华安强化收益债券型证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年八月二十九日

§1 重要提示及目录

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。本半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 2011 年 8 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安强化收益债券	
基金主代码	040012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年 4 月 13 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	488,730,666.75 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
下属分级基金的交易代码	040012	040013
报告期末下属分级基金的份额总额	307,669,573.08 份	181,061,093.67 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过增强信用产品的投资,以获取资产的长期增值。
投资策略	本基金将以宏观经济、市场利率研究主导固定收益资产投资,在控制风险和保持资产流动性的前提下,获取债券市场平均收益;同时在严格的信用评估和利差分析基础上,通过投资于有一定信用风险、具有较高收益率的信用类债券,以获取超越市场平均水平的收益;此外,本基金还将通过积极的新股申购和个股精选来增强基金资产的收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种, 其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低等风险和中低等收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	赵会军
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-50099	95588
传真		021-68863414	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)	
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
本期已实现收益	5,069,038.29	2,456,875.65
本期利润	-4,796,200.51	-2,650,636.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0133	-0.0125
本期基金份额净值增长率	-0.98%	-1.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011 年 6 月 30 日)	
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
期末可供分配基金份额利润	0.0137	0.0042
期末基金资产净值	311,877,290.17	181,820,226.70
期末基金份额净值	1.014	1.004

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: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未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)。

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

华安强化收益债券 A

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
过去一个月	-0.20%	0.12%	-0.49%	0.15%	0.29%	-0.03%
过去三个月	-0.69%	0.18%	-0.86%	0.12%	0.17%	0.06%
过去六个月	-0.98%	0.25%	-0.29%	0.14%	-0.69%	0.11%
过去一年	4.29%	0.29%	0.13%	0.16%	4.16%	0.13%
自基金成立起至今	10.48%	0.30%	0.31%	0.18%	10.17%	0.12%

华安强化收益债券 B

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
过去一个月	-0.20%	0.13%	-0.49%	0.15%	0.29%	-0.02%
过去三个月	-0.89%	0.17%	-0.86%	0.12%	-0.03%	0.05%
过去六个月	-1.28%	0.25%	-0.29%	0.14%	-0.99%	0.11%
过去一年	3.80%	0.30%	0.13%	0.16%	3.67%	0.14%
自基金成立起至今	9.44%	0.31%	0.31%	0.18%	9.13%	0.13%

注:本基金业绩比较基准为:中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%

根据本基金合同的有关规定,本基金为债券型基金,投资范围为固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、金融债、央行票据、企业 (公司) 债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券、次级债、债券回购等,以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。

基金的投资组合比例为:债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。其中,除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值的 30%;持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具,投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。

截至 2011 年 6 月 30 日,本基金的债券类资产的投资比例为基金资产净值的 118.40%,除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产占基金资产净值的比例为基金资产净值的 107.16%, 投资于股票等权益类资产的比例为基金资产净值的 7.18%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的 8.93%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

华安强化收益债券型证券投资基金
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
(2009 年 4 月 13 日至 2011 年 6 月 30 日)
华安强化收益债券 A

华安强化收益债券 B

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 2011 年 6 月 30 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、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、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、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安大中华升级股票等 22 只开放式基金,管理资产规模达到 755.14 亿人民币。

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		
黄勤	本基金的基金经理, 固定收益部总经理	2009-04-13	-	9年	经济学硕士, 持有基金从业人员资格证书,15 年银行、基金从业经历。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公司, 曾任固定收益部债券投资经理,2007 年 5 月起担任华安现金富利基金的基金经理, 2009 年 4 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《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安强化收益债券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 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

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对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

上半年的债市经历了 2 次加息,6 次上调准备金率,紧缩货币政策执行得非常彻底。资金紧张发生在元旦前后、春节前后和 6 月末。资金紧张对债市也形成阶段性冲击,带动收益率明显上移。一季度债市经历了从谨慎到偏乐观的转变,短端收益率降幅较大,中长债的收益率小幅下降。尤其是 3 月份收益率降幅较大。二季度伴随着通货膨胀的一路走高,央行货币紧缩的组合拳是频频出手。尤其是 6 月份在新政策日均贷存比考核以及银行半年报记账日影响下,回购利率一度突破 8%的水平,且高位持续时间较长。资金面紧张对债市、尤其是短端影响较大,债券收益率曲线平坦化上行,短端收益率曲线上升幅度远大于中长端。信用品种 6 月份在资金紧张冲击下遭受重挫。创业板和中小板继续遭受重创:创业板指数二季度下跌 16.10%,中小板指数下跌 9.09%。可转债二季度表现也较弱,指数下跌 0.70%。本基金债券部分采取哑铃操作方式,新增信用品种主要从一级市场申购,一定程度上规避了收益率上行的风险;维持相对低仓位的转债配置;阶段性参与了建材、电器、酒类、化工以及房地产等股票品种;六月份开始加大了网上和网下新股申购的力度。二季度本基金取得了略好于平均的业绩。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日,本基金资产净值为 4.94 亿元,A 类份额累计净值 1.104,B 类份额累计净值 1.094,本报告期 A 类份额净值增长率为-0.98%,B 类份额净值增长率为-1.28%,同期业绩比较基准增长率为-0.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国经济今年以来的增长有所放缓并低于预期,而且债务压力加大,有降级风险,预计货币政策仍是如期结束 QE2.欧洲经济前景黯淡,希腊债务危机依然困难重重。国内经济增长速度趋缓,但通货膨胀将高位回落。在这种情况下,紧缩性货币政策将趋缓,至少紧缩政策对债市的冲击力度逐步递减,债市将进入抗跌震荡,直至通货膨胀确立拐点后债市将转势上行。下半年本基金将重点控制流动性风险,努力为基金创造正收益。债券控制信用风险、保持债券的中低久期配置;创业板和中小板经过 3 个月左右的深幅调整,目前估值已经进入安全区域。从新股询价的估值和上市首日的表现看,新股的投资价值已经凸现。本基金将选择性参与新股询价,争取挖掘能带来高收益品种;同时捕捉通胀和紧缩情况下股票二级市场上存在的阶段性投资机会。

我们将秉承稳健、专业的投资理念,优化组合结构,控制风险,勤勉尽责地维护持有人的利益。

4.6 管理人对报告期内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本报告期损益的影响

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

(1)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、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、金融工程部总经理、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,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。

李炳旺先生,研究生学历,24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理,现任华安基金管理有限公司副总裁。

宋磊, 研究发展部总经理, 工学硕士,曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作,2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司,在基金研究发展部从事化工行业研究,现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

黄勤, 固定收益部总经理, 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、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦,金融工程部总经理, 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 联接的基金经理,金融工程部总经理。

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估值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

本基金的基金经理黄勤作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

本报告期不进行收益分配。

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

2011 年上半年,本基金托管人在对华安强化收益债券型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年, 华安强化收益债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安强化收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,华安强化收益债券型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安强化收益债券型证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告 (未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华安强化收益债券型证券投资基金
报告截止日:2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	5,478,039.50	63,009,682.51
结算备付金	3,143,073.50	3,554,251.73
存出保证金	356,162.11	325,462.75
交易性金融资产	619,968,382.04	652,301,421.41
其中:股票投资	35,441,948.65	88,296,038.21
基金投资	-	-
债券投资	584,526,433.39	564,005,383.20
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	-	16,747,166.75
应收利息	10,428,217.57	8,742,845.56
应收股利	-	-
应收申购款	90,242.37	347,969.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	639,464,117.09	745,028,800.55
负债和所有者权益	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010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	141,099,857.20	64,000,000.00
应付证券清算款	1,699,831.39	-
应付赎回款	1,368,082.18	770,867.77
应付管理人报酬	287,095.98	381,700.84
应付托管费	82,027.44	109,057.43
应付销售服务费	61,223.55	77,369.91
应付交易费用	112,047.84	274,800.82
应交税费	883,062.60	882,192.60
应付利息	8,119.29	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	165,252.75	326,163.70
负债合计	145,766,600.22	66,822,153.07
所有者权益:		
实收基金	488,730,666.75	663,679,541.25
未分配利润	4,966,850.12	14,527,106.23
所有者权益合计	493,697,516.87	678,206,647.48
负债和所有者权益总计	639,464,117.09	745,028,800.55

注:报告截止日 2011 年 6 月 30 日,基金份额总额 488,730,666.75 份,其中华安强化收益债券 A 份额总额 307,669,573.08 份,华安强化收益债券 B 份额总额 181,061,093.67 份。华安强化收益债券 A 份额净值 1.014 元,华安强化收益债券 B 份额净值 1.004 元。

6.2 利润表

会计主体:华安强化收益债券型证券投资基金
本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入	-1,796,318.96	13,186,620.00
1.利息收入	11,118,203.11	18,631,023.14
其中:存款利息收入	202,707.70	564,495.64
债券利息收入	10,892,404.55	17,960,886.70
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	23,090.86	105,640.80
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	1,996,892.10	26,130,990.02
其中:股票投资收益	-57,295.89	22,850,462.52
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,986,733.63	2,894,632.06
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	67,454.36	385,895.44
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-14,972,751.11	-31,645,682.80
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	61,336.94	70,289.64
减:二、费用	5,650,518.21	6,889,991.56
1.管理人报酬	2,023,751.72	3,754,176.91
2.托管费	578,214.86	1,072,622.01
3.销售服务费	426,033.25	666,091.49
4.交易费用	620,390.89	840,134.37
5.利息支出	1,821,728.81	379,179.07
其中:卖出回购金融资产支出	1,821,728.81	379,179.07
6.其他费用	180,398.68	177,787.71
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-7,446,837.17	6,296,628.44
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-7,446,837.17	6,296,628.44

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体:华安强化收益债券型证券投资基金
本报告期:2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 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)	663,679,541.25	14,527,106.23	678,206,647.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,446,837.17	-7,446,837.17
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)	-174,948,874.50	-2,113,418.94	-177,062,293.44
其中:1.基金申购款	185,494,592.32	4,761,160.98	190,255,753.30
2.基金赎回款	-360,443,466.82	-6,874,579.92	-367,318,046.74
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	488,730,666.75	4,966,850.12	493,697,516.87
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 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)	1,046,557,085.79	44,554,865.12	1,091,111,950.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,296,628.44	6,296,628.44
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)	-55,500,836.48	-1,798,908.82	-57,299,745.30
其中:1.基金申购款	311,093,204.74	12,883,501.43	323,976,706.17
2.基金赎回款	-366,594,041.22	-14,682,410.25	-381,276,451.47
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)	-	-21,503,302.48	-21,503,302.48
五、期末所有者权益(基金净值)	991,056,249.31	27,549,282.26	1,018,605,531.57

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:李勍,主管会计工作负责人:李炳旺,会计机构负责人:陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安强化收益债券型证券投资基金 (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? 2009]第 125 号《关于核准华安强化收益债券型证券投资基金募集的批复》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《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 2,754,686,507.34 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 (2009) 第 068 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 4 月 13 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,754,868,668.80 份基金份额, 其中认购资金利息折合 182,161.46 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》和《华安强化收益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为 A 类;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。其中,金融债、企业 (公司) 债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券等除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值的 30%; 持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具,包括一级市场的新股申购或增发新股、因可转债转股或因权证行权所形成的股票、因持仓股票所派发或因参与可分离债券一级市场申购而产生的权证、二级市场股票等法律法规或监管机构允许基金投资的其他非固定收益类品种。本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为:中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2011 年 8 月 26 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则-基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告 [2010] 5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税 [2002] 128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2005] 102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税 [2005] 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《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人、基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

无。

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,023,751.72	3,754,176.91
其中:支付销售机构的客户维护费	302,511.35	464,792.77

注: 支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.7%的年费率计提, 逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.7% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	578,214.86	1,072,622.01

注:支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值×0.2% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B	合计
华安基金管理有限公司	-	69,384.13	69,384.13
中国工商银行股份有限公司	-	229,919.05	229,919.05
合计	-	299,303.18	299,303.18
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B	合计
华安基金管理有限公司	-	73,205.12	73,205.12
中国工商银行股份有限公司	-	385,941.51	385,941.51
合计	-	459,146.63	459,146.63

注:A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的 B 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.4%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给华安基金管理有限公司,再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日 B 类基金份额的基金资产净值×0.4% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券 (含回购) 交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行股份有限公司	-	10,654,167.81	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.8.5 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 6 月 30 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	5,478,039.50	161,615.31	40,090,625.19	524,035.26

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末 (2011 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002596	海南瑞泽	2011-06-24	2011-07-07	网上新股申购	12.15	12.15	500	6,075.00	6,075.00	-
300240	飞力达	2011-06-29	2011-07-06	网上新股申购	20.00	20.00	500	10,000.00	10,000.00	-
601798	蓝科高新	2011-06-14	预计 2011-09-22	网下新股申购	11.00	13.27	49,658	546,238.00	658,961.66	-

注:基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 15,199,857.20 元,以如下债券作为质押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
080210	08国开 10	2011-07-05	101.49	160,000	16,238,400.00
合计		-	-	160,000	16,238,400.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止, 基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 125,900,000.00 元,于 2011 年 7 月 1 日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

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	35,441,948.65	5.54
	其中:股票	35,441,948.65	5.54
2	固定收益投资	584,526,433.39	91.41
	其中:债券	584,526,433.39	91.41
	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	8,621,113.00	1.35
6	其他各项资产	10,874,622.05	1.70
7	合计	639,464,117.09	100.00

7.2 期末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、渔业	-	-
B	采掘业	2,363,128.00	0.48
C	制造业	27,479,520.65	5.57
C0	食品、饮料	3,767,730.00	0.76
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	8,878,085.45	1.80
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	5,708,043.54	1.16
C7	机械、设备、仪表	9,125,661.66	1.85
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	286,800.00	0.06
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	10,000.00	0.00
G	信息技术业	5,302,500.00	1.07
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	35,441,948.65	7.18

7.3 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	000063	中兴通讯	187,500	5,302,500.00	1.07
2	000422	湖北宜化	222,565	4,658,285.45	0.94
3	600160	巨化股份	130,000	4,219,800.00	0.85
4	000527	美的电器	206,000	3,788,340.00	0.77
5	600425	青松建化	136,630	2,844,636.60	0.58
6	000651	格力电器	113,000	2,655,500.00	0.54
7	600395	盘江股份	71,200	2,363,128.00	0.48
8	600519	贵州茅台	11,000	2,338,930.00	0.47
9	000530	大冷股份	170,000	1,888,700.00	0.38
10	600585	海螺水泥	60,000	1,665,600.00	0.34

注: 投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细, 应阅读登载于 www.huaan.com.cn 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002542	中化岩土	20,720,000.00	3.06
2	600068	葛洲坝	18,292,918.44	2.70
3	000527	美的电器	11,334,235.32	1.67
4	000422	湖北宜化	10,142,787.45	1.50
5	600395	盘江股份	9,043,040.34	1.33
6	000063	中兴通讯	8,470,327.32	1.25
7	000983	西山煤电	7,845,001.43	1.16
8	002233	塔牌集团	7,736,534.62	1.14
9	600425	青松建化	6,996,533.90	1.03
10	600160	巨化股份	6,395,164.46	0.94
11	600426	华鲁恒升	5,557,806.88	0.82
12	600284	浦东建设	5,454,379.03	0.80
13	000680	山推股份	5,340,226.00	0.79
14	000937	冀中能源	4,855,376.08	0.72
15	600519	贵州茅台	4,750,979.40	0.70
16	000630	铜陵有色	4,742,195.22	0.70
17	000651	格力电器	3,663,704.81	0.54
18	600644	乐山电力	3,374,494.00	0.50
19	600690	青岛海尔	3,245,890.81	0.48
20	600674	川投能源	2,953,382.99	0.44

注:本项“买入金额”均按买卖成交金额 (成交单价乘以成交数量) 填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	20,581,244.42	3.03
2	600068	葛洲坝	19,685,017.73	2.90
3	002542	中化岩土	18,304,719.04	2.70
4	601118	海南橡胶	9,285,877.69	1.37
5	600276	恒瑞医药	7,581,711.43	1.12
6	000983	西山煤电	7,338,870.94	1.08
7	000527	美的电器	7,128,893.68	1.05
8	002233	塔牌集团	6,765,994.03	1.00
9	600395	盘江股份	5,599,111.00	0.83
10	600426	华鲁恒升	5,571,803.91	0.82
11	002056	横店东磁	5,468,880.81	0.81
12	000680	山推股份	5,393,588.46	0.80
13	600284	浦东建设	5,267,609.93	0.78
14	000422	湖北宜化	5,231,790.70	0.77
15	000630	铜陵有色	4,543,792.85	0.67
16	000937	冀中能源	4,499,725.16	0.66
17	300142	沃森生物	4,260,195.58	0.63
18	600425	青松建化	3,504,430.80	0.52
19	300134	大富科技	3,318,899.42	0.49
20	600690	青岛海尔	3,231,188.21	0.48

注:本项“卖出金额”均按买卖成交金额 (成交单价乘以成交数量) 填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	184,584,110.07
卖出股票的收入(成交)总额	228,309,531.30

注:本项“买入股票的成本 (成交) 总额”和“卖出股票的收入 (成交) 总额”均按买卖成交金额 (成交单价乘以成交数量) 填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	55,479,649.00	11.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	60,894,000.00	12.33
	其中:政策性金融债	60,894,000.00	12.33
4	企业债券	286,926,973.53	58.12
5	企业短期融资券	129,676,000.00	26.27
6	中期票据	-	-
7	可转债	51,549,810.86	10.44
8	其他	-	-
9	合计	584,526,433.39	118.40

7.6 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	080210	08国开 10	600,000	60,894,000.00	12.33
2	122957	09蓉工投	470,590	47,200,177.00	9.56
3	1080105	10铁道 01	500,000	44,885,000.00	9.09
4	1181183	11津城建 CP01	400,000	39,860,000.00	8.07
5	122033	09富力债	337,680	35,233,531.20	7.14

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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的,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。

7.9.2 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。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	356,162.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	10,428,217.57
5	应收申购款	90,242.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,874,622.05

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	15,414,680.00	3.12
2	110003	新钢转债	10,304,242.00	2.09
3	110011	歌华转债	4,398,694.20	0.89

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。
况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安强化收益债券 A	4,775	64,433.42	193,667,349.34	62.95%	114,002,223.74	37.05%
华安强化收益债券 B	4,517	40,084.37	21,592,166.34	11.93%	159,468,927.33	88.07%
合计	9,292	52,596.93	215,259,515.68	44.04%	273,471,151.07	55.96%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属两级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属两级基金份额的合计数 (即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	华安强化收益债券 A	2,633.96	0.00%
	华安强化收益债券 B	808.69	0.00%
	合计	3,442.65	0.00%

注:分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数 (即期末基金份额总额)。

9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
基金合同生效日 (2009 年 4 月 13 日) 基金份额总额	1,433,106,240.88	1,321,762,427.92
本报告期期初基金份额总额	446,518,530.73	217,161,010.52
本报告期基金总申购份额	147,016,978.72	38,477,613.60
减:本报告期基金总赎回份额	285,865,936.37	74,577,530.45
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	307,669,573.08	181,061,093.67

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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

报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安证券股份有限公司	1	7,621,123.65	2.02%	6,192.10	1.97%	-
中国国际金融有限公司	1	17,416,469.70	4.61%	14,803.98	4.70%	-
安信证券股份有限公司	1	1,139,641.00	0.30%	925.96	0.29%	-
中国建银投资证券有限责任公司	2	36,134,607.40	9.56%	29,359.26	9.32%	-
北京高华证券有限责任公司	1	37,579,682.50	9.94%	30,533.60	9.69%	-
东北证券有限责任公司	1	6,323,508.42	1.67%	5,374.91	1.71%	-
齐鲁证券有限公司	1	3,379,484.75	0.89%	2,872.52	0.91%	-
信达证券股份有限公司	1	26,065,514.77	6.90%	22,155.42	7.03%	-
中天证券有限责任公司	1	84,891,063.76	22.46%	68,974.02	21.89%	-
华融证券股份有限公司	1	99,232,460.57	26.25%	84,347.11	26.77%	-
东兴证券股份有限公司	1	58,232,161.41	15.40%	49,497.20	15.71%	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际有限责任公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	16,955,825.53	3.03%	527,000,000.00	8.85%	-	-
安信证券股份有限公司	3,612,944.01	0.64%	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	2,310,441.18	0.41%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	2,999,580.00	0.54%	-	-	-	-
东北证券有限责任公司	-	-	499,100,000.00	8.38%	-	-
齐鲁证券有限公司	6,651,601.90	1.19%	255,000,000.00	4.28%	-	-
信达证券股份有限公司	34,330,726.60	6.13%	1,103,000,000.00	18.52%	-	-
中天证券有限责任公司	16,028,759.83	2.86%	-	-	-	-
华融证券股份有限公司	279,265,455.55	49.83%	3,300,200,000.00	55.40%	-	-
东兴证券股份有限公司	19,314,629.30	3.45%	272,500,000.00	4.57%	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
广发华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国都证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
恒泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
民生证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	106,858,755.82	19.07%	-	-	-	-
世纪证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	72,133,960.41	12.87%	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

注: 1、本报告期内,本基金和华安中小盘成长股票、华安动态灵活配置混合、华安稳固收益债券共同变更交易单元如下:

新增交易单元:

新增安信证券股份有限公司深圳交易单元 1 个;

新增华创证券有限责任公司上海交易单元 1 个;

退租交易单元:无。

2、券商专用交易单元选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其交易单元供本基金证券买卖专用,选择标准为:

(1)内部管理规范、严谨;具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(2)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能够针对本基金业务需要,提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(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;

(4)其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》,对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部或基金投资部/市场部汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果,择优选出拟新增单元,填写《新增交易单元申请审核表》,对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或基金投资部/市场部提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核,并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》,并通知基金托管人。

华安基金管理有限公司
二〇一一年八月二十九日