

上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金

开放式指数证券投资基金

年度报告摘要

7.4.3 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公司对金融资产的持有意图和持有能力。本基金无金融资产，因此无列报的金融资产及持有至到期投资。

金融资产和金融负债的公允价值选择使用估值技术，主要是根据投资工具类型以及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变动计入当期损益的金融资产和金融负债中的资产以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产列示。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债，因此无列报的金融负债及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项应付账款。

7.4.4 金融工具的公允价值

金融工具的公允价值按照公允价值确定原则、后续计价和终止确认。

对于有活跃市场报价的金融资产，取得时发生的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利息计入应收项目，单独确认为应收项目；对于支付的其他金融负债包含已宣告但尚未发放的现金股利或利息计入应收项目，单独确认为应收项目；应付款项和其他金融负债按账面价值进行初始计量。

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

[illegible]

8.4.2 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

7.4.4.1 基金收益的持有期间分配政策

——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，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公允价值损益以及基金份额交易产生的未实现净值增值等）为正数，则期末可供分配的利润的金额为本基金分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润中的未实现部分为负数，则期末可供分配的利润的金额为本基金分配利润中已实现部分扣除未实现部分后的余额。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率加上1%以上，方可进行现金收益分配在持有期间期间利息支出按实际利率法计算，实际利率法与名义法存在较大的则按名义法计算。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

7.4.1.2 审计报告
基金年度报告的审计机构、审计意见、内部控制评价与鉴证报告、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、经营分部是本基金内部确定报告分部的主要组成成分。该决定成分包括经营活动中产生的收入、费用、利润。
2) 本基金的基本会计政策能够适当评价和反映经营业绩, 以说明其经营成果, 并符合会计准则的要求。本基金费用支出按照权责发生制原则进行确认, 并计入当期损益。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。
7.4.1.3 基金管理人自本报告期内发生的关联交易情况, 不需要进行分部报告的披露。

7.4.2 基金会计政策变更和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.2.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期末未发生会计政策变更。
7.4.2.2 会计估计变更的说明
本基金本报告期末未发生会计估计变更。
7.4.2.3 差错更正的说明
本基金本报告期未发生会计估计差错更正。
7.4.3 税务
7.4.3.1 增值税
根据国家税务总局财税[2008]121号《关于证券投资基金有关税收政策的通知》, 财税[2008]170号《关于证券投资基金税收政策的通知》, 财税[2008]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》, 财税[2008]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《关于金交所所得涉及营业税的通知》及其他相关税收法规。
(1) 以基金方式募集基金不属于营业税征收范围, 不缴纳营业税。
(2) 基金管理人取得的申购费、赎回费中属于代收的手续费, 不属于营业税征收范围。
(3) 根据国家税务总局财税[2008]121号《关于证券投资基金有关税收政策的通知》, 基金管理人取得20%的个人所得税, 不征收营业税。
(4) 根据国家税务总局的财税[2008]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》, 基金管理人取得基金派发股息、红利所得, 依据现行税法规定应扣缴的个人所得税, 由基金企业代扣代缴。
(5) 根据国家税务总局的财税[2008]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》, 基金管理人取得基金派发股息、红利所得, 依据现行税法规定应扣缴的个人所得税, 由基金企业代扣代缴。
7.4.3.2 企业所得税
根据国家税务总局财税[2008]121号《关于证券投资基金有关税收政策的通知》, 基金管理人取得基金派发股息、红利所得, 依据现行税法规定应扣缴的个人所得税, 由基金企业代扣代缴。

7.4.3.3 关联方名称
与本基金的关系

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合				金额单位：人民币元
				占基金资产净值

中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
上海国际信托有限公司	基金管理人股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人股东
国君证券投资管理服务股份有限公司	基金管理人股东
华安上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华安上证龙头ETF联接”)	基金的基金管理人管理的其他基金

注：上述基金交易均在正常业务范围内按一般商业条件订立。

7.4.8.6 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

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月18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	5,778,433.56	663,932.17
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

8.6	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	1,790,174.10	0.23
-----	--------------------------------	--------------	------

金额单位：人民币元

<p>注：支付给基金托管人平安基金公司的管理人报酬按照一日基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。</p> <p>支付给基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按照一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。</p> <p>支付给基金管理人中国工商银行股份有限公司的债券托管费按照一日基金资产净值0.01%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。</p> <p>7.4.8.3与关联方进行银行间同业市场的债券 回购的交易</p> <p>7.4.8.4关联方投资本基金的情况</p> <p>7.4.8.5关联方承销承销本基金的情况</p>			单位：人民币元
项目	本期 2010年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	基金合同生效 2010年11月18日
当期发生的基金应支付的托管费	1,155,686.78	132,786.44	

序号	名称	金额
1	存出保证金	-

7.4.8.2 报告期末除基金管理人以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 2011年12月31日		上年度末 2010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	
华安上证龙头 ETF联接	292,481,667.00	76.24%	-	-	

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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年11月18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	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	16,533,236.31	85,216.54	81,321,001.82	398,202.39

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。
7.4.8.6 本基金在承销期间参与关联方承销证券的情况

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

7.4.2其他关联交易事项的说明									
7.4.2.1 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.1 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.2 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.3 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.4 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.5 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.6 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.7 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.8 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.9 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.10 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.11 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.12 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.13 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.14 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.15 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.16 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.17 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.18 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.19 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.20 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.21 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.22 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.23 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.24 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.25 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.26 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.27 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.28 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.29 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.30 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.31 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.32 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.33 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.34 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.35 其他关联交易事项说明									
7.4.2.1.36 其他关联交易事项说明									

3	中国石化财务有限责任公司	7,664,972.00	2.00%
4	西部证券-建行-西部证券财富长安1号集合资产管理计划	7,309,627.00	1.91%

7.9.3.2 基金申购和赎回申请的处理
自2018年1月1日起，本基金无交易型货币市场券正回购交易中作为抵押的债券。
7.10 申购与赎回业务公告摘要中未列明的其他事项
关于申购与赎回业务公告摘要中未列明的其他事项，以本基金的招募说明书为准。

7.9.3.3 基金份额净值的计算
T日基金份额净值=（T日该基金资产净值÷T日发售在外的该类别基金份额总数）×公允价值调整系数。基金份额净值的精度为小数点后四位，小数点后第五位四舍五入。
7.9.3.4 基金申购份额的计算
基金申购采用“金额申购”方式，申购价格为每份基金份额人民币1.00元。计算公式如下：
 $\text{申购份额} = \frac{\text{申购金额}}{\text{申购当日基金份额净值}}$

7.9.3.5 基金赎回金额的计算
基金赎回采用“份额赎回”方式，赎回价格以赎回当日的基金份额净值为基准进行计算。计算公式如下：
 $\text{赎回金额} = \text{赎回份额} \times \text{赎回当日基金份额净值}$

7.9.3.6 基金申购费用、赎回费用的处理
基金申购费用由投资人承担，并应在投资人申购基金份额时收取，不列入基金财产，用于支付注册登记费和其他手续费。
基金赎回费用由赎回基金份额的投资人承担，其中不低于25%的部分归入基金财产，其余部分用于支付注册登记费和其他手续费。

7.9.3.7 基金申购份额、赎回金额的计算结果按四舍五入方法，保留到小数点后两位，由此产生的误差计入基金财产。

7.9.3.8 基金份额净值的公告
基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日，通过指定网站、基金销售机构网站或者营业网点披露前一开放日的基金份额净值及基金份额累计净值。

7.9.3.9 基金发生巨额赎回的情形及处理方式
（1）巨额赎回的定义
本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一开放日基金总份额的10%时，即认为发生了巨额赎回。

（2）巨额赎回的处理方式
出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分延期赎回。
①全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资人的全部赎回申请时，按正常赎回程序执行。
②部分延期赎回：当基金管理人认为支付投资人的赎回申请有困难或认为因支付投资人的赎回申请而进行的财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于上一开放日基金总份额的10%的前提下，可对其余赎回申请延期办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；对于未能赎回部分，投资人的赎回申请将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止。延期办理的期限最长不超过20个工作日，并在指定网站上进行公告。但延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以下一开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如基金管理人无法应对巨额赎回，可暂停赎回，待中国证监会核准后再行公告。
③如果连续两个或两个以上开放日发生巨额赎回，本基金可暂停接受新的赎回申请，已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过20个工作日，并在指定网站上公告。

（3）巨额赎回的公告
当发生上述巨额赎回并延期办理时，基金管理人应当通过邮寄、传真或者招募说明书规定的其他方式在3个工作日内通知基金份额持有人，说明有关处理方法，同时在指定网站及至少一种全国性报刊上刊登公告。

7.9.3.10 基金转换业务公告摘要中未列明的其他事项
关于基金转换业务公告摘要中未列明的其他事项，以本基金的招募说明书为准。

7.9.3.11 基金收益分配原则
（1）本基金收益分配方式为现金分红；
（2）每一基金份额享有同等分配权；
（3）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；
（4）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.9.3.12 基金收益分配方案的确定、公告和实施程序
基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人复核，在指定网站公告并报中国证监会备案。

7.9.3.13 基金收益分配中发生的费用
红利再投资的免收申购费的基金份额，其赎回费按照赎回当日基金份额净值的1%收取，并归入基金财产。除法律法规另有规定外，其他情形下发生的费用从基金财产中扣除，包括：
（1）基金管理人和基金托管人因该等基金份额派发红利的手续费、银行转账或其他手续费用；
（2）基金份额持有人应缴的税款。

7.9.3.14 基金收益分配的发放时间、地点、方式和登记规则
（1）发放时间：基金收益分配发放时间与权益登记日为同一日。
（2）发放地点：本基金收益分配款将划入基金份额持有人的资金账户。
（3）发放方式：本基金收益分配方式为现金分红，红利再投资的免收申购费的基金份额除外。
（4）登记规则：本基金收益分配的发放时间、地点、方式和登记规则以本基金的招募说明书为准。

7.9.3.15 基金收益分配的限制
（1）基金收益分配仅限于基金可供分配利润，即截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润弥补亏损的孰低数。
（2）基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；如基金在收益分配后基金份额净值仍低于面值的，基金管理人将暂停基金收益分配，直至基金份额净值达到面值后方可恢复基金收益分配。
（3）基金收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。对于基金份额持有人等，场内认购、申购或定期定额投资等通过上海证券交易所交易系统自动扣款的基金份额持有人，基金份额持有人届时须确保其指定的银证账户有足够的资金用于扣收相关款项。如基金份额持有人等非场内认购、申购或定期定额投资等通过上海证券交易所交易系统自动扣款的基金份额持有人，基金份额持有人届时须确保其指定的银行账户有足够的资金用于扣收相关款项。如基金份额持有人等非场内认购、申购或定期定额投资等通过上海证券交易所交易系统自动扣款的基金份额持有人，基金份额持有人届时须确保其指定的银行账户有足够的资金用于扣收相关款项。

7.9.3.16 基金收益分配的公告
基金管理人应当在不晚于收益分配基准日次日起5个工作日内，在指定网站公告收益分配方案，并向中国证监会备案。

7.9.3.17 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.18 基金收益分配的税务处理
（1）基金收益分配涉及的所得税由基金份额持有人自行缴纳。
（2）基金收益分配涉及的增值税由基金份额持有人自行缴纳。

7.9.3.19 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.20 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.21 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.22 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.23 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.24 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.25 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.26 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.27 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.28 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.29 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.30 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.31 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.32 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.33 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.34 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.35 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.36 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.37 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.38 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.39 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.40 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.41 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.42 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.43 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.44 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.45 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.46 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.47 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.48 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.49 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.50 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.51 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.52 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.53 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.54 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.55 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.56 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.57 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.58 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后生效。基金管理人负责办理基金收益分配事宜，基金托管人负责监督基金管理人是否按照基金收益分配方案执行。

7.9.3.59 基金收益分配的会计处理
基金收益分配方案经基金管理人、基金托管人双方盖章确认后

基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	2,200.00	0.0006%
----------------------	----------	---------

于期末的余额为1,218,717.50元,无属于第三层级的余额。2010年12月31日,第一层级:1,012,884,543.73元,第二层级:6,887,210.00元,第三层级:余额为零。

(b)公允价值所属层级的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行股票等情况,本基金会将其从当日收盘后起归入公允价值层级。交易不活跃期间内公允价值计量和计量的公允价值变动列入第一层级;根据估值技术中使用的公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二级或第三级。

(c)第二层级公允价值金额和本期变动金额

8)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要使用的其他重要事项。

8.1 期末基金资产组合情况

\$0 投资组合报告

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	754,255,375.71	97.32
	其中:股票	754,255,375.71	97.32
2	固定收益投资	1,790,171.10	0.23
	其中:债券	1,790,171.10	0.23
3	金融衍生品投资	-	-
4	资产支持证券投资	-	-

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

4	买入返售金融资产				
5	其中:买入返售金融资产-买入返售金融资产				
5	银行存款和结算备付金合计	16,533,572.52		2.13	
6	其他各项资产	2,478,652.55		0.32	
7	合计	775,057,771.91		100.00	
8.2	按行业分类的股票投资组合				
8.2.1	指数投资型本行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、商业				
B	采掘业	91,173,258.55		11.78	
C	制造业	184,148,952.43		23.79	
D	食品、饮料	26,772,164.34		3.46	

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。

C1	纺织、服装、皮革	562,922.50	0.07
C2	木材、家具	--	--
C3	造纸、印刷	--	--
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,218,717.50	0.16
C5	电子	10,185,585.55	1.32
C6	金属、非金属	50,538,289.85	6.53
C7	机械、设备、仪表	82,423,159.73	10.65
C8	医药、生物制品	12,448,112.96	1.61
C99	其他制造业	--	--
D	电力、燃气及水的生产和供应业	24,913,608.33	3.21
E	建筑业	68,977,356.69	8.92
F	交通运输、仓储业	37,274,119.94	4.81
G	信息技术业	47,765,149.34	6.17

	成交金额	成交金额的比例	佣金	佣金的比例
国泰君安证券	212,550,265.70	100.00%	502,155.50	100.00%

H	批发和零售贸易	12,880,808.35	1.66
I	金融、保险业	235,051,027.72	30.36
J	房地产业	37,298,945.76	4.82
K	社会服务业	6,730,881.64	0.87
L	传播与文化产业	2,832,419.20	0.37
M	综合类	5,208,847.76	0.67
	合计	754,255,375.71	97.43

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;

2019-1-1		7 867 12 3 666 000 000 2 307 1 367 000 000	26 1 1 0 0 0 0
----------	--	--	----------------

3、报告期内租用证分公司交易单元的交易情况如下：

华安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日