

**安顺证券投资基金
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 14 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告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 | 信息披露方式 | 5 |
| 2.5 | 其他相关资料 | 6 |
| 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遵规守信情况的说明 | 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遵规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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 | 19 |
| 7 | 投资组合报告 | 33 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况 | 33 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合 | 33 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 34 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动 | 35 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 37 |
| 7.6 | 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 | 37 |
| 7.7 | 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 | 38 |
| 7.8 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 | 38 |
| 7.9 | 投资组合报告附注 | 38 |
| 8 | 基金份额持有人信息 | 39 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 39 |
| 8.2 | 期末上市基金前十名持有人 | 39 |
| 9 | 重大事件揭示 | 40 |
| 9.1 | 基金份额持有人大会决议 | 40 |

| | | |
|------|-----------------------------------|----|
| 9.2 | 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 | 40 |
| 9.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 40 |
| 9.4 | 基金投资策略的改变 | 40 |
| 9.5 | 报告期内改聘会计师事务所情况 | 40 |
| 9.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 41 |
| 9.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 41 |
| 9.8 | 其他重大事件 | 44 |
| 10 | 影响投资者决策的其他重要信息 | 44 |
| 11 | 备查文件目录 | 44 |
| 11.1 | 备查文件目录 | 44 |
| 11.2 | 存放地点 | 44 |
| 11.3 | 查阅方式 | 44 |

2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|----------------|
| 基金名称 | 安顺证券投资基金 |
| 基金简称 | 华安安顺封闭 |
| 基金主代码 | 500009 |
| 交易代码 | 500009 |
| 基金运作方式 | 契约型封闭式 |
| 基金合同生效日 | 1999年6月15日 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,000,000,000份 |
| 基金合同存续期 | 15年 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 1999年6月22日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | <p>本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。</p> <p>本基金主要投资于成长型上市公司，并兼顾对收益型上市公司及债券的投资，从而使投资者在承受一定风险的情况下，有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。</p> |
| 投资策略 | <p>本基金为平衡型基金，兼顾资本利得、红利及利息收入。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的80%，其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的20-50%，股票资产的比例控制在40-80%，现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，60%左右投资于具有良好成长性的上市公司股票，40%左右投资于收益型上市公司股票，在此基础上各自上下浮动10%。</p> <p>本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，在</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期GDP的增长率。</p> <p>本基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定，具有良好分红能力，预期每股收益高于市场平均水平，预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。</p> |
| 业绩比较基准 | - |
| 风险收益特征 | - |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 冯颖 | 张咏东 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-32169999 |
| | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn | zhangyd@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4008850099 | 95559 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层 | 上海市浦东新区银城中路188号 |
| 办公地址 | | 上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层 | 上海市浦东新区银城中路188号 |
| 邮政编码 | | 200120 | 200120 |
| 法定代表人 | | 李勃 | 胡怀邦 |

2.4 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基金管理人互联网网址 | 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 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|---------------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 | 上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼 |

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 | -103,663,007.26 |
| 本期利润 | 104,925,369.23 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0350 |
| 本期加权平均净值利润率 | 3.54% |
| 本期基金份额净值增长率 | 3.69% |
| 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 | -57,192,188.73 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0191 |
| 期末基金资产净值 | 2,942,807,811.27 |
| 期末基金份额净值 | 0.9809 |
| 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 | 629.54% |

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 | ①—③ | ②—④ |
|----|----------|-------------|------------|--------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|----------|---------|-------|---|---|---|---|
| | | | | ④ | | |
| 过去一个月 | -0.81% | 1.97% | - | - | - | - |
| 过去三个月 | 1.67% | 1.69% | - | - | - | - |
| 过去六个月 | 3.69% | 1.76% | - | - | - | - |
| 过去一年 | -9.35% | 1.85% | - | - | - | - |
| 过去三年 | 4.75% | 2.12% | - | - | - | - |
| 自基金成立起至今 | 629.54% | 2.49% | - | - | - | - |

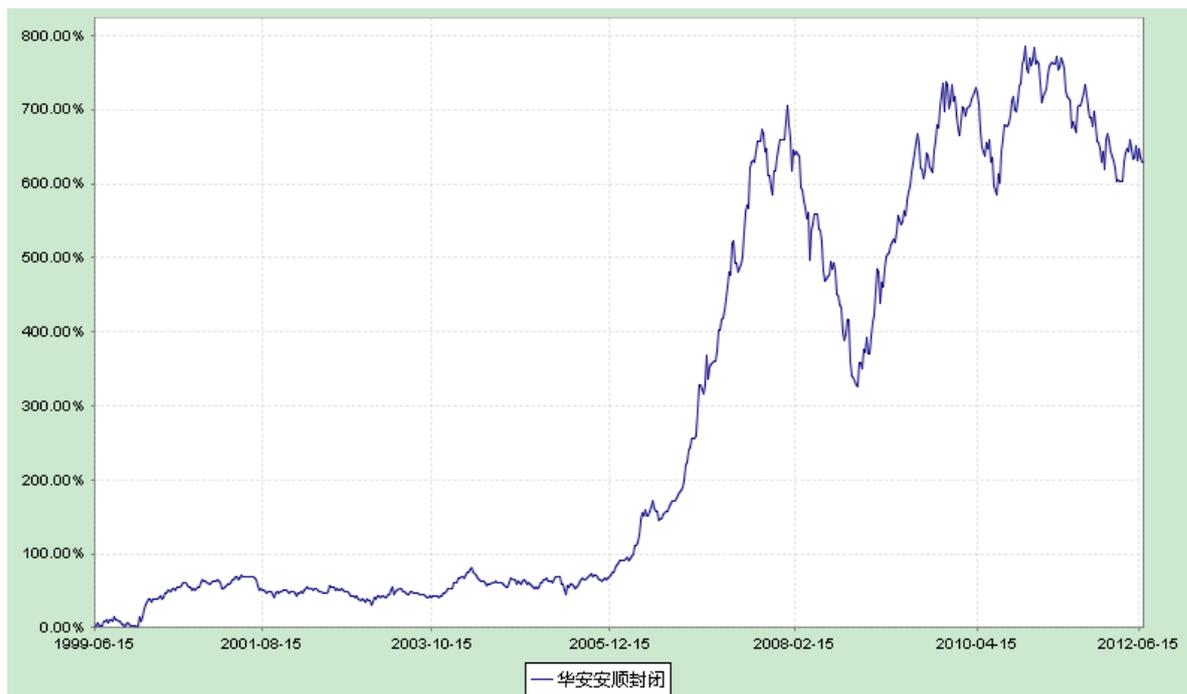
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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

安顺证券投资基金

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

(1999年6月15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 | | |
| 尚志民 | 本基金的基金经理，首席投资官，副总经理 | 2003-09-18 | - | 15 年 | 工商管理硕士，15 年证券、基金从业经验，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，现任公司副总经理，首席投资官。1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理,2003年9月至今担任本基金的基金经理,2006年9月起同时担任华安宏利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《安顺证券投资基金基金合同》、《安顺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，A 股市场冲高回落，上证综指半年涨幅 1.18%，位居全球股市中下游水平。从行业走势看，分化较为明显，涨幅最大的房地产和跌幅最大的信息服务差距接近 30 个百分点。

本基金在上半年一直保持相对高的仓位运作，行业和个股配置主要集中在低估值的一线蓝筹，在涨幅较大的券商、房地产、有色金属等行业配置较少，金融行业主要配置低估值的银行业股票，部分持仓个股下跌较多，本基金在上半年收益为 3.69%。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.9809 元，本报告期份额净值增长率为 3.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从近期公布的经济数据看，中国经济未来进一步超预期下行的可能性很小，经济走势呈“U”型或者“L”形的概率较高。我们预计全年 GDP 约 8%；A 股除金融外上市公司 2012 全年盈利增速-5%；预计通胀将在 7-10 月份超预期下降，为货币政策调整和资源价格改革创造时机，预计后续有继续降息降准可能。

中国经济正在经历必要的调整，主要是工业的短期去库存、中期消化过剩产能、房地产的库存调整、经济内外需结构的调整，这种调整对经济中长期发展而言是良性的，经济将呈现软着陆局面。我们对于中国中长期经济增长前景仍持乐观态度，风险主要来自外部动荡形成对实体经济和金融活动的冲击。

政策强调“把稳增长放在更加重要的位置”，再次选择基建投资作为突破口，推进“十二五”规划重大项目按期实施，启动一批事关全局、带动性强的重大项目。配套措施逐步出台，将有效缓解经济的下滑。本轮保增长的措施有别于 2008 年“四万亿”的刺激政策，以优化结构、提升质量、改善民生为导向，相关行业中存在投资机

会。

通胀下降和去库存之后，企业成本显著下降，毛利将趋稳甚至结构性扩大。在利空消化、后续利多推动之下，三季度中后期有望反弹。

目前股市估值接近底部，本基金在操作上将保持相对积极的仓位结构，目前持仓以低估值大盘蓝筹股、消费股的持仓为主，后期将密切跟踪上市公司业绩，精选个股进行投资，主要布局符合产业政策、有中长期增长潜力的成长股和消费类股票，考虑增加相关行业的配置。

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、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

本基金的基金经理尚志民作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与

确认。

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 年上半年度，托管人在安顺证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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 年上半年度，华安基金管理有限公司在安顺证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012 年上半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关安

安顺证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：安顺证券投资基金

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 | 26,668,263.36 | 1,269,872.42 |
| 结算备付金 | | 5,150,008.97 | 11,359,890.92 |
| 存出保证金 | | 1,154,785.20 | 1,325,036.57 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,893,036,346.07 | 2,812,466,649.63 |
| 其中：股票投资 | | 2,299,735,441.27 | 2,240,763,775.13 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 593,300,904.80 | 571,702,874.50 |
| 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 | | 9,327,184.18 | 16,229,825.49 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 14,693,082.17 | 8,118,017.36 |
| 应收股利 | | 39,600.00 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | 0.00 | - |
| 资产总计 | | 2,950,069,269.95 | 2,850,769,292.39 |
| 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 | | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | 5,802,004.81 |
| 应付赎回款 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|------------------|
| 应付管理人报酬 | | 3,661,468.83 | 3,650,277.34 |
| 应付托管费 | | 610,244.80 | 608,379.57 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 1,806,082.33 | 1,505,288.63 |
| 应交税费 | | 58,900.00 | 58,900.00 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 1,124,762.72 | 1,262,000.00 |
| 负债合计 | | 7,261,458.68 | 12,886,850.35 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -57,192,188.73 | -162,117,557.96 |
| 所有者权益合计 | | 2,942,807,811.27 | 2,837,882,442.04 |
| 负债和所有者权益总计 | | 2,950,069,269.95 | 2,850,769,292.39 |

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9809 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：安顺证券投资基金

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 | | 137,258,755.98 | -201,349,883.40 |
| 1. 利息收入 | | 11,187,047.23 | 13,444,032.98 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 465,385.85 | 965,831.49 |
| 债券利息收入 | | 10,721,661.38 | 12,478,201.49 |
| 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） | | -82,516,667.74 | 142,131,128.77 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -116,572,680.50 | 131,271,424.15 |

| | | | |
|---------------------------------|--------------|-----------------------|------------------------|
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.1 3 | -558,446.75 | -5,277,245.95 |
| 资产支持证券投资 收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.1 4 | 34,614,459.51 | 16,136,950.57 |
| 3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列） | 6.4.7.1 5 | 208,588,376.49 | -356,925,045.15 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-” 号填列） | | - | - |
| 减：二、费用 | | 32,333,386.75 | 45,566,471.09 |
| 1. 管理人报酬 | | 22,090,304.87 | 27,059,756.33 |
| 2. 托管费 | | 3,681,717.42 | 4,511,355.15 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.1 6 | 6,323,452.39 | 13,112,535.91 |
| 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 7 | 237,912.07 | 882,823.70 |
| 三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列） | | 104,925,369.23 | -246,916,354.49 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-” 号填列） | | 104,925,369.23 | -246,916,354.49 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安顺证券投资基金

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) | 3,000,000,000.00 | -162,117,557.96 | 2,837,882,442.04 |

| | | | |
|--|---------------------------------|------------------|------------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 104,925,369.23 | 104,925,369.23 |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | 3,000,000,000.00 | -57,192,188.73 | 2,942,807,811.27 |
| 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) | 3,000,000,000.00 | 1,123,132,482.86 | 4,123,132,482.86 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -246,916,354.49 | -246,916,354.49 |
| 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) | - | - | - |
| 其中：1. 基金申购款 | - | - | - |
| 2. 基金赎回款 | - | - | - |
| 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) | - | -630,000,000.00 | -630,000,000.00 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 3,000,000,000.00 | 246,216,128.37 | 3,246,216,128.37 |

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：李劼，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

安顺证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司、上海国际信托投资公司(后更名为上海国际信托有限公司)、山东证券有限责任公司(后更名为天同证券有限责任公司)和浙江证券有限责任公司(后更名为方正证券有限责任公司)四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安顺证券投资基金基金契约》(后更名为《安顺证券投资基金基金合同》)发起,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字(1999)15号文批准,于1999年6月15日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期15年,发行规模为30亿份基金份额。

本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1999)第36号文审核同意,于1999年6月22日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字(1999)15号文的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中,投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。

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》、《安顺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年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映

了本基金 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 本报告期所采取的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表一致。

6.4.5 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55 号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、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) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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 | 26,668,263.36 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 26,668,263.36 |

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 | | 2,311,722,209.27 | 2,299,735,441.27 | -11,986,768.00 |
| 债券 | 交易所市场 | 34,455,686.92 | 34,666,904.80 | 211,217.88 |
| | 银行间市场 | 557,715,344.29 | 558,634,000.00 | 918,655.71 |
| | 合计 | 592,171,031.21 | 593,300,904.80 | 1,129,873.59 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 2,903,893,240.48 | 2,893,036,346.07 | -10,856,894.41 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末衍生金融资产/负债余额均为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2012年6月30日）买入返售金融资产余额为零。

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 | 5,060.30 |
| 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 | 11,339.48 |
| 应收债券利息 | 14,676,682.39 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 14,693,082.17 |

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |

| | |
|----|---|
| 合计 | - |
|----|---|

注：本期其他资产余额为 0。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2012 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,803,907.33 |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,175.00 |
| 合计 | 1,806,082.33 |

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 | 750,000.00 |
| 应付赎回费 | - |
| 应付后端申购费 | - |
| 债券利息税 | - |
| 预提费用 | 344,762.72 |
| 银行手续费 | - |
| 其他 | 30,000.00 |
| 合计 | 1,124,762.72 |

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 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |

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 | 57,327,712.94 | -219,445,270.90 | -162,117,557.96 |
| 本期利润 | -103,663,007.26 | 208,588,376.49 | 104,925,369.23 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | - | - | - |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |

| | | | |
|---------|----------------|----------------|----------------|
| 基金赎回款 | - | - | - |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -46,335,294.32 | -10,856,894.41 | -57,192,188.73 |

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 | 39,486.65 | |
| 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 | 425,899.20 | |
| 其他 | - | |
| 合计 | 465,385.85 | |

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 | 2,072,684,079.55 | |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,189,256,760.05 | |
| 买卖股票差价收入 | -116,572,680.50 | |

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | |
|------------------------|----------------------------|--|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 369,867,780.54 | |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 361,870,310.33 | |
| 减：应收利息总额 | 8,555,916.96 | |
| 债券投资收益 | -558,446.75 | |

6.4.7.14 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 | 34,614,459.51 | |
| 基金投资产生的股利收益 | - | |
| 合计 | 34,614,459.51 | |

6.4.7.15 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 | 208,588,376.49 |
| ——股票投资 | 210,161,157.07 |
| ——债券投资 | -1,572,780.58 |
| ——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 | 208,588,376.49 |

6.4.7.16 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 | 6,320,202.39 |
| 银行间市场交易费用 | 3,250.00 |
| 合计 | 6,323,452.39 |

6.4.7.17 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 | 45,749.34 |
| 信息披露费 | 149,178.12 |
| 上市年费 | 29,835.26 |
| 帐户维护费 | 9,000.00 |
| 其他费用 | 1,500.00 |
| 银行汇划费用 | 2,649.35 |
| 合计 | 237,912.07 |

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

本报告期关联方关系未发生变化。

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(“华安基金公司”) | 基金发起人、基金管理人 |
| 交通银行股份有限公司(“交通银行”) | 基金托管人 |
| 方正证券有限责任公司(“方正证券”) | 基金发起人 |
| 上海国际信托有限公司(“上海国际信托”) | 基金发起人、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。

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

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

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 | 22,090,304.87 | 27,059,756.33 |

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 × 1.5% / 当年天数。如持有现金比例高于基金资产净值的 20%（由于卖出回购证券和现金分红的原因造成可以除外），超出部分不计提基金管理人报酬。

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 | 3,681,717.42 | 4,511,355.15 |

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 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 0.25% / 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

单位：人民币元

| 本期 2012年1月1日至2012年6月30日 | | | | | | |
|---------------------------------|-------------------|-------------------|-------|------|-------|------|
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 交通银行 | 40,519,974 .26 | 10,184,743 .50 | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日 | | | | | | |
| 银行间市场 交易的各关 联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 交通银行 | 83,107,890 .41 | - | - | - | - | - |

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 | 24,325,003.00 |
| 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 | 24,325,003.00 | 24,325,003.00 |
| 期末持有的基金份额占 基金总份额比例 | 0.81% | 0.81% |

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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2012年6月30日 | | 上年度末 2011年12月31日 | |
|-------|-------------------|------------------------------|---------------------|------------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金 份额占基金 总份额的比 例 |
| | | | | |

| | | | | |
|------------|--------------|-------|--------------|-------|
| 上海国际信托有限公司 | 3,750,000.00 | 0.13% | 3,750,000.00 | 0.13% |
| 方正证券 | 3,750,000.00 | 0.13% | 3,750,000.00 | 0.13% |

注：以上信息摘自中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的截至 2012 年 06 月 30 日安顺证券投资基金持有人名册。

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 |
| 交通银行 | 26,668,263.36 | 39,486.65 | 11,346,337.16 | 78,002.50 |

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2012 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2011 年 06 月 30 日：同）。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本期未进行利润分配。

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

本报告期内本基金未持有流通受限债券以及其他证券类别。

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

截至本报告期末 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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型证券投资基金，属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。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。

本基金的基金管理人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交通银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种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：本基金未持有信用类债券）。

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。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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。

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 | | | | | |
| 资产 | - | - | - | - | - |
| 银行存款 | 26,668,263.36 | - | - | - | 26,668,263.36 |
| 结算备付金 | 5,150,008.97 | - | - | - | 5,150,008.97 |
| 存出保证金 | - | - | - | 1,154,785.20 | 1,154,785.20 |
| 交易性金融资产 | 376,306,000.00 | 168,187,576.80 | 48,807,328.00 | 2,299,735,441.27 | 2,893,036,346.07 |
| 应收利息- | - | - | - | 14,693,082.17 | 14,693,082.17 |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|------------------|
| 应收证券清算款 | - | - | - | 9,327,184.18 | 9,327,184.18 |
| 应收股利 | - | - | - | 39,600.00 | 39,600.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 408,124,272.33 | 168,187,576.80 | 48,807,328.00 | 2,324,950,092.82 | 2,950,069,269.95 |
| 负债 | | | | | |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 3,661,468.83 | 3,661,468.83 |
| 应付托管费 | - | - | - | 610,244.80 | 610,244.80 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,806,082.33 | 1,806,082.33 |
| 应交税费 | - | - | - | 58,900.00 | 58,900.00 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,124,762.72 | 1,124,762.72 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 负债总计 | - | - | - | 7,261,458.68 | 7,261,458.68 |
| 利率敏感度缺口 | 408,124,272.33 | 168,187,576.80 | 48,807,328.00 | 2,317,688,634.14 | 2,942,807,811.27 |
| 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 | | | | | |
| 资产 | - | - | - | - | - |
| 银行存款 | 1,269,872.42 | - | - | - | 1,269,872.42 |
| 结算备付金 | 11,359,890.92 | - | - | - | 11,359,890.92 |
| 存出保证金 | 103,913.63 | - | - | 1,221,122.94 | 1,325,036.57 |
| 交易性金融资产 | 494,813,430.50 | 27,682,010.40 | 49,207,433.60 | 2,240,763,775.13 | 2,812,466,649.63 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - |
| 应收证券 | - | - | - | 16,229,825.49 | 16,229,825.49 |

| | | | | | |
|---------|----------------|---------------|---------------|------------------|------------------|
| 清算款 | | | | | |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收利息 | - | - | - | 8,118,017.36 | 8,118,017.36 |
| 资产总计 | 507,547,107.47 | 27,682,010.40 | 49,207,433.60 | 2,266,332,740.92 | 2,850,769,292.39 |
| 负债 | | | | | |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 3,650,277.34 | 3,650,277.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 608,379.57 | 608,379.57 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 1,505,288.63 | 1,505,288.63 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 1,320,900.00 | 1,320,900.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 5,802,004.81 | 5,802,004.81 |
| 负债总计 | - | - | - | 12,886,850.35 | 12,886,850.35 |
| 利率敏感度缺口 | 507,547,107.47 | 27,682,010.40 | 49,207,433.60 | 2,253,445,890.57 | 2,837,882,442.04 |

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予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利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 |
| | 市场利率下降25个基点 | 增加约82万元 | 增加约89万元 |
| | 市场利率上升25个基点 | 减少约79万元 | 减少约80万元 |

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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，投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。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 | 2,299,735,441.27 | 78.15 | 2,240,763,775.13 | 78.96 |
| 衍生金融资产-权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,299,735,441.27 | 78.15 | 2,240,763,775.13 | 78.96 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|----|--|----------------------------|
| 假设 | 除“中信标普300指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”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 |
|---|------------------------|--------------------------|
| “中标300指数×75%+ 中信国债指数×20%+ 金融同业存款利率 ×5%” 上升5% | 增加约14,255万元 | 增加约13,066万元 |
| “中标300指数×75%+ 中信国债指数×20%+ 金融同业存款利率 ×5%” 下降5% | 减少约14,255万元 | 减少约13,066万元 |

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 | 2,299,735,441.27 | 77.96 |
| | 其中：股票 | 2,299,735,441.27 | 77.96 |
| 2 | 固定收益投资 | 593,300,904.80 | 20.11 |
| | 其中：债券 | 593,300,904.80 | 20.11 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 3 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 4 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售 金融资产 | - | - |
| 5 | 银行存款和结算备付金合计 | 31,818,272.33 | 1.08 |
| 6 | 其他各项资产 | 25,214,651.55 | 0.85 |
| 7 | 合计 | 2,950,069,269.95 | 100.00 |

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------|---------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |

| | | | |
|-----|----------------|------------------|-------|
| B | 采掘业 | 160,569,300.80 | 5.46 |
| C | 制造业 | 1,245,785,505.47 | 42.33 |
| C0 | 食品、饮料 | 234,361,414.50 | 7.96 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 192,614,762.23 | 6.55 |
| C5 | 电子 | 87,043,871.37 | 2.96 |
| C6 | 金属、非金属 | 97,170,713.42 | 3.30 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 348,237,826.04 | 11.83 |
| C8 | 医药、生物制品 | 286,356,917.91 | 9.73 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 21,659,607.83 | 0.74 |
| E | 建筑业 | 46,159,769.20 | 1.57 |
| F | 交通运输、仓储业 | 63,700,703.00 | 2.16 |
| G | 信息技术业 | 89,960,805.79 | 3.06 |
| H | 批发和零售贸易 | 72,173,340.84 | 2.45 |
| I | 金融、保险业 | 368,043,542.14 | 12.51 |
| J | 房地产业 | 79,468,873.20 | 2.70 |
| K | 社会服务业 | 152,213,993.00 | 5.17 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | - | - |
| | 合计 | 2,299,735,441.27 | 78.15 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|------------|----------------|--------------|
| 1 | 002001 | 新和成 | 8,477,707 | 179,133,948.91 | 6.09 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 699,000 | 167,165,850.00 | 5.68 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 3,559,900 | 162,829,826.00 | 5.53 |
| 4 | 601088 | 中国神华 | 7,139,960 | 160,506,300.80 | 5.45 |
| 5 | 002573 | 国电清新 | 6,999,905 | 125,998,290.00 | 4.28 |
| 6 | 600016 | 民生银行 | 20,999,986 | 125,789,916.14 | 4.27 |
| 7 | 600104 | 上汽集团 | 7,990,000 | 114,177,100.00 | 3.88 |
| 8 | 600196 | 复星医药 | 10,399,900 | 107,222,969.00 | 3.64 |
| 9 | 002250 | 联化科技 | 5,999,999 | 103,499,982.75 | 3.52 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 10 | 600585 | 海螺水泥 | 5,990,000 | 88,771,800.00 | 3.02 |
| 11 | 600060 | 海信电器 | 5,177,777 | 87,038,431.37 | 2.96 |
| 12 | 002152 | 广电运通 | 5,199,921 | 85,798,696.50 | 2.92 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 3,999,980 | 83,399,583.00 | 2.83 |
| 14 | 600048 | 保利地产 | 6,999,980 | 79,379,773.20 | 2.70 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 6,000,000 | 77,880,000.00 | 2.65 |
| 16 | 600858 | 银座股份 | 6,099,978 | 71,857,740.84 | 2.44 |
| 17 | 600406 | 国电南瑞 | 3,669,991 | 68,592,131.79 | 2.33 |
| 18 | 300146 | 汤臣倍健 | 1,000,000 | 67,170,000.00 | 2.28 |
| 19 | 600009 | 上海机场 | 5,000,000 | 63,700,000.00 | 2.16 |
| 20 | 000157 | 中联重科 | 5,990,000 | 60,079,700.00 | 2.04 |
| 21 | 002450 | 康得新 | 2,999,928 | 47,728,854.48 | 1.62 |
| 22 | 600970 | 中材国际 | 3,999,980 | 46,159,769.20 | 1.57 |
| 23 | 600309 | 烟台万华 | 3,099,900 | 41,383,665.00 | 1.41 |
| 24 | 600101 | 明星电力 | 1,999,901 | 21,658,927.83 | 0.74 |
| 25 | 300144 | 宋城股份 | 1,000,000 | 14,360,000.00 | 0.49 |
| 26 | 300182 | 捷成股份 | 580,330 | 13,637,755.00 | 0.46 |
| 27 | 300190 | 维尔利 | 536,700 | 11,855,703.00 | 0.40 |
| 28 | 002368 | 太极股份 | 459,900 | 7,730,919.00 | 0.26 |
| 29 | 300064 | 豫金刚石 | 1,009,949 | 7,655,413.42 | 0.26 |
| 30 | 300195 | 长荣股份 | 186,658 | 4,597,386.54 | 0.16 |
| 31 | 000001 | 深发展 A | 80,000 | 1,212,800.00 | 0.04 |
| 32 | 300328 | 宜安科技 | 50,000 | 743,500.00 | 0.03 |
| 33 | 002251 | 步步高 | 10,000 | 244,000.00 | 0.01 |
| 34 | 601601 | 中国太保 | 10,000 | 221,800.00 | 0.01 |
| 35 | 002658 | 雪迪龙 | 8,000 | 185,360.00 | 0.01 |
| 36 | 600036 | 招商银行 | 10,000 | 109,200.00 | 0.00 |
| 37 | 000002 | 万科 A | 10,000 | 89,100.00 | 0.00 |
| 38 | 600153 | 建发股份 | 10,000 | 71,600.00 | 0.00 |
| 39 | 600028 | 中国石化 | 10,000 | 63,000.00 | 0.00 |
| 40 | 002304 | 洋河股份 | 190 | 25,564.50 | 0.00 |
| 41 | 002415 | 海康威视 | 200 | 5,440.00 | 0.00 |
| 42 | 002037 | 久联发展 | 100 | 2,260.00 | 0.00 |
| 43 | 601006 | 大秦铁路 | 100 | 703.00 | 0.00 |
| 44 | 600900 | 长江电力 | 100 | 680.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金 |
|----|------|------|----------|-------|
|----|------|------|----------|-------|

| | | | | 资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|----------------|------------|
| 1 | 000527 | 美的电器 | 173,823,883.17 | 6.13 |
| 2 | 000157 | 中联重科 | 170,045,219.16 | 5.99 |
| 3 | 002573 | 国电清新 | 152,716,705.29 | 5.38 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 147,056,606.83 | 5.18 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 138,704,114.95 | 4.89 |
| 6 | 601288 | 农业银行 | 132,330,440.00 | 4.66 |
| 7 | 600196 | 复星医药 | 101,742,952.11 | 3.59 |
| 8 | 600060 | 海信电器 | 90,380,338.01 | 3.18 |
| 9 | 600104 | 上汽集团 | 88,466,554.34 | 3.12 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 79,981,160.68 | 2.82 |
| 11 | 600406 | 国电南瑞 | 69,899,198.78 | 2.46 |
| 12 | 600858 | 银座股份 | 69,394,702.11 | 2.45 |
| 13 | 002073 | 软控股份 | 63,543,368.90 | 2.24 |
| 14 | 601088 | 中国神华 | 54,441,940.60 | 1.92 |
| 15 | 002450 | 康得新 | 47,032,079.28 | 1.66 |
| 16 | 000651 | 格力电器 | 43,872,574.64 | 1.55 |
| 17 | 601333 | 广深铁路 | 43,218,951.05 | 1.52 |
| 18 | 600875 | 东方电气 | 38,576,722.38 | 1.36 |
| 19 | 600016 | 民生银行 | 35,404,000.00 | 1.25 |
| 20 | 002250 | 联化科技 | 33,894,025.78 | 1.19 |

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|-------|----------------|-----------------|
| 1 | 600028 | 中国石化 | 184,582,095.30 | 6.50 |
| 2 | 002024 | 苏宁电器 | 166,628,417.28 | 5.87 |
| 3 | 000527 | 美的电器 | 151,512,711.52 | 5.34 |
| 4 | 601333 | 广深铁路 | 144,760,424.47 | 5.10 |
| 5 | 601288 | 农业银行 | 131,587,388.80 | 4.64 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 130,902,006.49 | 4.61 |
| 7 | 000157 | 中联重科 | 115,176,627.11 | 4.06 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 100,877,073.11 | 3.55 |
| 9 | 002073 | 软控股份 | 80,480,235.80 | 2.84 |
| 10 | 600153 | 建发股份 | 77,709,968.89 | 2.74 |
| 11 | 600104 | 上汽集团 | 72,702,276.99 | 2.56 |
| 12 | 000001 | 深发展 A | 68,012,902.02 | 2.40 |
| 13 | 601088 | 中国神华 | 55,255,037.87 | 1.95 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 14 | 002038 | 双鹭药业 | 54,425,023.79 | 1.92 |
| 15 | 601166 | 兴业银行 | 53,150,811.34 | 1.87 |
| 16 | 002573 | 国电清新 | 50,541,007.67 | 1.78 |
| 17 | 000651 | 格力电器 | 48,212,518.79 | 1.70 |
| 18 | 002037 | 久联发展 | 43,326,796.15 | 1.53 |
| 19 | 600875 | 东方电气 | 39,151,508.03 | 1.38 |
| 20 | 601006 | 大秦铁路 | 38,374,147.10 | 1.35 |

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---------------|------------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 2,038,067,269.12 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 2,072,684,079.55 |

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 134,706,904.80 | 4.58 |
| 2 | 央行票据 | 265,969,000.00 | 9.04 |
| 3 | 金融债券 | 192,625,000.00 | 6.55 |
| | 其中：政策性金融债 | 192,625,000.00 | 6.55 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债 | - | - |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 593,300,904.80 | 20.16 |

7.6 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|---------|------------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 1001060 | 10 央票 60 | 1,200,000 | 120,000,000.00 | 4.08 |
| 2 | 110018 | 11 付息国债 18 | 1,000,000 | 100,040,000.00 | 3.40 |

| | | | | | |
|---|---------|----------|---------|---------------|------|
| 3 | 1101088 | 11 央票 88 | 600,000 | 58,146,000.00 | 1.98 |
| 4 | 070219 | 07 国开 19 | 500,000 | 50,150,000.00 | 1.70 |
| 5 | 070220 | 07 国开 20 | 500,000 | 50,090,000.00 | 1.70 |

7.7 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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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的，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。

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

7.9.3 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 | 1,154,785.20 |
| 2 | 应收证券清算款 | 9,327,184.18 |
| 3 | 应收股利 | 39,600.00 |
| 4 | 应收利息 | 14,693,082.17 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,214,651.55 |

7.9.4 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。

7.9.5 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不存在流通受限的股票。

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 |
| 52,935 | 56,673.28 | 1,487,737,377.00 | 49.59% | 1,512,262,623.00 | 50.41% |

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 | 中国人寿保险（集团）公司 | 284,280,761 | 9.48% |
| 2 | 中国人寿保险股份有限公司 | 242,859,509 | 8.10% |
| 3 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 130,795,756 | 4.36% |
| 4 | 新华人寿保险股份有限公司 | 88,671,288 | 2.96% |
| 5 | 太平人寿保险有限公司 | 69,155,549 | 2.31% |
| 6 | 嘉禾人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 64,820,777 | 2.16% |
| 7 | 中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—013C—CT001 沪 | 57,651,514 | 1.92% |
| 8 | 中国人寿保险股份有限公司 | 57,140,423 | 1.90% |
| 9 | 信诚人寿保险有限公司 | 55,337,146 | 1.84% |
| 10 | 宝钢集团有限公司 | 43,961,500 | 1.47% |

9 重大事件揭示

9.1 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

9.2 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、基金托管人交通银行于 2012 年 5 月 28 日公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》，交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。具体内容请参阅在 2012 年 5 月 30 日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

9.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

9.5 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基金审计的会计师事务所。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

9.7.1 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 | |
| 中信建投证券有限责任公司 | 2 | 1,409,784,264.08 | 34.38% | 1,196,003.23 | 34.65% | - |
| 东方证券股份有限公司 | 2 | 782,412,638.29 | 19.08% | 646,524.75 | 18.73% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 738,022,880.41 | 18.00% | 622,806.77 | 18.05% | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 429,147,685.92 | 10.46% | 364,775.65 | 10.57% | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | 1 | 288,285,390.51 | 7.03% | 245,485.70 | 7.11% | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2 | 222,625,929.27 | 5.43% | 180,884.43 | 5.24% | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 154,365,550.47 | 3.76% | 131,210.06 | 3.80% | - |

| | | | | | | |
|------------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 股份有限公司 | | | | | | |
| 中国国际金融有限公司 | 1 | 41,129,136.64 | 1.00% | 34,959.57 | 1.01% | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 35,328,198.68 | 0.86% | 28,704.53 | 0.83% | - |

9.7.2 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 | |
|--------------|---------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 中信建投证券有限责任公司 | 81,748,203.20 | 46.08% | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 46,229,922.60 | 26.06% | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 北京高华证券有限责任公司 | - | - | - | - | - | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | 49,428,301.80 | 27.86% | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|
| 公司 | | | | | | |
|----|--|--|--|--|--|--|

注：1. 券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 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；

(3) 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；

(4) 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。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

9.8 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 |

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。

10 影响投资者决策的其他重要信息

无。

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《安顺证券投资基金基金合同》
- 2、《安顺证券投资基金招募说明书》
- 3、《安顺证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准安顺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;

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