

基金管理人: 华安基金管理有限公司
基金托管人: 中国工商银行股份有限公司
报告送出日期: 二〇一二年三月二十九日

§ 1 重要提示及目录

基金管理人的董事会、基金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2012年3月27日复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、投资组合报告、基金业绩报告等内容,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,也不保证基金份额持有人利益不受损失。 投资有风险,投资者在作出投资决策前应当仔细阅读本基金的招募说明书。

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,应当阅读年度报告正文。
本年度报告自2011年1月1日起至2012年3月31日止。

§ 2 基金简介

基金名称	华安MSCI中国A股增强型指数
基金代码	040002 (前缀)
基金简称	040002 (前缀)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月8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	6,699,334,178.71份
基金合同存续期限	不定期

2.4 基金产品说明	采用增强型指数化投资方法,通过控制股票投资组合中MSCI中国A股指数的有限偏离,为基金收益创造超越相似MSCI中国A股指数的长期增值。在基金收益创造的基础上,择机实现一定程度的收益分配。
投资策略	(1)资产配置:本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股等因素的综合分析,以合理配置资产,并根据市场实际情况,适时对投资组合进行调整,使投资组合具备长期增值的潜力。(2)股票选择:本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重指标为基准,通过具有前瞻性的增强型方法,如:基本面分析、估值分析、技术分析、行业分析、个股分析等,对投资组合进行动态调整,使投资组合具备长期增值的潜力。(3)风险控制:本基金采用风险控制工具,确保基金资产净值不致因基金持仓的单一股票的新股增发、限售股解禁等而出现大幅波动。(4)风险控制:本基金采用风险控制工具,确保基金资产净值不致因基金持仓的单一股票的新股增发、限售股解禁等而出现大幅波动。
业绩比较基准	95% MSCI中国A股指数收益率 + 5% 固定收益类资产收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金,具有较高风险、较高预期收益、资产净值较大波动的特点。其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	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
信息披露负责人	姓名 孙庆 电话 021-33696999 传真 021-66105799 电子邮箱 fengting@huawen.com.cn cnsd@icbc.com.cn
客户服务电话	4008850099 95588
网址	021-68863414 010-61057898

完整基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.huam.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34层-32层

3.1 主要会计数据和财务指标

3.1.1 期间数据指标	2011年	2010年	2009年
本期实现收益	-59,112,697.71	125,683,843.94	300,087,422.00
本期利润	-1,399,127,913.53	-152,255,361.64	2,845,747,460.13
加权平均基金份额本期利润	-0.2111	-0.0227	0.4225
3.1.2 期末数据指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末基金份额净值	-25.646	-6.656	83.116
期末基金份额总额	6,699,334,178.71	6,699,334,178.71	6,699,334,178.71
期末基金资产净值	4,301,208,215.28	6,214,253,176.17	5,733,841,768.27
期末基金资产净值	6.642	0.874	0.987

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有所降低。
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、期末资产净值和期末基金份额净值按公允价值计量,公允价值计量与公允价值计量中已实现部分的孰低数(公允价值,本期公允价值变动收益)。

的规定。

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

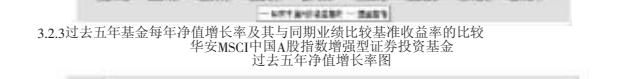
华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2002年11月8日至2011年12月31日)

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。本基金根据对宏观经济、政策、市场、行业、个股等因素的综合分析,以合理配置资产,并根据市场实际情况,适时对投资组合进行调整,使投资组合具备长期增值的潜力。

根据基金合同的规定,本基金将基金资产的70%-95%投资于股票,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%。 本基金可以投资于权证,权证的投资比例不高于基金资产净值的5%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

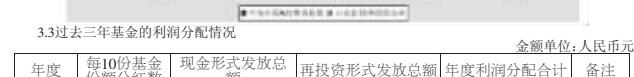
3.2.2 自基金合同生效以来基金业绩累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

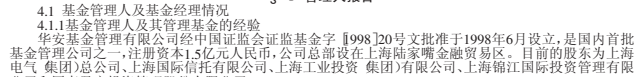
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

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

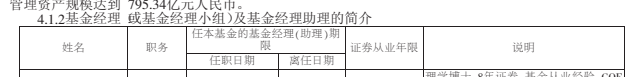

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.4 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.5 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


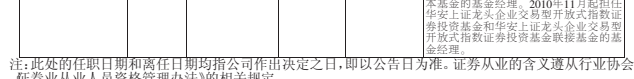
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.6 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


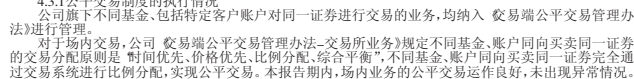
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.7 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

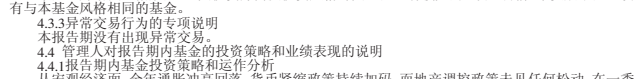

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.8 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


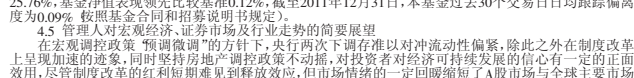
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.9 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


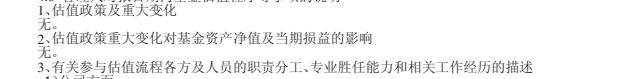
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.10 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.11 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.12 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.13 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

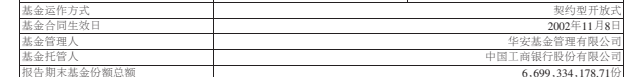
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.14 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

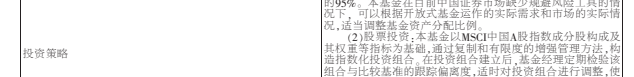
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.15 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

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.16 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.17 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


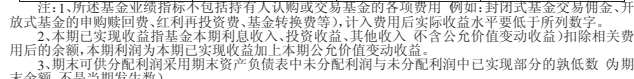
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.18 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.19 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

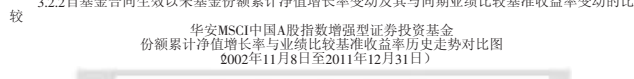

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.20 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.21 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

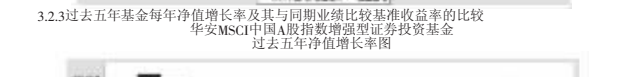

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.22 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.23 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

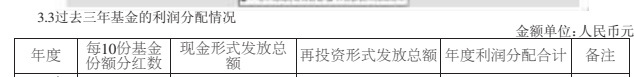

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.24 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


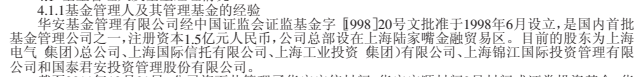
注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.25 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

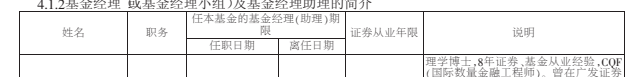

注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.26 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.27 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.28 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.41%。 上述各项投资比例符合基金合同的规定。

3.2.29 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


注:业绩比较基准收益率=95%×MSCI中国A股指数+5%×金融债+5%×国债+5%×央行票据+5%×短期融资券+5%×中期票据+5%×其他固定收益类资产。本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值(扣除股指期货合约)的70%-95%,其中投资于A股资产净值(扣除股指期货合约)不低于基金资产净值的55%。 截至2011年12月31日,本基金投资于股票资产净值占基金资产净值94.13%,其中权证投资比例5.0%。 投资于现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值为5.