华安宝利配置证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30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
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月12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。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安宝利配置混合
基金主代码	040004
前端交易代码	040004
后端交易代码	041004
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年8月24日
报告期末基金份额总额	4,139,465,440.96份
投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	35%×天相转债指数收益率+30%×天相280指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险,政策风险,经济周期风险,信用风险,再投资风险,上市公司经营风险,新产品创新带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险,技术风险,管理风险,巨额赎回风险等。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	103,398,768.55
2.本期利润	-6,586,205.57
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0018
4.期末基金资产净值	4,813,715,574.12
5.期末基金份额净值	1.163

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。

3.2 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

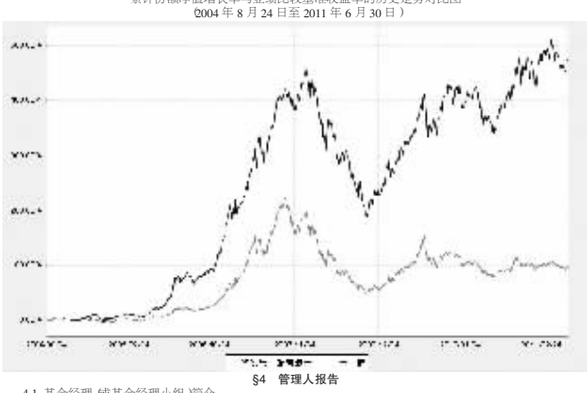
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.26%	0.90%	-1.94%	0.43%	2.20%	0.47%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华安宝利配置证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004年8月24日至2011年6月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆从珍	本基金的基金经理	2010-4-21	-	10年	经济学硕士,10年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商局职员;京华山一证券上海公司高级研究员;中企东方资产管理公司高级研究员;东方证券研究部资深研究员等职。2008年3月加入华安基金管理公司,任研究发展部高级研究员,2009年5月16日起至2010年4月21日担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理,2010年4月起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《华安宝利配置型证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置型证券投资基金招募说明书》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 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《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易,公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是:时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,实现公平交易。本报告期内,场内业务的公平交易运作良好,未出现异常情况。

对于场外交易,公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金(账户)参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范,执行情况良好,未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照本基金的基金合同规定,本基金的投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前,华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

二季度市场对通胀及其所带来的紧缩政策更为敏感。二季度央行维持了调高准备金率的步伐,并在4月份再一次加息,使投资者忧虑经济增长前景,进而开始担忧公司盈利增长的确定性,A股在2季度整体呈现弱势走势。市场运行在紧缩的货币政策环境压力下,导致的结果是资金对所投资公司的确定性、安全性都要求更高。中小市值公司在市场对其业绩预期更为负面的情况下,表现仍旧不如大市值公司。

二季度,华安宝利基金的股票仓位有所波动,总体较一季度为低。在行业配置方面,显著增加了金融地产的配置,从实际效果看,由于过早配置了银行股,期间产生了较大的负面贡献,而地产有一定的正面贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,本基金份额净值为1.163元,本报告期份额净值增长率为0.26%,同期业绩比较基准增长率为-1.94%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来操作中,我们将继续以安全性、确定性作为选股的重要标准,希望能在低估值品种中找寻到业绩确定增长的品种。同时我们将较上半年更加关注成长股的机会,成长型公司整体业绩难以达到年初的市场预期几乎是确定性事件,但这种负面预期在股价中已有一定反映,我们将审视公司估值与成长的匹配性,努力挖掘值得长期持有的公司。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,308,938,407.56	67.55
	其中:股票	3,308,938,407.56	67.55
2	固定收益投资	1,301,222,320.84	26.56
	其中:债券	1,301,222,320.84	26.56
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	257,339,989.28	5.25
6	其他各项资产	30,897,603.48	0.63
7	合计	4,898,398,321.16	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	35,550,000.00	0.74
B	采掘业	121,075,500.00	2.52
C	制造业	1,978,264,396.79	41.10
C0	食品、饮料	203,415,987.60	4.23
C1	纺织、服装、皮毛	80,776,084.65	1.68
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	118,551,758.30	2.46
C4	石油、化学、塑胶、塑料	650,473,519.41	13.51
C5	电子	123,327,223.92	2.56
C6	金属、非金属	276,598,641.50	5.75
C7	机械、设备、仪表	285,062,165.41	5.92
C8	医药、生物制品	240,059,016.00	4.99
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	111,902,640.64	2.32
E	建筑业	120,520,243.19	2.50
F	交通运输、仓储业	15,680,000.00	0.33
G	信息技术业	231,294,421.81	4.80
H	批发和零售贸易	145,056,471.70	3.01
I	金融、保险业	363,339,000.00	7.55
J	房地产业	179,721,597.91	3.73
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,534,135.52	0.14
	合计	3,308,938,407.56	68.74

5.3 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

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(%)
1	600160	巨化股份	7,665,600	248,825,376.00	5.17
2	600636	三爱富	5,467,400	194,256,722.00	4.04
3	000858	五粮液	4,300,000	153,596,000.00	3.19
4	601166	兴业银行	10,000,000	134,800,000.00	2.80
5	000629	攀钢钒钛	8,932,950	98,887,756.50	2.05
6	600000	浦发银行	10,000,000	98,400,000.00	2.04
7	000983	西山煤电	3,990,000	96,558,000.00	2.01
8	000002	万科A	11,199,037	94,631,862.65	1.97
9	600963	岳阳林纸	11,000,000	94,160,000.00	1.96
10	002161	远望谷	3,800,000	85,234,000.00	1.77

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	49,882,000.00	1.04
2	央行票据	782,742,000.00	16.26
3	金融债券	29,412,000.00	0.61
	其中:政策性金融债	29,412,000.00	0.61
4	企业债券	189,070,035.30	3.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	250,116,285.54	5.20
8	其他	-	-
9	合计	1,301,222,320.84	27.03

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1101027	11央票27	2,500,000	248,100,000.00	5.15
2	1101023	11央票23	2,000,000	198,500,000.00	4.12
3	1101025	11央票25	1,200,000	119,088,000.00	2.47
4	1101029	11央票29	800,000	79,384,000.00	1.65
5	1001080	10央票80	800,000	78,120,000.00	1.62

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 2011年5月27日,五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。

5.8.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,399,033.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,162,211.54
4	应收利息	12,283,470.96
5	应收申购款	15,052,887.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,897,603.48

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	70,306,021.50	1.46
2	113001	中行转债	68,627,000.00	1.43
3	125709	唐钢转债	27,646,009.90	0.57
4	110007	博汇转债	5,612,500.00	0.12

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	3,118,248,972.53
本报告期基金总申购份额	1,277,302,391.65
减:本报告期基金总赎回份额	256,085,923.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,139,465,440.96

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》

2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》

3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一一年七月二十日

华安策略优选股票型证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30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
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月12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。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安策略优选股票
基金主代码	040008
前端交易代码	040008
后端交易代码	041008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月2日
报告期末基金份额总额	14,885,886,331.68份
投资目标	以优选股票为主,配合多种投资策略,在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	①资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,并利用公司研究开发的数量模型工具,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。 ②股票投资策略 本基金的股票投资策略将采用"自下而上"和"自上而下"相结合的方法,通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票。在构建投资组合时主要以"自下而上"的优选成长策略为主,辅以"自上而下"的主题优选策略、逆势操作策略,优选具有良好投资潜力的个股,力求基金资产的中长期稳定增值。 ③债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。 ④权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	-358,145,310.28
2.本期利润	-939,841,659.68
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0626
4.期末基金资产净值	10,333,954,899.72
5.期末基金份额净值	0.6942

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。

3.2 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

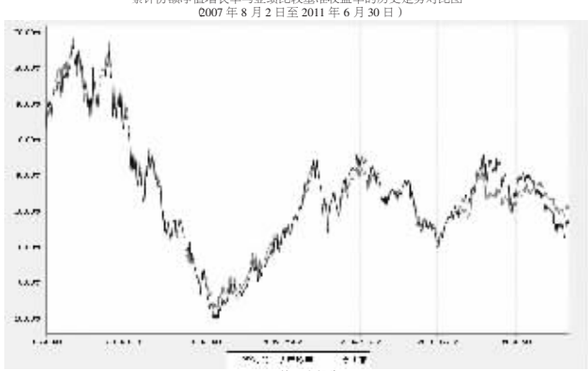
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.26%	1.16%	-4.00%	0.96%	-4.26%	0.20%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

累计份额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2011年6月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
殷鸣	本基金的基金经理	2010-9-21	-	5年	经济学硕士,拥有基金从业人员资格证书,5年证券基金从业经历。曾在光大证券研究所担任研究员。2008年8月加入华安基金管理有限公司后,曾任研究发展部研究员。2010年9月起担任本基金基金经理。

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《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》、《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 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《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易,公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是:时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,实现公平交易。本报告期内,场内业务的公平交易运作良好,未出现异常情况。

对于场外交易,公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金(账户)参与新股询价与申购业务管理办法》等制度对其进行规范,执行情况良好,未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察,分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照本基金的基金合同规定,本基金的投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前,华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

无。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011年二季度,通货膨胀高位徘徊,宏观政策紧缩力度加大。由于一季度企业库存高速积累到较高水平,实体经济面临库存调整压力。此外原材料、劳动力、利息成本的提高也加大了企业盈利压力。经济调整趋势开始显现,工业产出增速放缓。基于对宏观调控政策的预期和对经济前景的担忧,市场二季度整体处于震荡调整的态势。

报告期内本基金降低了对受紧缩政策影响较大及在经济调整过程中盈利或资产质量可能存在风险的部分周期性行业的配置,但适当增加了前期受日本地震影响较大,产业链逐步复苏的汽车、电子等板块的配置;对经济转型期受益的软件服务、消费、医药等板块从中期的角度增加了配置。本基金未来仍将重点关注经济调整过程中传统产业转型升级以及新兴产业快速发展所带来的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2011年6月30日,本基金份额净值为0.6942元,本报告期份额净值增长率为-8.26%,同期业绩比较基准增长率为-4.00%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,458,671,892.16	81.61
	其中:股票	8,458,671,892.16	81.61
2	固定收益投资	407,540,263.20	3.93
	其中:债券	407,540,263.20	3.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	229,600,534.80	2.22
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	1,179,295,432.86	11.38
6	其他各项资产	89,115,835.62	0.86
7	合计	10,364,223,958.64	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	59,539,367.80	0.58
B	采掘业	268,697,276.76	2.60
C	制造业	5,405,524,936.39	52.31
C0	食品、饮料	269,618,428.38	2.61
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	231,767,003.65	2.24
C5	电子	495,114,761.27	4.79
C6	金属、非金属	334,188,012.60	3.23
C7	机械、设备、仪表	2,911,523,301.34	28.17
C8	医药、生物制品	1,163,313,429.15	11.26
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	22,630,000.00	0.22
E	建筑业	197,493,567.22	1.91
F	交通运输、仓储业	164,124,495.99	1.59
G	信息技术业	1,627,686,387.48	15.75
H	批发和零售贸易	437,487,118.51	4.23
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	167,402,133.84	1.62
L	传播与文化产业	108,086,608.17	1.05
M	综合类	-	-
	合计	8,458,671,892.16	81.85

5.3 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

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(%)
1	600104	上海汽车	47,177,225	858,748,896.41	8.31
2	600741	华域汽车	42,379,584	471,684,769.92	4.56
3	600570	恒生电子	27,397,753	406,582,654.52	3.93
4	600588	用友软件	18,862,339	389,695,923.74	3.77
5	002008	大族激光	27,589,964	344,322,750.72	3.33
6	002007	华兰生物	9,995,954	339,262,678.76	3.28
7	002123	荣信股份	13,583,432	309,430,580.96	2.99
8	000063	中兴通讯	10,016,773	283,274,340.44	2.74
9	002269	美邦服饰	8,385,727	251,320,238.19	2.43
10	600079	人福医药	10,187,209	224,729,830.54	2.17

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	218,868,000.00	2.12
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	188,672,263.20	1.83
8	其他	-	-
9	合计	407,540,263.20	3.94

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	1,701,870	179,683,434.60	1.74
2	110011	11附息国债11	1,200,000	119,328,000.00	1.15
3	110009	11附息国债09	1,000,000	99,540,000.00	0.96
4	110011	歌华转债	66,260	7,507,920.60	0.07
5	110009	双良转债	13,200	1,480,908.00	0.01

5.6 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	11,097,876.72
2	应收证券清算款	71,254,152.06
3	应收股利	4,400,299.26
4	应收利息	1,631,858.52
5	应收申购款	731,649.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	89,115,835.62

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	179,683,434.60	1.74
2	110011	歌华转债	7,507,920.60	0.07
3	110009	双良转债	1,480,908.00	0.01

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600104	上海汽车	189,626,027.37	1.83	非公开发行股票未上市

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	15,330,695,349.55
本报告期基金总申购份额	50,739,130.43
减:本报告期基金总赎回份额	495,548,148.30
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	14,885,886,331.68

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安策略优选股票型证券投资基金托管协议》

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅,或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一一年七月二十日

华安创新证券投资基金

2011 第二季度 报告

2011年6月30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
报告送出日期:二〇一一年七月二十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年7月15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。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安创新混合
基金主代码	040001
前端交易代码	040001
后端交易代码	041001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2001年9月21日
报告期末基金份额总额	10,052,796,499.86份
投资目标	基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极追求投资收益的稳定增长为目标,以诚信原则及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。
投资策略	本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。 这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。 高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域,包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。 传统产业类型的上市公司中,如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。 本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素:公司创新能力强,主营业务市场空间大,财务状况良好,具有相当竞争优势等。 本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产,如国债和现金,从而保持基金资产良好的流动性。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	无
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2011年4月1日-2011年6月30日)
1.本期已实现收益	56,176,329.53
2.本期利润	-481,104,800.50
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0476
4.期末基金资产净值	7,285,618,761.52
5.期末基金份额净值	0.725

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。

3.2 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

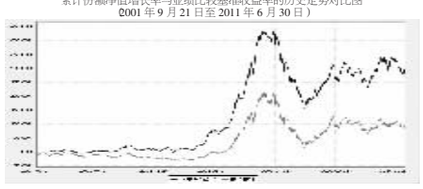
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.09%	0.98%	-4.12%	0.90%	-1.97%	0.08%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华安创新证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2001年9月21日至2011年6月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
汪光成	本基金的基金经理	2009-3-27	-	9年	管理学博士,持有基金从业资格证书,9年证券、基金行业从业经历,2002年1月加入华安基金管理有限公司后,曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月至2009年3月担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2009年3月起担任本基金的