基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年三月二十七日

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）

【2012】年度报告摘要

§1重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年3月25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3月29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	华安标普全球石油指数(QDII-LOF)
基金主代码	160416
交易代码	160416
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2012年3月29日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	179,005,406.79份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳交易所
上市日期	2012年5月2日

2.2基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数基金，通过严格的投资纪律约束和数量化风险管理手段，力求实现基金投资组合对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以标普全球石油指数成分股构成及其权重等指标为基础构建指数化投资组合。选择以“跟踪偏离度的绝对值”作为投资组合管理的主要标准,控制基金相对指数的偏离风险。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过6%(以美元资产计价)。
业绩比较基准	标普全球石油净总收益指数收益率 （S&P Global Oil Index Net Total Return）
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高风险、较高预期收益的基金品种,其风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	田青
	联系电话	021-38969999	010-67595096
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	tianqing1.zh@ccb.cn
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833

2.4境外资产托管人

项目		境外资产托管人
名称	英文	State Street Bank and Trust Company
	中文	美国道富银行
注册地址		One Lincoln Street，Boston，Massachusetts 02111，United States of America
办公地址		One Lincoln Street，Boston，Massachusetts 02111，United States of America
邮政编码		02111

2.5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层、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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年3月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日
本期已实现收益	16,740,343.65
本期利润	19,224,665.68
加权平均基金份额本期利润	0.0683
本期基金份额净值增长率	4.14%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末
期末可供分配基金份额利润	0.0020
期末基金资产净值	179,366,888.31
期末基金份额净值	1.002

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本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2012年3月29日成立,截至本报告期末,本基金成立未满一年。

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	-3.93%	0.80%	-2.53%	0.85%	-1.40%	-0.05%
过去六个月	6.26%	0.89%	5.72%	0.97%	0.54%	-0.08%
自基金成立起至今	4.14%	0.86%	-2.84%	1.11%	6.98%	-0.25%

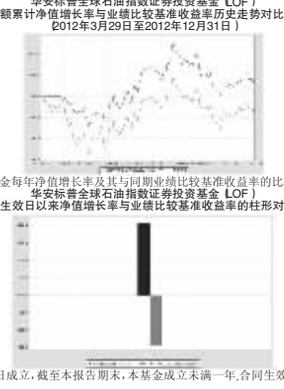
注:1. 本基金于2012年3月29日成立,截至本报告期末,本基金成立未满一年。

2.根据《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)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十三部分《基金的投资》中投资范围、投资限制的有关约定。

3.本基金业绩比较基准:标普全球石油净总收益指数收益率 （S&P Global Oil Index Net Total Return）

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

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）
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
(2012年3月29日至2012年12月31日)



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

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF）
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

注：本基金于2012年3月29日成立,截至本报告期末,本基金成立未满一年,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

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	0.40	6,218,657.42	446,544.36	6,665,201.78	-
合计	-	6,218,657.42	446,544.36	6,665,201.78	-

§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、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级证券投资基金、华安现金富钱包货币、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		
徐宜宜	本基金的基金经理	2012-03-29	-	6年	管理学硕士,CFA（国际金融分析师),FRM（金融风险管理师),6年证券、基金行业从业经历,具有基金从业资格。曾在美国道富全球投资管理公司担任对冲基金助理、量化分析师和风险管理师等职。2011年1月加入华安基金管理有限公司被动投资部从事海外被动投资的研究工作。2011年5月至2012年12月担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理职务。2012年3月起同时担任本基金的基金经理。

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《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》、《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)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,使用机会发言、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,超过授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。（）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。 ）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、比例分配的原则进行分配。若中签量过大无法全理进行比例分配,且以公司名义获利,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。 §）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Bloomberg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,且以公司名义获利,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年全年油价总体走势前高中低,接近年底油价又出现了一波反弹。第一季度主要受经济利好和对货币宽松的预期影响，油价出现大幅上涨。二季度以来,欧债危机的加剧导致美元走强,而石油需求因价格高企而走软,供应也较为充裕,此外中东不稳定局势得到了暂时的缓解。这些原因导致油价短时间内出现大幅度下跌。进入三季度,受到美国宽松货币政策和欧央行推出LTRO政策等因素影响,油价出现了缓步上涨的态势。第四季度后,随着对中国经济担忧的逐步消除和经济面明显改善迹象的影响,油价出现进一步抬升。石油指数全年以来总体与油价走势高度吻合,呈现前高后低翘尾的态势。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本基金成立日为2012年3月29日。截至2012 年12 月31 日,本基金份额净值为1.002 元,本报告期份额净值增长率为4.14%,成立日至12月31日的业绩比较基准增长率为 -2.84%。2012年的累计偏离度为5.6%。2012年,受到建仓期的影响,日均跟踪误差为0.38%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外美国经济逐步走强和欧债危机逐步缓解,国内去库存阶段接近尾声,地产、基建投资有望反弹,产业调整有序进行,新一轮改革措施逐步推出,诸多利好因素都为创造新的消费和投资需求。全球货币政策环境依然较为宽松,实际利率有望保持在较低水平,通胀形势也较温和。于此同时,美国债务谈判的不确定性、欧洲政局的更迭以及中东局势的紧张局面仍然存在。总体来看,我们预计本年市场将保持震荡向上的格局。

石油市场有望在2013年呈现两大特征。即:供应充沛,需求增长,结构调整,利润增加。新一轮产能扩张有望压制油价,为经济复苏提供新的动力。新兴市场的消费有望以高于5%的速度增长,而欧洲等发达国家的需求预计仍然保持低速增长。结构上,天然气以及非传统型油气资源有望继续扩大比重,缓解全球对中东原油的依赖。而较低的成本有助于石油企业扩大生产毛利率,增加勘探资本支出,获得更好的净利润的同时为其可持续发展奠定更加坚实的基础。

作为标普石油指数基金的管理人,我们继续坚持抽样复制的投资方式,积极将基金回报与指数相匹配,控制跟踪误差,勤勉尽责,为投资者获得长期稳定的回报。

4.6管理人对报告期内本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

（）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信息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。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内实施2012年度的第一次分红,本次分红方案为:0.40元/10份,权益登记日:2012年8月27日;现金红利发放日:2012年8月29日。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内实施2012年度的第一次分红,本次分红方案为:0.40元/10份,权益登记日:2012年8月27日;现金红利发放日:2012年8月29日。

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

本托管人复核审查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。

§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21432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:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

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
资 产:	
银行存款	30,324,196.83
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	164,042,370.50
其中:股票投资	154,554,774.25
基金投资	9,487,596.25
债券投资	-
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	-
应收利息	3,145.69
应收股利	129,122.94
应收申购款	3,020,635.50
递延所得税资产	-
其他资产	431.04
资产总计	197,519,902.50
负债和所有者权益	本期末 2012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	2,666,560.52
应付赎回款	14,731,391.74
应付管理人报酬	151,806.65
应付托管费	42,505.85
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	560,749.43
负债合计	18,153,014.19
所有者权益:	
实收基金	179,005,406.79
未分配利润	361,481.52
所有者权益合计	179,366,888.31
负债和所有者权益总计	197,519,902.50

注:1. 报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.002元,基金份额总额179,005,406.79 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2012年3月29日（基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2利润表

会计主体:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

本报告期:2012年3月29日（基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年3月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	23,080,406.90
1.利息收入	1,147,299.28
其中:存款利息收入	277,304.49
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	869,994.79
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	19,000,841.41
其中:股票投资收益	13,953,783.85
基金投资收益	965,081.68
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	23,832.69
股利收益	4,058,143.19
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,484,322.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-197,494.12
5.其他收入(损失以“-”号填列)	645,438.30
减:二、费用	3,855,741.22
1.管理人报酬	2,125,600.23
2.托管费	595,168.06
3.销售服务费	-
4.交易费用	508,570.45
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	626,402.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	19,224,665.68
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	19,224,665.68

7.3所有者权益（基金净值)变动表

会计主体:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

本报告期:2012年3月29日（基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年3月29日(基金合同生效日)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)	529,058,682.11	-	529,058,682.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,224,665.68	19,224,665.68
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)	-350,053,275.32	-12,197,982.38	-362,251,257.70
其中:1.基金申购款	153,658,245.05	433,926.50	154,092,171.55
2.基金赎回款	-503,711,520.37	-12,631,908.88	-516,343,429.25
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)	-	-6,665,201.78	-6,665,201.78
五、期末所有者权益(基金净值)	179,005,406.79	361,481.52	179,366,888.31

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号)从报告7.1至报告7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:李劲,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

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)（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［2011]第1475号《关于核准华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)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《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币528,753,887.81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（2012)第093号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》于2012年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为529,058,682.11份基金份额,其中认购资金利息折合304,794.30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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为道富银行（State Street Bank and Trust Company)。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”)深证上字［2012]第100号文审核同意,本基金39,560,197份基金份额于2012年5月2日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》的有关规定,本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股,与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类证券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股的比例不低于基金资产净值的80%;投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的20%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过6%（以美元资产计价)。本基金的业绩比较基准为:标普全球石油净总收益指数收益率（S&P Global Oil Index Net Total Return)。

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21432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:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

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
资 产:	
银行存款	30,324,196.83
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	164,042,370.50
其中:股票投资	154,554,774.25
基金投资	9,487,596.25
债券投资	-
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	-
应收利息	3,145.69
应收股利	129,122.94
应收申购款	3,020,635.50
递延所得税资产	-
其他资产	431.04
资产总计	197,519,902.50
负债和所有者权益	本期末 2012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	2,666,560.52
应付赎回款	14,731,391.74
应付管理人报酬	151,806.65
应付托管费	42,505.85
应付销售服务费	-
应付交易费用	-
应交税费	-
应付利息	-
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	560,749.43
负债合计	18,153,014.19
所有者权益:	
实收基金	179,005,406.79
未分配利润	361,481.52
所有者权益合计	179,366,888.31
负债和所有者权益总计	197,519,902.50

注:1. 报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.002元,基金份额总额179,005,406.79 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2012年3月29日（基金合同生效日)至2012年12月31日。

7.2利润表

会计主体:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

本报告期:2012年3月29日（基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年3月29日(基金合同生效日)至2012年12月31日
一、收入	23,080,406.90
1.利息收入	1,147,299.28
其中:存款利息收入	277,304.49
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	869,994.79
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	19,000,841.41
其中:股票投资收益	13,953,783.85
基金投资收益	965,081.68
债券投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	23,832.69
股利收益	4,058,143.19
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	2,484,322.03
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-197,494.12
5.其他收入(损失以“-”号填列)	645,438.30
减:二、费用	3,855,741.22
1.管理人报酬	2,125,600.23
2.托管费	595,168.06
3.销售服务费	-
4.交易费用	508,570.45
5.利息支出	-
其中:卖出回购金融资产支出	-
6.其他费用	626,402.48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	19,224,665.68
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	19,224,665.68

7.3所有者权益（基金净值)变动表

会计主体:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

本报告期:2012年3月29日（基金合同生效日)至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年3月29日(基金合同生效日)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)	529,058,682.11	-	529,058,682.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,224,665.68	19,224,665.68
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)	-350,053,275.32	-12,197,982.38	-362,251,257.70
其中:1.基金申购款	153,658,245.05	433,926.50	154,092,171.55
2.基金赎回款	-503,711,520.37	-12,631,908.88	-516,343,429.25
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)	-	-6,665,201.78	-6,665,201.78
五、期末所有者权益(基金净值)	179,005,406.79	361,481.52	179,366,888.31

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码（序号)从报告7.1至报告7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:李劲,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

华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)（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［2011]第1475号《关于核准华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)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《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为上市契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币528,753,887.81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（2012)第093号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》于2012年3月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为529,058,682.11份基金份额,其中认购资金利息折合304,794.30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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司,境外资产托管人为道富银行（State Street Bank and Trust Company)。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”)深证上字［2012]第100号文审核同意,本基金39,560,197份基金份额于2012年5月2日在深交所挂牌交易。上市的基金份额登记在证券登记结算系统,可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回;未上市的基金份额登记在注册登记系统,按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)基金合同》的有关规定,本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股,与石油行业相关的公募基金、上市交易型基金、固定收益类证券、货币市场工具以及中国证监会允许本基金投资的其他产品或金融工具。本基金投资于标普全球石油指数成分股、备选成分股的比例不低于基金资产净值的80%;投资于现金、银行存款、固定收益类证券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具的比例不高于基金资产净值的20%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金力求控制基金组合收益与业绩基准收益之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过6%（以美元资产计价)。本基金的业绩比较基准为:标普全球石油净总收益指数收益率（S&P Global Oil Index Net Total Return)。

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21432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:华安标普全球石油指数证券投资基金（LOF)

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
资 产:	
银行存款	30,324,196.83
结算备付金	-
存出保证金	-
交易性金融资产	164,042,370.50
其中:股票投资	154,554,774.25
基金投资	9,487,596.25
债券投资	-
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	-
应收利息	3,145.69
应收股利	129,122.94
应收申购款	3,020,635.50
递延所得税资产	-
其他资产	431.04
资产总计	197,519,902.50
负债和所有者权益	本期末 2012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