012-03-30
8	关于住所变更公告，住所变更为上海市浦东新区世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-30
9	关于电子直销平台开通“直销转托管”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-04-16
10	关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行申购基金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	2012-04-26
11	关于基金电子交易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	2012-05-02
12	关于旗下部分基金参加华融证券定投及非现场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	2012-06-05
13	华安基金管理有限公司关于华安香港精选股票型证券投资基金因境外主要	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2012-06-27

	市场节假日暂停申购、赎回的公告	和公司网站	
14	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金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	2012-06-29

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。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安香港精选股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安香港精选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安香港精选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；

11.2 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>。

11.3 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
二〇一二年八月二十七日