安顺证券投资基金

2012 年度报告摘要

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:二〇一三年三月二十七日

§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2013年3月11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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	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。 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。
投资策略	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%。 本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好,在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。 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。
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	裴学敏
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zh_jjb@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701262

2.4 信息披露方式

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

§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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-167,389,784.90	-4,467,048.90	507,503,074.13
本期利润	189,986,913.00	-655,250,040.82	105,039,229.55
加权平均基金份额本期利润	0.0633	-0.2184	0.0350
本期基金份额净值增长率	6.69%	-18.72%	3.79%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0367	-0.0540	0.2306
期末基金资产净值	3,027,869,355.04	2,837,882,442.04	4,123,132,482.86
期末基金份额净值	1.0093	0.9460	1.3744

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
过去三个月	5.92%	2.49%	-	-	-	-
过去六个月	2.90%	2.27%	-	-	-	-
过去一年	6.69%	2.01%	-	-	-	-
过去三年	-10.00%	2.05%	-	-	-	-
过去五年	-1.25%	2.63%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	650.66%	2.48%	-	-	-	-

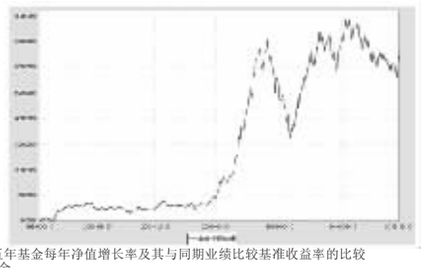
注:本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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

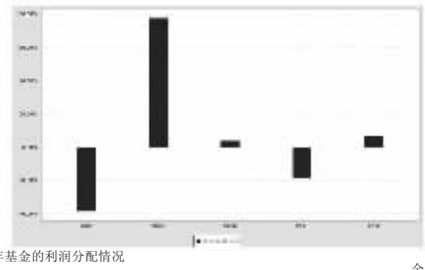
(1999年6月15日至2012年12月31日)



3.2.3 过去五年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

安顺证券投资基金

过去五年净值增长率图



3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2012年	-	-	-	-	-
2011年	2.100	630,000,000.00	-	630,000,000.00	-
2010年	6.000	1,800,000,000.00	-	1,800,000,000.00	-
合计	8.100	2,430,000,000.00	-	2,430,000,000.00	-

§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、华安安利股票、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、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券等34只开放式基金。管理资产规模达到955.90亿元人民币。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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,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《安顺证券投资基金基金合同》等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1)交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2)交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3)银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的Iwind群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息(如:中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共出现了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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年,A股市场走势可谓跌宕起伏,年初市场在对经济见底、周期向上的预期下走出了较强的反弹,但在4月份工业增加值公布后市场对经济短期见底的期望落空,开始持续下行走势,12月市场在银行股的带领下探底回升,但仍然连续第三年位列全球主要股市中涨幅末尾。

与2011年市场下跌主要是估值下跌不同,2012年的市场下跌主要是盈利下行造成,估值的下行幅度相对较缓。从各行业走势看,呈现涨跌互现格局,涨幅最大的房地产行业和跌幅最大的信息服务行业的涨跌幅差距超过42个百分点。

本基金在2012年度一直保持75%以上的较高仓位运作,虽然在二、三季度的下跌过程中受到一定影响,但全年来看取得较好的相对收益。本基金主要超配于房地产、医药生物、公用事业等行业的大盘蓝筹低估值品种上,在小股票和主题投资类股票参与较少,整体取得较好的相对收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为1.0093元,本报告期份额净值增长率为+6.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

近期的各项经济数据已经很明确地释放出经济将温和回暖的信号,预计2013年的经济基本面和企业盈利增速会略好于2012年。而全球主要经济体延续之前的流动性宽松政策,新兴经济体也在通过不同形式扩充流动性,宽松的资金环境,带动投资者风险偏好的增强,利好股票估值的回升。

在较弱的总需求下,预计经济不会出现明显的"钩库存"过程,2013年面临着产能消化的压力,制造业投资增速可能相对较低,但会有结构升级的投资机会。限购限贷的一线城市房价涨势较为明显,一旦政府对房地产市场的态度开始转为强硬,引起地产投资增速下滑,预计会对未来经济增长造成拖累,地产政策的变动需要高度关注。

横向比较,当前A股的整体估值水平均已与国际市场相当,金融行业则呈现明显的估值折价;纵向比较,A股市场整体估值处于05年上证指数998点以来最低水平,但中小股票的估值仍大幅高于历史低位,在2013年将面临较大的大小非解禁压力,预计未来大小股票估值两极分化的情况将回归正常。从目前市场对非金融业上市公司业绩一致预期看,还处于较高水平,预计2012年年报和2013年一季报公布后对上市公司业绩预期有下修风险,需要对个股进行进一步跟踪甄别。本基金在目前以低估值、高分红、稳定增长的大盘蓝筹为主的配置基础上,将加大对节能环保、医药生物、消费等行业的配置,并密切跟踪上市公司经营情况,精选成长型个股进行投资。

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

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。

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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012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顺证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、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 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师汪棣、庄贤签字出具了普华永道中天审字(2013)第21409号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:安顺证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	8,358,256.18	1,269,872.42
结算备付金	44,631,430.22	11,359,890.92
存出保证金	627,913.62	1,325,036.57
交易性金融资产	3,004,669,434.64	2,812,466,649.63
其中:股票投资	2,394,567,655.34	2,240,763,775.13
基金投资	-	-
债券投资	610,101,779.30	571,702,874.50
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	-	16,229,825.49
应收利息	8,429,617.77	8,118,017.36
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,066,716,652.43	2,850,769,292.39
负债和所有者权益	**本期末 2012年12月31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	32,689,439.65	5,802,004.81
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,588,662.09	3,650,277.34
应付托管费	598,110.37	608,379.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	649,185.28	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	1,263,000.00	1,262,000.00
负债合计	38,847,297.39	12,886,850.35
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	27,869,355.04	-162,117,557.96
所有者权益合计	3,027,869,355.04	2,837,882,442.04
负债和所有者权益总计	3,066,716,652.43	2,850,769,292.39

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.0093元,基金份额总额3,000,000,000.00份。

7.2 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12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	251,170,339.38	-574,205,437.01
1.利息收入	20,638,922.82	25,932,792.59
其中:存款利息收入	882,677.44	2,808,824.13
债券利息收入	19,756,245.38	23,123,968.46
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)	-126,845,281.34	50,644,762.32
其中:股票投资收益	-174,674,053.08	34,754,493.91
债券投资收益	-238,215.53	-5,707,750.41
基金投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	48,066,987.27	21,598,018.82
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	357,376,697.90	-650,782,991.92
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	61,183,426.38	81,044,603.81
1.管理人报酬	43,519,298.49	50,246,175.35
2.托管费	7,253,216.37	8,375,758.37
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	9,932,613.67	20,053,370.19
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	478,297.85	2,369,299.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	189,986,913.00	-655,250,040.82
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列	189,986,913.00	-655,250,040.82

7.3 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12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	189,986,913.00	189,986,913.00
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	27,869,355.04	3,027,869,355.04
项目	**上年度可比期间 2011年1月1日至2011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)	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)	-	-655,250,040.82	-655,250,040.82
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	-162,117,557.96	2,837,882,442.04

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:李勋,主管会计工作负责人:章国富,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

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2013年3月26日批准报出。

7.4.2会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安顺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2012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12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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。

7.4.7关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司("华安基金公司")	基金发起人、基金管理人
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人
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
方正证券有限责任公司("方正证券")	基金发起人
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。

7.4.8本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1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。

7.4.8.1.2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。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

7.4.8.2关联方报酬

7.4.8.2.1基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	43,519,298.49	50,246,175.35
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

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。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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,253,216.37	8,375,758.37

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。

7.4.8.3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12月31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	202,068,451.64	10,184,743.50	-	-	-	-
上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	81,988,866.86	31,139,736.99	-	-	-	-

7.4.8.4各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
期初持有的基金份额	24,325,003.00	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%

7.4.8.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2012年12月31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12月31日安顺证券投资基金持有人名册。

7.4.8.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	8,358,256.18	112,604.84	1,269,872.42	173,698.76
合计	8,358,256.18	112,604.84	1,269,872.42	173,698.76

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12月31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12月31日:同)。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内和上年度可比期间内均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末(2012年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.9.2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
000002	万科A	2012-12-26	公告重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	13,199,998	109,712,489.29	133,583,979.76	-

注:本基金截止至2012年12月31日止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。

7.4