

华安策略优选股票型证券投资基金

2008 第四季度报告

2008年12月31日

注:根据《华安策略优选股票型证券投资基金合同》规定,本基金自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十一部分C、投资范围、(E) 投资限制的有关规定。

4.1 基金经理 或基金经理小组 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 年限, 说明. Lists fund managers like 张伟 and 邓跃辉.

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安策略优选股票型证券投资基金合同》、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律法规的规定,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,不存在违法违规未遵守基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
公司旗下不同基金,包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务,均纳入交易单元间公平交易管理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本季度没有发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2008年第四季度A股市场跌宕起伏,10月初全球股市和大宗商品价格暴跌以及国内经济进入滞胀期等多个超预期因素打破了A股市场在9月19日政策刺激下建立的短期平衡,投资者对国内经济的悲观预期达到顶峰,A股市场再度恐慌状态。

4.5 投资组合报告
4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
4.5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

4.6 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

4.6.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

4.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

4.7.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

4.8 报告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

4.8.1 报告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

4.9 投资组合报告附注

4.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.9.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.10 投资组合报告附注

4.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.10.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.11 投资组合报告附注

4.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.11.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.12 投资组合报告附注

4.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.12.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.13 投资组合报告附注

4.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.13.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.14 投资组合报告附注

4.14.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.14.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.14.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.15 投资组合报告附注

4.15.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.15.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.15.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.16 投资组合报告附注

4.16.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.16.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.16.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.17 投资组合报告附注

4.17.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.17.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.17.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.18 投资组合报告附注

4.18.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.18.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.18.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.19 投资组合报告附注

4.19.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.19.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.19.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.20 投资组合报告附注

4.20.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.20.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.20.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 序号, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

5.4.2 报告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

5.5 投资组合报告附注

5.5.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.5.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.5.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.6 投资组合报告附注

5.6.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.6.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.6.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.7 投资组合报告附注

5.7.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.7.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.7.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.8.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.9.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.12.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.13 投资组合报告附注

5.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.13.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.13.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.14 投资组合报告附注

5.14.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.14.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.14.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.15 投资组合报告附注

5.15.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.15.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.15.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.16 投资组合报告附注

5.16.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.16.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.16.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.17 投资组合报告附注

5.17.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.17.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.17.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.18 投资组合报告附注

5.18.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.18.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.18.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

5.19 投资组合报告附注

5.19.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

5.19.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.19.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

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:2009年1月23日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金管理人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定,于2009年1月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告自2008年10月1日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

Table with columns: 基金名称, 基金代码, 基金运作方式, 基金合同生效日, 基金管理人, 基金托管人, 基金销售机构

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

Table with columns: 序号, 基金名称, 报告期(2008年10月1日至2008年12月31日), 单位:人民币元

注:1.上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,封闭式基金交易费用,开放式基金的申购费、赎回费及基金管理人、基金托管人收取的基金管理费、基金托管费等)所产生

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

Table with columns: 阶段, 净值增长率①, 净值增长率基准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准差④, ①-③, ②-④

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安策略优选股票型证券投资基金自基金合同生效以来基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2007年8月2日至2008年12月31日)

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理 或基金经理小组 简介

Table with columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 年限, 说明. Lists fund managers like 张伟 and 邓跃辉.

4.2 管理人对于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《华安策略优选股票型证券投资基金合同》、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律法规的规定,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,不存在违法违规未遵守基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
公司旗下不同基金,包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务,均纳入交易单元间公平交易管理。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
本季度没有发生异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2008年第四季度A股市场跌宕起伏,10月初全球股市和大宗商品价格暴跌以及国内经济进入滞胀期等多个超预期因素打破了A股市场在9月19日政策刺激下建立的短期平衡,投资者对国内经济的悲观预期达到顶峰,A股市场再度恐慌状态。

4.5 投资组合报告

4.5.1 报告期末按行业分类的股票投资组合

Table with columns: 代码, 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.5.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

Table with columns: 序号, 股票代码, 股票名称, 数量(股), 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.5.3 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

4.5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

Table with columns: 序号, 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

4.5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

4.5.4.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名资产支持证券投资明细

4.5.4.2 报告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

4.5.5 投资组合报告附注

4.5.5.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.5.5.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.5.5.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.5.6 投资组合报告附注

4.5.6.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.5.6.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.5.6.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金, 应收证券清算款, etc.

4.5.7 投资组合报告附注

4.5.7.1 本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

4.5.7.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

4.5.7.3 其他资产构成

Table with columns: 序号, 名称, 金额(元). Lists assets like 存出保证金,