

# 华安香港精选股票型证券投资基金 2010 年年度报告

2010 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 3 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。

本报告期自 2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)起至 2010 年 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
1.2	目录	3
§ 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
3.3	过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
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	10
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	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	10
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 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	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	审计报告	14
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	19
§ 8	投资组合报告	35
8.1	期末基金资产组合情况	35
8.2	期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	36
8.3	期末按行业分类的权益投资组合	36
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	37
8.5	报告期内权益投资组合的重大变动	42
8.6	期末按债券信用等级分类的债券投资组合	44
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	44
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	44
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	45
8.10	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名基金投资明细	45
8.11	投资组合报告附注	45
§ 9	基金份额持有人信息	45
§ 10	开放式基金份额变动	46

§ 11 重大事件揭示 .....	46
§ 12 备查文件目录 .....	52

## § 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	381,164,290.69 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		上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市浦东南路360号新上海国际大厦2楼、37楼、38楼	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		李劼	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 HongKong 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huaan.com.cn">http://www.huaan.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

### 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有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼
--------	------------	------------------------------------

### § 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	2010 年 9 月 19 日—2010 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-2,108,712.52
本期利润	-13,490,182.76
加权平均基金份额本期利润	-0.0258
本期加权平均净值利润率	-2.60%
本期基金份额净值增长率	-3.80%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末
期末可供分配利润	-14,533,877.67
期末可供分配基金份额利润	-0.0381
期末基金资产净值	366,630,413.02
期末基金份额净值	0.962
3.1.3 累计期末指标	2010 年末
基金份额累计净值增长率	-3.80%

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）。

4、本基金于 2010 年 9 月 19 日成立。合同生效当期不是完整报告期。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

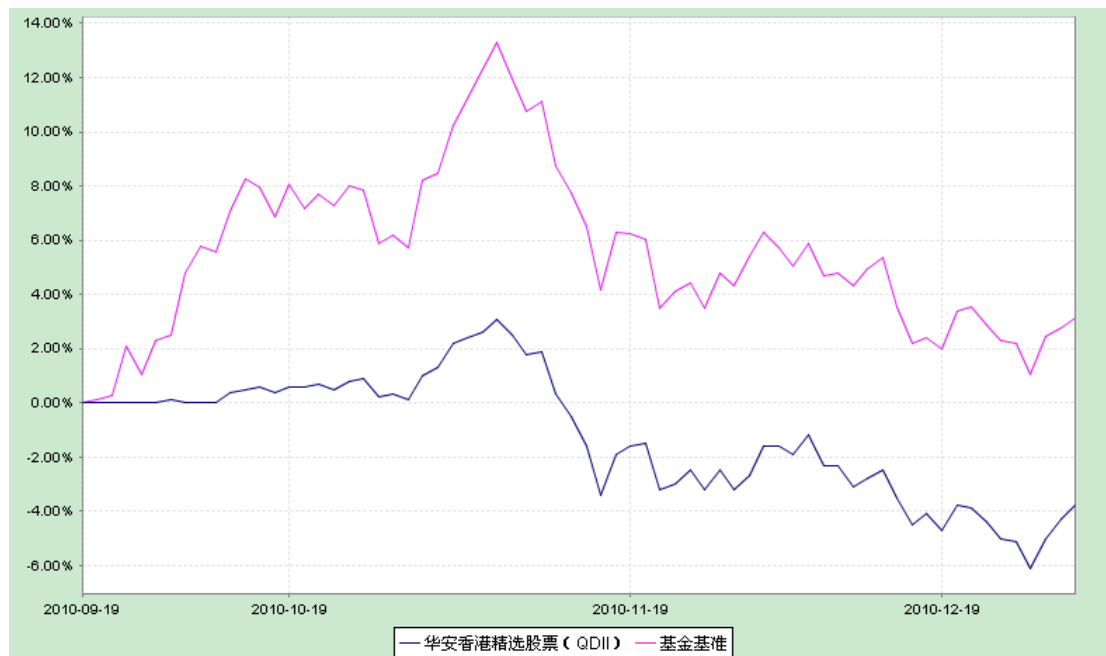
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.90%	0.71%	0.63%	1.08%	-4.53%	-0.37%
自基金合同生效起至今	-3.80%	0.67%	3.13%	1.06%	-6.93%	-0.39%

##### 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

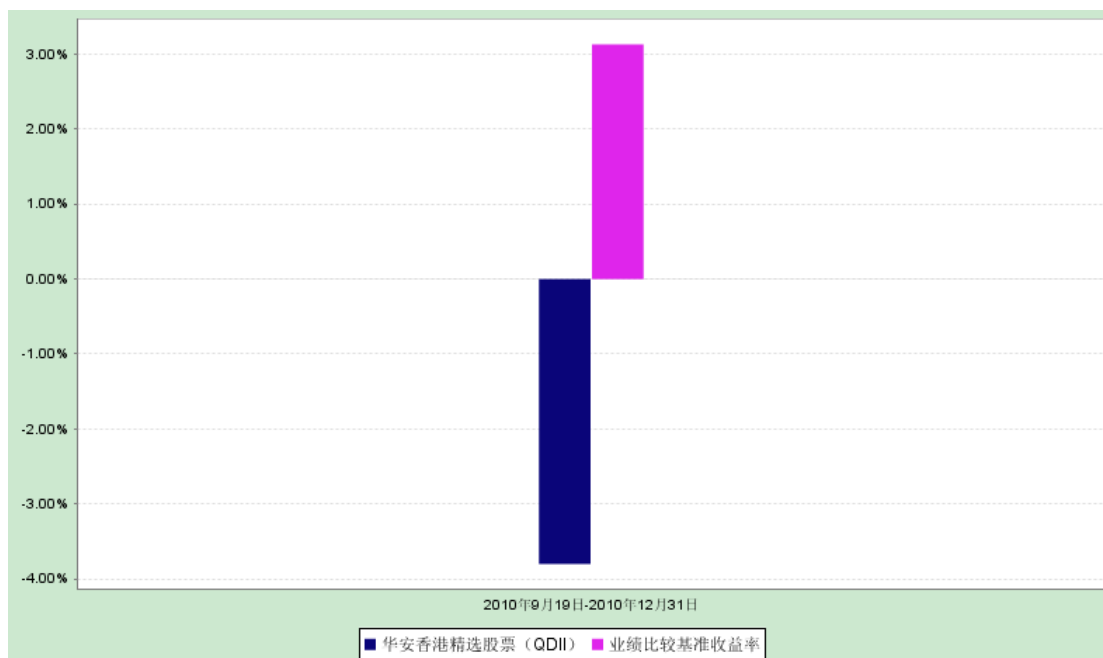
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 9 月 19 日至 2010 年 12 月 31 日)



注：1. 本基金于 2010 年 9 月 19 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。  
2. 根据《华安香港精选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。截至本报告期期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十一部分“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 2010 年 9 月 19 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

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2010 年 12 月 31 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、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、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、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安稳固收益债券等 19 只开放式基金，管理资产规模达到 825.65 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, 全球投资部总经理	2010-9-19	-	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月起担任本基金的基金经理。
苏圻涵	本基金的基金经理	2010-9-19	-	5年	博士研究生, 5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。

注: 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日, 即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安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

本基金投资海外市场为主，报告期内与公司目前旗下其他基金不存在对同一证券公平交易的情况。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金为 QDII 基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

#### 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

2010 年下半年，全球资金由低风险资产向高风险资产流转，成为主导全球资产大类走势的主线。11 月初，被美联储 QE2 人为压低的美国国债收益率由 2.5% 的低点迅速回升至 3.5% 左右的水平，德国国债、英国国债收益率也随同上升，表明大量资金由低风险的国债流出。高风险资产，包括大宗商品、股票、公司债券等均出现显著上涨。

全球股票市场表现出现分化，在美国经济复苏、新兴市场全面紧缩对抗通胀的影响下，发达市场明显跑赢新兴市场。美元期内表现强势，资金有流出新兴市场的迹象，同时由于对中国紧缩政策不确定性的担忧，香港市场表现远远落后于发达市场。行业方面，周期性行业明显跑赢非周期性行业，能源、原材料、工业等涨幅超过大市，消费品、电信、公用事业等弱于大市。

报告期内，基金于 10 月上旬完成建仓，行业配置上，超配受益于大宗商品价格上涨的能源和原材料板块，及工业板块，低配政策压力较大的银行、地产板块，及电信板块。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金单位净值为 0.962 元，累计净值增长率为 -3.80%，同期比较基准的累计收益率为 3.13%，基金净值跑输比较基准 6.93%。

#### 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，我们认为美国经济将持续复苏，但年内可能还难以实行实质性的退出政策，原油价格和粮食价格的持续上升，将进一步推升新兴市场国家的通胀

压力，新兴市场紧缩政策将持续。预期 2011 年上半年，发达市场仍将跑赢新兴市场。

对于 2011 年上半年的港股市场，我们认为将是一个振荡市。向下受到估值的支撑，从估值看，无论纵向或横向比较，目前恒生指数、国企指数 11 年不到 13 倍和 11 倍的 PE 均已低于平均水平 1 个标准差以上，同时相比较 11 年 15%—20% 的 EPS 增长情况，我们认为目前香港估值水平具有吸引力。向上则受到政策紧缩风险的压制，制约市场两大权重板块，银行和地产板块，市场整体难以有好的表现。

基于对整体市场的判断，我们认为从下往上，精选个股将为基金提供超额收益，我们将重点关注，节能环保、新一代信息技术、生物、高端装备制造产业，新能源、新材料、新能源汽车等七大新兴支柱产业，寻求政策不确定性环境下，政策支持和扶植确定的行业与公司。在行业层面，将继续对上游资源类行业，包括能源、原材料进行超配，分享通胀收益。同时，我们认为受益于移动互联网和社区网站的发展，信息技术行业个股存在超额收益。

#### 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，公司合规监察工作从保障基金合规运作、维护基金份额持有人利益出发，对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，在强化员工的合规意识的同时，推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 继续深化“主动合规”的管理理念，落实《合规手册》，规范公司在业务运作、道德规范、反洗钱、利益冲突、客户信息保密、市场营销和客户投诉处理、投资和交易行为等环节的行为；

(2) 由公司督察长牵头与基金经理、投资经理一对一进行合规谈话，要求基金经理和投资经理在投资运作中严格遵守法律法规、基金合同、规章制度的各项规定，严格把握职业操守，坚决不碰“老鼠仓、内幕交易、利益输送”三条底线，并进行了合规考试；

(3) 通过合规培训以强化员工的合规意识和风险控制意识。本报告期内公司组织的合规培训包括：公司及基金行业违规及操作失误案例的合规培训；投资

流程标准化操作培训；防止内幕交易、违规买卖股票和利用未公开信息交易的培训；基金销售合规培训等等；

(4) 按照中国证监会要求，组织投资研究部门对投资、研究、风险管理、投资人员管理等方面进行了一次全面性的自查，自查情况良好，基本达到了中国证监会的监管要求；

(5) 除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察同时，强化了在基金新产品开发过程中的合规支持；

(6) 有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了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本报告期损益的影响：

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、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、金融工程部总经理、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：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任华安安信封闭的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

李炳旺先生，研究生学历，24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信

托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

尚志民，基金投资部总经理，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，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、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、研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部总经理，经济学硕士，13 年银行、基金从业经历。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、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦，金融工程部总经理，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 联接的基金经理，金融工程部总经理。

朱永红，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理有限公司，2010 年 11 月 19 日离职前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

2010 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

2010 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。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 2010 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 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20342 号

华安香港精选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香港精选股票型证券投资基金(以下简称“华安香港精选基金”)的财务报表, 包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日止期间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。

### 一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员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是华安香港精选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) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;
- (2) 选择和运用恰当的会计政策;
- (3) 作出合理的会计估计。

## 二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施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职业道德规范，计划和实施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，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，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。

## 三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华安香港精选基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天  
会计师事务所有限公司

中国·上海市

注册会计师  
汪 棣  
注册会计师  
金 毅  
2011 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日
资 产：		

银行存款	7.4.7.1	57,380,068.64
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	314,900,286.39
其中：股票投资		314,900,286.39
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		787,786.11
应收利息	7.4.7.5	3,693.65
应收股利		98,469.62
应收申购款		131,087.36
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		373,301,391.77
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010年12月31日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		5,869,196.17
应付管理人报酬		484,302.10



应付托管费		96,860.40
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	220,620.08
负债合计		6,670,978.75
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	381,164,290.69
未分配利润	7.4.7.10	-14,533,877.67
所有者权益合计		366,630,413.02
负债和所有者权益总计		373,301,391.77

注:1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值0.962元,基金份额总额381,164,290.69份。

2、本基金于2010年9月19日成立。合同生效当期不是完整报告期。

## 7.2 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: 2010年9月19日(基金合同生效日)至2010年12月31日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2010年9月19日(基金合同生效日)至2010年12月31日
一、收入		-9,441,949.73
1. 利息收入		2,129,469.20
其中: 存款利息收入	7.4.7.11	2,129,469.20
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）		-1,153,255.08
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,168,801.65
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	540,557.21
股利收益	7.4.7.15	474,989.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-11,381,470.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		487,640.90
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	475,665.49
<b>减：二、费用</b>		4,048,233.03
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,296,549.94
2. 托管费	7.4.10.2.2	459,309.94
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,065,905.72
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	226,467.43
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-13,490,182.76
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-13,490,182.76

注：本基金于 2010 年 9 月 19 日成立。合同生效当期不是完整报告期。

### 7.3 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：2010 年 9 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010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）	740,895,365.72	-	740,895,365.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-13,490,182.76	-13,490,182.76
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）	-359,731,075.03	-1,043,694.91	-360,774,769.94
其中：1. 基金申购款	20,061,822.88	-304,099.40	19,757,723.48
2. 基金赎回款	-379,792,897.91	-739,595.51	-380,532,493.42
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）	381,164,290.69	-14,533,877.67	366,630,413.02

注：本基金于 2010 年 9 月 19 日成立。合同生效当期不是完整报告期。

报表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：李炳旺，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 2010 年 3 月 25 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 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日止期间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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日。

##### 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。本基金现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。

#### 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,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。

#### 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。

#### 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由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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；于处置时，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。

#### 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(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相关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，与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。

#### 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

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 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[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。

#### 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	
	2010年12月31日	
活期存款	57,380,068.64	
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	57,380,068.64	

注：于2010年12月31日，活期存款包括人民币活期存款13,374,552.03元，美元活期存款351,522.26元(折合人民币2,328,026.48元)、港币活期存款24,825,082.25元(折合人民币21,124,407.24元)和新台币活期存款90,924,279元(折合人民币20,553,082.89元)。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2010年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	326,281,756.63	314,900,286.39	-11,381,470.24
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	326,281,756.63	314,900,286.39	-11,381,470.24

##### 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 2010年12月31日
应收活期存款利息	3,693.65
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	3,693.65

**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 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	22,120.08
预提费用	198,500.00
合计	220,620.08

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	740,895,365.72	740,895,365.72
本期申购	20,061,822.88	20,061,822.88
本期赎回（以“-”号填列）	-379,792,897.91	-379,792,897.91
本期末	381,164,290.69	381,164,290.69

注：1. 申购含红利再投份额。

2. 本基金自 2010 年 8 月 18 日至 2010 年 9 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 740,818,736.04 元。根据《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 76,629.68 元在

本基金成立后，折算为 76,629.68 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《华安香港精选股票型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于 2010 年 9 月 19 日(基金合同生效日)至 2010 年 10 月 24 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购和赎回业务自 2010 年 10 月 25 日起开始办理。

#### 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-2,108,712.52	-11,381,470.24	-13,490,182.76
本期基金份额交易产生的变动数	-77,674.87	-966,020.04	-1,043,694.91
其中：基金申购款	3,098.45	-307,197.85	-304,099.40
基金赎回款	-80,773.32	-658,822.19	-739,595.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,186,387.39	-12,347,490.28	-14,533,877.67

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
活期存款利息收入	220,657.48
定期存款利息收入	1,908,800.02
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	11.70
合计	2,129,469.20

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日(基金合同生效日)至2010年12月31日
卖出股票成交总额	68,587,392.13
减：卖出股票成本总额	70,756,193.78
买卖股票差价收入	-2,168,801.65

#### 7.4.7.13 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日(基金合同生效日) 至2010年12月31日

权证行权投资收益	540, 557. 21
----------	--------------

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日(基金合同生效日) 至2010年12月31日
股票投资产生的股利收益	474, 989. 36
基金投资产生的股利收益	-
合计	474, 989. 36

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
1. 交易性金融资产	-11, 381, 470. 24
——股票投资	-11, 381, 470. 24
——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	-11, 381, 470. 24

**7.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
基金赎回费收入	475, 665. 49
合计	475, 665. 49

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 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
交易所市场交易费用	1, 065, 905. 72
银行间市场交易费用	-
合计	1, 065, 905. 72

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
审计费用	74,000.00
信息披露费	120,000.00
账户维护费	4,500.00
银行汇划费	2,658.50
其他	25,308.93
合计	226,467.43

#### 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

无。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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”）	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
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 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,296,549.94
其中：支付销售机构的客户维护费	588,354.47

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 × 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 2010年9月19日（基金合同生效日）至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	459,309.94

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 × 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自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2010年9月19日（基金合同生效日） 至2010年12月31日
基金合同生效日（2010年9月19日）持有的基金份额	19,999,000.00
期初持有的基金份额	-
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
期末持有的基金份额	5.25%

占基金总份额比例	
----------	--

注：本基金的基金管理人华安基金管理有限公司在本会计期间认购本基金的交易委托申银万国证券股份有限公司办理，适用费率为 1,000 元/笔。

#### 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 2010 年 9 月 19 日（基金合同生效日）至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	13,374,746.02	220,595.91
香港上海汇丰银行有限公司	44,005,322.62	61.57

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。

#### 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（2010 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
384 HK	中国燃气	10-12-18	重大公告事项	2.88	11-02-01	2.51	2,110,000	8,001,681.99	6,086,617.20	

注：1. 本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2. 期末估值单价和复牌开盘单价为外币价格按照期末估值汇率折算为人民币的价格。

##### 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。

#### 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。

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，因此违约风险不重大。

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 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

#### 7.4.13.3 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。本基金所持分证券均在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余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。

#### 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。

本基金持有的利率敏感性资产为银行存款、结算备付金及部分应收申购款，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	57,380,068.64	-	-	-	57,380,068.64
交易性金融资产	-	-	-	314,900,286.39	314,900,286.39
应收证券清算款	-	-	-	787,786.11	787,786.11
应收利息	-	-	-	3,693.65	3,693.65
应收股利	-	-	-	98,469.62	98,469.62
应收申购款	6,327.42	-	-	124,759.94	131,087.36
<b>资产总计</b>	<b>57,386,396.06</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>315,914,995.71</b>	<b>373,301,391.77</b>
<b>负债</b>					



应付赎回款	-	-	-	5,869,196.17	5,869,196.17
应付管理人报酬	-	-	-	484,302.10	484,302.10
应付托管费	-	-	-	96,860.40	96,860.40
其他负债	-	-	-	220,620.08	220,620.08
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>6,670,978.75</b>	<b>6,670,978.75</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>57,386,396.06</b>	-	-	<b>309,244,016.96</b>	<b>366,630,413.02</b>

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 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。

#### 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 2010 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	新台币 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	2,328,026.48	21,124,407.24	20,553,082.89	44,005,516.61
交易性金融资产	8,744,170.68	306,156,115.71	-	314,900,286.39
应收证券清算款	-	787,786.11	-	787,786.11
应收股利	-	98,469.62	-	98,469.62
资产合计	11,072,197.16	328,166,778.68	20,553,082.89	359,792,058.73
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	11,072,197.16	328,166,778.68	20,553,082.89	359,792,058.73

##### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除该单一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：人民币万元)

	本期末 2010 年 12 月 31 日
所有外币相对人民币升值 5%	增加约 1,799
所有外币相对人民币贬值 5%	下降约 1,799

#### 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。

#### 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 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	314,900,286.39	85.89
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	314,900,286.39	85.89

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响

#### 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

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)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 308,813,669.19 元，属于第二层级的余额为 6,086,617.20 元，无属于第三层级的余额。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级。

(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（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	314,900,286.39	84.36
	其中：普通股	314,900,286.39	84.36
	存托凭证	-	-
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	57,380,068.64	15.37
8	其他各项资产	1,021,036.74	0.27
9	合计	373,301,391.77	100.00

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
中国香港	306,156,115.71	83.51
美国	8,744,170.68	2.39
合计	314,900,286.39	85.89

### 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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
金融	110,364,198.16	30.10
能源	46,100,766.54	12.57
非必需消费品	36,166,793.97	9.86
工业	28,656,467.54	7.82
公用事业	19,312,213.75	5.27
信息技术	18,969,731.43	5.17
材料	17,041,617.66	4.65
电信服务	13,992,063.24	3.82
必需消费品	12,601,064.98	3.44
保健	11,695,369.12	3.19
合计	314,900,286.39	85.89

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**

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(人民 币元)	占基金 资产净 值比例 (%)
1	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港	中国香港	1,275,000	20,006,215.23	5.46
2	China Oilfield Services Limited	中海油田服务股份有限公司	2883 HK	香港	中国香港	908,000	13,011,332.37	3.55
3	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	446,200	12,263,824.40	3.35
4	ENN Energy Holdings Limited	新奥能源控股有限公司	2688 HK	香港	中国香港	574,000	11,380,508.01	3.10
5	Agricultural Bank Of China Limited	中国农业银行股份有限公司	1288 HK	香港	中国香港	3,359,000	11,147,268.09	3.04
6	Yanzhou Coal Mining Company Limited	兖州煤业股份有限公司	1171 HK	香港	中国香港	544,000	10,994,015.60	3.00
7	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	新鸿基地产发展有限公司	16 HK	香港	中国香港	82,000	9,008,115.17	2.46
8	China Unicom (Hong Kong) Limited	中国联合网络通信(香港)股	762 HK	香港	中国香港	948,000	8,970,299.84	2.45

		份有限公司						
9	Bank of China Limited	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港	中国香港	2,570,700	8,968,691.58	2.45
10	China Construction Bank Corporation	中国建设银行股份有限公司	939 HK	香港	中国香港	1,428,450	8,472,111.38	2.31
11	International Mining Machinery Holdings Limited	国际煤机集团	1683 HK	香港	中国香港	1,564,500	8,373,751.11	2.28
12	Bank of Communications Co., Ltd.	交通银行股份有限公司	3328 HK	香港	中国香港	1,254,000	8,355,128.50	2.28
13	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港	中国香港	51,200	7,358,570.34	2.01
14	Zhuzhou CSR Times Electric Co., Ltd	株洲南车时代电气股份有限公司	3898 HK	香港	中国香港	277,000	7,200,867.49	1.96
15	China Merchants Bank Co., Limited	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港	中国香港	430,000	7,178,956.04	1.96
16	Sino-Ocean Land Holdings Ltd.	远洋地产控股有限公司	3377 HK	香港	中国香港	1,595,500	6,910,483.37	1.88
17	China Everbright International Limited	中国光大国际有限公司	257 HK	香港	中国香港	1,984,000	6,888,040.09	1.88
18	China Yurun Food Group Limited	中国雨润食品集团有限公司	1068 HK	香港	中国香港	300,000	6,522,378.45	1.78
19	New World Development Company Limited	新世界发展有限公司	17 HK	香港	中国香港	520,484	6,466,273.57	1.76

20	Alibaba.com Ltd.	阿里巴巴网络有限公司	1688 HK	香港	中国香港	526,000	6,239,393.17	1.70
21	China Gas Holdings Limited	中国燃气控股有限公司	384 HK	香港	中国香港	2,110,000	6,086,617.20	1.66
22	Huabao International Holdings Limited	华宝国际控股有限公司	336 HK	香港	中国香港	553,000	5,919,698.77	1.61
23	The Bank of East Asia, Limited	东亚银行有限公司	23 HK	香港	中国香港	213,200	5,905,164.88	1.61
24	Visionchina Media Inc	华视传媒集团有限公司	VISN US	纳斯达克	美国	191,005	5,869,455.29	1.60
25	Huiyin Household Appliances (Holdings) Co., Ltd.	汇银家电(控股)有限公司	1280 HK	香港	中国香港	3,010,000	5,481,180.50	1.50
26	Hang Seng Bank Limited	恒生银行有限公司	11 HK	香港	中国香港	50,400	5,480,942.24	1.49
27	Comba Telecom Systems Holdings Ltd.	京信通信系统控股有限公司	2342 HK	香港	中国香港	719,000	5,371,767.92	1.47
28	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	72,500	5,361,071.73	1.46
29	Zhongsheng Group Holdings Limited	中升集团控股有限公司	881 HK	香港	中国香港	372,500	5,356,817.08	1.46
30	China Shanshui Cement Group Limited	中国山水水泥集团有限公司	691 HK	香港	中国香港	1,124,000	5,308,271.53	1.45

31	Sinotrans Shipping Ltd.	中外运航运有限公司	368 HK	香港	中国香港	2,077,000	5,196,101.93	1.42
32	Sino Biopharmaceutical Limited	中国生物制药有限公司	1177 HK	香港	中国香港	2,068,000	5,085,600.16	1.39
33	VODone Ltd.	第一视频集团有限公司	82 HK	香港	中国香港	2,480,000	5,064,735.36	1.38
34	China Telecom Corporation Limited	中国电信股份有限公司	728 HK	香港	中国香港	1,450,000	5,021,763.40	1.37
35	Renhe Commercial Holdings Co., Ltd.	人和商业控股有限公司	1387 HK	香港	中国香港	4,268,000	4,939,206.17	1.35
36	Jiangxi Copper Company Limited	江西铜业股份有限公司	358 HK	香港	中国香港	213,000	4,630,888.70	1.26
37	Man Wann Holdings Limited	敏华控股有限公司	1999 HK	香港	中国香港	400,000	4,295,494.64	1.17
38	China Life Insurance Company Limited	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港	中国香港	136,000	3,674,315.74	1.00
39	Lijun International Pharmaceutical (Holding) Co., Ltd.	利君国际医药(控股)有限公司	2005 HK	香港	中国香港	1,850,000	3,573,480.54	0.97
40	Great Eagle Holdings Limited	鹰君集团有限公司	41 HK	香港	中国香港	161,000	3,308,543.48	0.90
41	Vinda International Holdings Limited	维达国际控股有限公司	3331 HK	香港	中国香港	432,000	3,157,699.12	0.86
42	Airmedia Group Inc	航美传媒集团股份	AMCN US	纳斯	美国	63,000	2,874,715.39	0.78



		有限公司		达克				
43	ANTA Sports Products Limited	安踏体育用品有限公司	2020 HK	香港	中国香港	264,000	2,772,125.72	0.76
44	Dongfeng Motor Group Co., Ltd.	东风汽车集团股份有限公司	489 HK	香港	中国香港	234,000	2,668,176.11	0.73
45	China Petroleum and Chemical Corporation	中国石油化工股份有限公司	386 HK	香港	中国香港	330,000	2,089,203.34	0.57
46	BOC Hong Kong (Holdings) Limited	中银香港(控股)有限公司	2388 HK	香港	中国香港	88,000	1,980,624.67	0.54
47	China Resources Power Holdings Company Limited	华润电力控股有限公司	836 HK	香港	中国香港	154,000	1,845,088.54	0.50
48	Daphne International Holdings Limited	达芙妮国际控股有限公司	210 HK	香港	中国香港	288,000	1,784,093.88	0.49
49	Beijing Jingkelong Company Limited	北京客隆商业集团股份有限公司	814 HK	香港	中国香港	189,000	1,656,505.43	0.45
50	Trauson Holdings Company Limited	创生控股有限公司	325 HK	香港	中国香港	532,000	1,652,335.87	0.45
51	Mingyuan Medicare Development Co., Ltd.	铭源医疗发展有限公司	233 HK	香港	中国香港	1,520,000	1,383,952.55	0.38
52	Lianhua Supermarket Holdings Co., Ltd.	联华超市股份有限公司	980 HK	香港	中国香港	40,000	1,264,481.98	0.34

53	China National Building Material Company Limited	中国建材股份有限公司	3323 HK	香港	中国香港	78,000	1,182,758.66	0.32
54	China National Materials Company Limited	中国中材股份有限公司	1893 HK	香港	中国香港	187,000	997,706.92	0.27
55	Chongqing Rural Commercial Bank Co., Ltd.	重庆农村商业银行股份有限公司	3618 HK	香港	中国香港	212,000	943,477.15	0.26

注：所用证券代码采用彭博代码。

## 8.5 报告期内权益投资组合的重大变动

### 8.5.1 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	CNOOC Limited	883 HK	19,220,484.89	5.24
2	China Pacific Insurance (Group) Co., Ltd	2601 HK	12,232,161.95	3.34
3	Agricultural Bank Of China Limited	1288 HK	11,857,237.53	3.23
4	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	11,691,116.91	3.19
5	ENN Energy Holdings Limited	2688 HK	11,686,984.96	3.19
6	China Oilfield Services Limited	2883 HK	10,991,827.79	3.00
7	China Petroleum and Chemical Corporation	386 HK	10,860,916.35	2.96
8	Yanzhou Coal Mining Company Limited	1171 HK	10,203,585.56	2.78
9	New World Development Company Limited	17 HK	9,884,445.72	2.70
10	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	9,816,341.40	2.68
11	Bank of China Limited	3988 HK	9,579,135.42	2.61
12	Bank of Communications Co., Ltd.	3328 HK	9,482,186.34	2.59

13	China Unicom (Hong Kong) Limited	762 HK	9,240,883.13	2.52
14	International Mining Machinery Holdings Limited	1683 HK	9,045,487.46	2.47
15	China Construction Bank Corporation	939 HK	8,753,137.17	2.39
16	China Shipping Development Company Limited	1138 HK	8,460,763.78	2.31
17	China Merchants Bank Co., Limited	3968 HK	8,218,262.05	2.24
18	China Gas Holdings Limited	384 HK	8,001,681.99	2.18
19	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	7,827,554.33	2.13
20	Sino-Ocean Land Holdings Ltd.	3377 HK	7,797,365.90	2.13
21	Tencent Holdings Limited	700 HK	7,775,003.09	2.12
22	China Yurun Food Group Limited	1068 HK	7,661,517.81	2.09

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 Petroleum and Chemical Corporation	386 HK	9,177,383.64	2.50
2	China Shipping Development Company Limited	1138 HK	7,290,777.52	1.99
3	China Mobile Limited	941 HK	6,075,147.09	1.66
4	China Life Insurance Company Limited	2628 HK	5,553,204.08	1.51
5	Uni-President China Holdings Ltd.	220 HK	5,539,481.41	1.51
6	ZHEJIANG EXPRESSWAY CO., LTD.	576 HK	5,269,079.93	1.44
7	Weichai Power Co., Ltd.	2338 HK	4,324,249.71	1.18
8	The United Laboratories International Holdings Limited	3933 HK	3,925,553.78	1.07

9	China Green (Holdings) Limited	904 HK	3,404,624.48	0.93
10	361 Degrees International Limited	1361 HK	2,999,206.59	0.82
11	Daphne International Holdings Limited	210 HK	2,855,286.17	0.78
12	Agile Property Holdings Limited	3383 HK	2,684,505.64	0.73
13	New World Development Company Limited	17 HK	2,641,824.78	0.72
14	Longfor Properties Co., Ltd.	960 HK	2,301,941.70	0.63
15	SUN HUNG KAI PROPERTIES LIMITED	16 HK	2,046,197.57	0.56
16	Ping An Insurance (Group) Company of China, Ltd.	2318 HK	2,022,672.76	0.55
17	ANTA Sports Products Limited	2020 HK	476,255.28	0.13

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

单位：人民币元

买入成本（成交）总额：	397,037,950.41
卖出收入（成交）总额：	68,587,392.13

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

### 8.6 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名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 期末其他各项资产构成

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	787,786.11
3	应收股利	98,469.62
4	应收利息	3,693.65
5	应收申购款	131,087.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,021,036.74

#### 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。

#### 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

(户)	额	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
7,083	53,813.96	50,492,610.84	13.25%	330,671,679.85	86.75%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	6,996,355.08	1.84%

## § 10 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	-
本报告期基金总申购份额	20,061,822.88
减：本报告期基金总赎回份额	379,792,897.91
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	381,164,290.69

## § 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、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

经证监会审批，晏秋生任资产托管部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 11.4 基金投资策略的改变

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 74,000.00 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**

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：**

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	-	181,140,047.37	39.04%	153,384.06	26.79%	新增
China International Capital Corporation (HKS) Ltd	-	87,358,282.53	18.83%	130,861.26	22.85%	新增
Goldman Sachs (Asia) Limited Liability Company	-	74,904,465.82	16.15%	91,271.10	15.94%	新增
Nomura International Plc.	-	53,629,815.22	11.56%	80,444.71	14.05%	新增
CLSA Limited	-	44,859,331.95	9.67%	94,622.95	16.52%	新增
CCB International Securities Limited	-	22,052,846.11	4.75%	22,052.87	3.85%	新增
CMB International Securities Limited	-	-	-	-	-	新增
Deutsche Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	新增
UBS Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	新增
SinoPac Securities Corp.	-	-	-	-	-	新增
Guotai Junan Securities (Hong Kong) Limited	-	-	-	-	-	新增
The Hongkong and Shanghai Banking Corporation Limited	-	-	-	-	-	新增
Mizuho Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	新增
Yuanta Securities Company Limited.	-	-	-	-	-	新增
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	-	-	-	-	-	新增
Merrill Lynch Pierce Fenner & Smith Incorporated	-	-	-	-	-	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

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相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》

研究发展部或基金投资部/市场部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研究发展部或基金投资部/市场部提交的《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。

## 11.8 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	关于华安香港精选股票型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中	2010-8-18



		国证券报》和公司网站	
2	关于华安香港精选股票型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-8-20
3	关于华安香港精选股票型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-8-23
4	关于华安香港精选股票型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-8-31
5	<p>根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》和中国证监会《关于基金管理公司运用固有资金进行基金投资有关事项的通知》的相关规定，现就华安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）运用本公司固有资金投资旗下开放式基金的相关事宜公告如下：</p> <p>华安香港精选股票型证券投资基金（基金代码 040018）募集期为 2010 年 8 月 18 日至 2010 年 9 月 15 日，本公司拟于 2010 年 9 月 15 日通过代销机构认购华安香港精选股票型证券投资基金 2000 万元，认购费 1000 元。</p>	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-9-8
6	关于华安香港精选股票型证券投资基金增加代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-9-9
7	关于新增红塔证券股份有限公司为华安香港精选股票型证券投资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	2010-9-13
8	关于电子直销平台开通“趋势定投”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	2010-9-18
9	关于电子直销平台开通“自动停损”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	2010-9-18

10	<p>华安香港精选股票型证券投资基金基金合同生效公告,经中国证监会证监许可【2010】809 号文批准设立,于 2010 年 8 月 18 日起向全社会公开募集,基金募集工作已于 2010 年 9 月 15 日顺利结束。</p> <p>经普华永道中天会计师事务所有限公司验资,本次募集的净认购金额为 740,818,736.04 元人民币,认购资金在募集期间产生的银行利息共计 76,629.68 元人民币。募集资金已于 2010 年 9 月 17 日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。</p> <p>根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》以及《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》的有关规定,本基金募集符合有关条件,本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续,并于 2010 年 9 月 19 日获书面确认,基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起,本基金管理人开始正式管理本基金。</p>	<p>《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站</p>	2010-9-20
11	<p>关于华安香港精选股票型证券投资基金开放日常申购、赎回与定期定额投资业务的公告</p>	<p>《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站</p>	2010-10-20
12	<p>关于华安香港精选股票型证券投资基金参加中国农业银行股份有限公司定期定额申购费率优惠、网上银行申购费率优惠活动的公告</p>	<p>《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站</p>	2010-10-25
13	<p>关于华安香港精选股票型证券投资基金参加中国工商银行股份有限公司个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告</p>	<p>《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站</p>	2010-10-25
14	<p>关于华安香港精选股票型证券投资基金参加交通银行股份有限公司定期定额申购费率优惠、网上银行申购费率优惠活动的公告</p>	<p>《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站</p>	2010-10-25
15	<p>关于增加华安香港精选股票型证券投资基金参加华夏银行网上银行基金申购费率优惠活动和定期定额申购费率优惠活动的公告</p>	<p>《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站</p>	2010-10-26

16	关于新增华泰证券股份有限公司为华安香港精选股票型证券投资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	2010-10-29
17	关于华安香港精选股票型证券投资基金参加光大银行网银申购和定投申购费率优惠的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-1
18	关于华安香港精选股票型证券投资基金参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动、定期定额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	2010-11-1
19	关于新增华安香港精选股票型证券投资基金参加中国建设银行网上银行、电话银行基金申购费率优惠活动和定期定额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	2010-11-1
20	关于新增日信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	2010-11-1
21	关于新增新时代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	2010-11-26
22	关于电子直销平台开通“天天盈账户”第三方支付业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-29
23	关于设立华安资产管理（香港）有限公司的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-3
24	关于广州分公司办公地址变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-17
25	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	2010-12-23
26	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、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	2010-12-31

27	关于新增温州银行股份有限公司为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	2011-2-9
----	--------------------------	-----------------------------	----------

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](http://www.huaan.com.cn) 上披露。

## § 12 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；

上述文件的存放地点和查阅方式如下：

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>。

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  
2011年3月26日