华安策略优选股票型证券投资基金

2011 年度报告摘要

2011年 12 月 31 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：二〇一二年三月二十九日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 12 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 2011 年 1 月 1 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	华安策略优选股票	
基金主代码	040008	
交易代码	040008（前端）	041008（后端）
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	
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	
报告期末基金份额总额	14,508,165,473.44 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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、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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	-1,421,285,312.84	1,323,759,085.61	763,640,792.08
本期利润	-3,111,306,408.00	-476,396,842.16	6,373,988,310.85
加权平均基金份额本期利润	-0.2077	-0.0284	0.3396
本期基金份额净值增长率	-25.87%	-2.88%	67.60%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.2045	-0.1077	-0.1898
期末基金资产净值	8,666,872,211.33	12,737,751,843.20	14,627,669,405.86
期末基金份额净值	0.5974	0.8059	0.8298

注：1、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

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

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

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	-6.26%	1.24%	-5.48%	1.12%	-0.78%	0.12%
过去六个月	-13.94%	1.14%	-15.62%	1.09%	1.68%	0.05%
过去一年	-25.87%	1.19%	-17.44%	1.06%	-8.43%	0.13%
过去三年	20.66%	1.44%	20.95%	1.34%	-0.29%	0.10%
自基金合同生效起至今	-32.92%	1.61%	-30.96%	1.66%	-1.96%	-0.05%

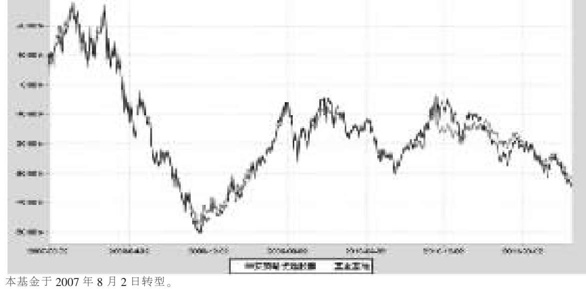
注：本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%；债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 86.74%，债券的投资比例为基金资产净值的 7.64%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 10.62%。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

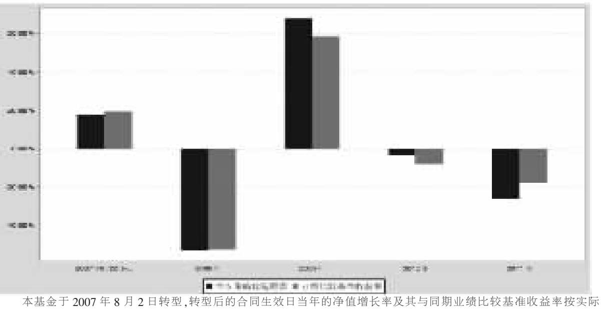
华安策略优选股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2007 年 8 月 2 日至 2011 年 12 月 31 日）



本基金于 2007 年 8 月 2 日转型。

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

华安策略优选股票型证券投资基金
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，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
2011年	–	–	–	–	–
2010年	–	–	–	–	–
2009年	–	–	–	–	–
合计	–	–	–	–	–

§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 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、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、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、华安动态灵活配置混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头 ETF、华安上证龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安深证 300 指数（LOF）、华安稳固收益债券、华安可转债债券、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安香港精选股票（QDII）、华安大中华升级股票（QDII）等 24 只开放式证券投资基金，管理资产规模达到 795.34 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	2010-09-20	–	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：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。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 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，风险管理部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

华安旗下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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年，国内在高通胀的背景下，宏观调控压力较大；同时海外债务危机愈演愈烈，使得国内政策腾挪空间狭窄。受资金紧张、原材料价格高企以及需求放缓的影响，企业盈利面临增长压力。股票市场的扩容和流动性紧缩带来估值中枢快速下移，市场整体缺乏系统性机会。

报告期内，年初本基金对市场的估值风险估计不足，对高估值的战略新兴产业、医药、消费等板块保持了较高的配置。在市场估值快速下降的过程中，相关板块表现较差，配置效果不理想。下半年本基金在配置策略上有所调整，提高了组合的防御性，对基金业绩起到积极作用。主要是降低了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，同时对全年业绩增长确定，估值安全的重点品种提高了配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.5974 元，本报告期份额净值增长率为 -25.87%，同期业绩比较基准增长率为-17.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2012 年，实体经济经过调整实现软着陆的概率较大，通胀压力将逐步缓解。在经济调整过程中，企业盈利处于快速下滑阶段。市场对上市企业利润增长的预期已大幅下调，考虑经济自身的韧性和可能对冲风险的政策，低估值的大盘蓝筹板块和超跌的周期类品种有估值修复空间。中期看，经济仍面临较大的结构性矛盾，政策也难以出现超预期的放松，市场整体难以改变反复震荡的格局。股票市场供给压力仍较大，相当多的中小市值股票仍处在挤泡沫过程中，估值和业绩的风险尚未释放完。对成长类板块的投资，将由炒预期阶段过渡到需要业绩支撑的阶段。

基于以上判断，本基金仍将坚持在符合转型方向的大消费、信息技术、医药等板块选择估值合理、成长性确定的个股进行配置。同时对于估值已含悲观预期和盈利预期已充分下调的大盘蓝筹股将采取更加积极的配置策略。

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

（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，2011 年 8 月 24 日离职，离任前华安基金管理有限公司副总裁。

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。

宋磊，投资研究部联席总监，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、投资研究部联席总监。

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、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，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、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 年度，基金托管人在华安策略优选股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2011 年度，华安基金管理有限公司在华安策略优选股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

2011 年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安策略优选股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§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、金毅签字出具了普华永道中天审字（2012）第 20651 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读年度报告正文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安策略优选股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2011年 12 月 31 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	189,308,287.54	1,387,614,920.12
结算备付金	144,829,324.84	277,596,856.83
存出保证金	6,019,396.42	7,868,888.20
交易性金融资产	8,180,102,267.03	11,076,829,933.93
其中：股票投资	7,517,795,027.23	10,850,690,900.33
基金投资	–	–
债券投资	662,307,239.80	226,139,033.60
资产支持证券投资	–	–
衍生金融资产	–	–
买入返售金融资产	50,000,195.00	–
应收证券清算款	157,947,897.01	133,135,832.54
应收利息	9,950,398.49	1,139,506.45
应收股利	–	–
应收申购款	422,275.79	1,117,182.73
递延所得税资产	–	–
其他资产	–	–
资产总计	8,738,580,042.12	12,885,303,120.80
负债和所有者权益	本期末 2011年 12 月 31 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	–	–
应付证券清算款	47,649,348.23	105,783,170.41
应付赎回款	2,121,298.06	3,805,881.45
应付管理人报酬	11,325,093.27	16,304,369.00
应付托管费	1,887,515.52	2,717,394.86
应付销售服务费	–	–
应付交易费用	6,685,376.12	17,152,042.78
应交税费	–	–
应付利息	–	–
应付利润	–	–
递延所得税负债	–	–
其他负债	2,039,199.59	1,788,419.10
负债合计	71,707,830.79	147,551,277.60
所有者权益：		
实收基金	5,720,133,037.64	6,231,598,966.59
未分配利润	2,946,739,173.69	6,506,152,876.61
所有者权益合计	8,666,872,211.33	12,737,751,843.20
负债和所有者权益总计	8,738,580,042.12	12,885,303,120.80

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.5974 元，基金份额总额 14,508,165,473.44 份。

7.2 利润表

会计主体：华安策略优选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入	-2,853,904,590.56	-173,672,303.64
1.利息收入	22,510,288.20	26,326,974.87
其中：存款利息收入	10,256,728.33	15,513,901.95
债券利息收入	8,347,796.11	8,097,028.98
资产支持证券利息收入	–	–
买入返售金融资产收入	3,905,763.76	2,716,043.94
其他利息收入	–	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	-1,186,562,220.41	1,599,841,107.70
其中：股票投资收益	-1,271,395,209.71	1,526,869,323.68
基金投资收益	–	–
债券投资收益	92,970.84	-1,535,780.00
资产支持证券投资收益	–	–
衍生工具收益	–	–
股利收益	84,740,018.46	74,507,564.02
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,690,021,095.16	-1,800,155,927.77
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	–	–
5.其他收入（损失以“-”号填列）	168,436.81	315,541.56
减：二、费用	257,401,817.44	302,724,538.52
1.管理人报酬	158,797,335.36	187,623,582.45
2.托管费	26,466,222.59	31,270,597.17
3.销售服务费	–	–
4.交易费用	71,523,798.15	83,167,012.27
5.利息支出	115,568.49	167,762.34
其中：卖出回购金融资产支出	115,568.49	167,762.34
6.其他费用	498,892.85	495,584.29
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-3,111,306,408.00	-476,396,842.16
减：所得税费用	–	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-3,111,306,408.00	-476,396,842.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安策略优选股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 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）	6,231,598,966.59	6,506,152,876.61	12,737,751,843.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-3,111,306,408.00	-3,111,306,408.00
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）	-511,465,928.95	-448,107,294.92	-959,573,223.87
其中：1.基金申购款	62,138,591.81	49,341,995.87	111,480,587.68
2.基金赎回款	-573,604,520.76	-497,449,290.79	-1,071,053,811.55
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）	5,720,133,037.64	2,946,739,173.69	8,666,872,211.33
项目	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 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）	6,949,879,490.16	7,677,789,915.70	14,627,669,405.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	–	-476,396,842.16	-476,396,842.16
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）	-718,280,523.57	-695,240,196.93	-1,413,520,720.50
其中：1.基金申购款	182,169,262.70	174,579,850.92	356,749,113.62
2.基金赎回款	-900,449,786.27	-869,820,047.85	-1,770,269,834.12
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）	6,231,598,966.59	6,506,152,876.61	12,737,751,843.20

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码从 7.1 至 7.4，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：赵敏，会计机构负责人：陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安策略优选股票型证券投资基金是根据原安久证券投资基金（以下简称“基金安久”）基金份额持有人大会 2007 年 6 月 29 日审议通过的《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字［2007］210 号《关于核准安久证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安久转型而来。原基金安久为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所（以下简称“深交所”）交易上市，存续期限至 2007 年 8 月 30 日止。根据中国证监会批复及深交所深证复［2007］41 号《关于同意安久证券投资基金终止上市的批复》，原基金安久于 2007 年 8 月 1 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 8 月 2 日起，原基金安久终止上市，原基金安久更名为华安策略优选股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），《安久证券投资基金基金合同》失效的同时《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金安久于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,129,381,474.76 元，已于本基金的合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金于 2007 年 8 月 20 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1：2.536335136，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 8 月 15 日开放集中申购，共募集人民币 9,853,567,332.90 元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计人民币 318,719.94 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（2007）第 111 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 8 月 20 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,853,567,332.90 份基金份额，其中集中申购资金利息折合 318,719.94 份基金份额，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%；债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率×80%+中信标普国债指数收益率×20%。

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 2012 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 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》、《 华安策略优选基金型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气（集团）总公司	基金管理人的股东
上海工业投资（集团）有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期和上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	158,797,335.36	187,623,582.45
其中：支付销售机构的客户维护费	36,851,889.45	43,708,491.48

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 1.5%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 X 1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,466,222.59	31,270,597.17

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 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

本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
交通银行	79,729,102.95	–	200,000,000.00	32,153.15	–	–
上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	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
交通银行	–	–	1,250,000,000.00	216,605.96	–	–

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

单位：份

项目	本期 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	40,431,464.44	40,431,464.44
期间申购/买入总份额	–	–
期间因拆分变动份额	–	–
减：期间赎回/卖出总份额	–	–
期末持有的基金份额	40,431,464.44	40,431,464.44
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.28%	0.26%

7.4.8.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2011 年 12 月 31 日）和上年度末（2010 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2010年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	189,308,287.54	3,191,464.78	1,387,614,920.12	4,471,812.93

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2011 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2010 年 12 月 31 日：同）。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1 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
601336	新华保险	2011-12-09	2012-03-16	新股网下申购	23.25	27.87	174,882	4,066,006.50	4,873,961.34	–
601555	东吴证券	2011-12-06	2012-03-12	新股网下申购	6.50	6.57	2,532,429	16,460,788.50	16,638,058.53	–
601669	中国水电	2011-09-29	2012-01-18	新股网下申购	4.50	4.09	28,648,917	128,920,126.50	117,174,070.53	–
300278	华昌达	2011-12-09	2012-03-16	新股网下申购	16.56	14.79	1,080,000	17,884,800.00	15,973,200.00	–

7.4.9.2 受限证券类别：债券

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

7.4.9.3 受限证券类别：

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

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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金截至 2011 年 12 月 31 日止未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

（1） 公允价值

（a）不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

（b）以公允价值计量的金融工具

（i）金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

（ii）各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 7,684,888,267.03 元，属于第二层级的余额为 495,214,000.00 元，无属于第三层级的余额（2010 年 12 月 31 日：第一层级 10,817,335,971.89 元，第二层级 259,493,962.04 元，无属于第三层级的余额）。

（iii）公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

（iv）第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具（2010 年 12 月 31 日：同）。本基金本期净转入/（转出）第三层级零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元（2010 年度：无），涉及河南双汇投资发展股份有限公司（“双汇发展”）发行的股票。

（2）除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	7,517,795,027.23	86.03
	其中：股票	7,517,795,027.23	86.03
2	固定收益投资	662,307,239.80	7.58
	其中：债券	662,307,239.80	7.58
	资产支持证券	–	–
3	金融衍生品投资	–	–
4	买入返售金融资产	50,000,195.00	0.57
	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	334,137,612.38	3.82
6	其他各项资产	174,339,967.71	2.00
7	合计	8,738,580,042.12	100.00

8.2 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	15,784,406.19	0.18
C	制造业	3,902,009,709.65	45.02
C0	食品、饮料	116,614,261.04	1.35
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	142,155,072.00	1.64
C5	电子	232,741,970.88	2.69
C6	金属、非金属	34,672,128.16	0.40
C7	机械、设备、仪表	2,420,988,208.83	27.93
C8	医药、生物制品	954,838,068.74	11.02
C99	其他制造业	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	185,279,965.79	2.14
F	交通运输、仓储业	–	–
G	信息技术业	1,290,142,208.22	14.89
H	批发和零售贸易	885,196,047.20	10.21
I	金融、保险业	1,059,302,518.59	12.22
J	房地产业	–	–
K	社会服务业	180,080,171.59	2.08
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合计	7,517,795,027.23	86.74

8.3 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	600741	华域汽车	48,612,113	450,148,166.38	5.19
2	002269	美邦服饰	17,008,173	441,702,252.81	5.10
3	000550	江铃汽车	19,129,434	382,397,385.66	4.41
4	600570	恒生电子	30,485,501	373,142,532.24	4.31
5	600104	上海汽车	25,611,241	362,142,947.74	4.18
6	000063	中兴通讯	19,485,541	329,305,642.90	3.80
7	002152	广电运通	13,288,693	308,962,112.25	3.56
8	601318	中国平安	7,565,118	260,542,663.92	3.01
9	601601	中国太保	13,281,396	255,135,617.16	2.94
10	600276	恒瑞医药	8,511,274	250,571,906.56	2.89

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 http://www.huaan.com.cn 网站的年度报告正文

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000063	中兴通讯	1,170,623,066.74	9.19
2	002008	大族激光	803,873,636.84	6.31
3	601288	农业银行	713,524,379.66	5.60
4	600000	浦发银行	711,356,672.52	5.58
5	601318	中国平安	588,749,706.76	4.62
6	600741	华域汽车	578,483,629.61	4.54
7	000550	江铃汽车	505,178,096.81	3.97
8	600383	金地集团	495,797,288.40	3.89
9	601601	中国太保	494,046,451.71	3.88
10	000002	万 科 A	477,889,462.47	3.75
11	600261	阳光照明	473,488,870.24	3.72
12	600570	恒生电子	456,571,453.56	3.58
13	600028	中国石化	438,289,894.99	3.44
14	600537	亿晶光电	426,655,542.76	3.35
15	600837	海通证券	400,966,946.04	3.15
16	002269	美邦服饰	387,982,815.93	3.05
17	002152	广电运通	332,931,457.48	2.61
18	600276	恒瑞医药	327,066,544.86	2.57
19	601106	中国一重	326,112,226.53	2.56
20	000629	攀钢钒钛	307,495,844.88	2.41
21	601808	中海油服	300,028,574.50	2.36
22	600104	上海汽车	299,837,275.42	2.35
23	600588	用友软件	278,683,858.54	2.19
24	601766	中国南车	268,194,175.19	2.11
25	000012	南 玻 A	266,346,760.70	2.09

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

8.4.2 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	600104	上海汽车	783,219,293.58	6.15
2	601288	农业银行	735,503,988.70	5.77
3	600000	浦发银行	701,370,586.34	5.51
4	000063	中兴通讯	700,920,409.91	5.50
5	000629	攀钢钒钛	585,536,703.64	4.60
6	601601	中国太保	578,731,184.06	4.54
7	002008	大族激光	575,407,584.29	4.52
8	600588	用友软件	496,429,788.70	3.90
9	601318	中国平安	477,737,907.79	3.75
10	600383	金地集团	475,857,114.75	3.74
11	600312	平高电气	464,329,812.19	3.65
12	000002	万 科 A	455,632,159.82	3.58
13	601106	中国一重	432,640,974.66	3.40
14	600028	中国石化	401,087,146.41	3.15
15	000012	南 玻 A	398,663,432.52	3.13
16	600660	福耀玻璃	370,078,301.85	2.91
17	000792	盐湖股份	369,185,467.38	2.90
18	601808	中海油服	343,169,720.13	2.69
19	002024	苏宁电器	330,354,419.48	2.59
20	600261	阳光照明	325,139,804.26	2.55
21	600537	亿晶光电	323,521,647.75	2.54
22	600600	青岛啤酒	313,374,976.16	2.46
23	002123	荣信股份	308,365,788.70	2.42
24	000625	长安汽车	302,058,966.79	2.37
25	600362	江西铜业	295,435,210.85	2.32
26	002007	华兰生物	289,161,498.76	2.27
27	600276	恒瑞医药	283,481,971.18	2.23
28	601766	中国南车	282,809,305.24	2.22
29	600100	同方股份	282,350,527.28	2.22
30	600467	好当家	271,610,590.25	2.13

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	23,251,170,106.39
卖出股票的收入（成交）总额	23,649,690,358.42

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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。

8.5 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	485,221,000.00	5.60
2	央行票据	–	–
3	金融债券	9,993,000.00	0.12
	其中：政策性金融债	9,993,000.00	0.12
4	企业债券	–	–
5	企业短期融资券	–	–
6	中期票据	–	–
7	可转债	167,093,239.80	1.93
8	其他	–	–
9	合计	662,307,239.80	7.64

8.6 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	119903	11贴现国债 03	2,700,000	265,221,000.00	3.06
2	113001	中行转债	1,701,870	160,962,864.60	1.86
3	110011	11附息国债 11	1,200,000	120,000,000.00	1.38
4	110009	11附息国债 09	1,000,000	100,000,000.00	1.15
5	110222	11国开 22	100,000	9,993,000.00	0.12

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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，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。

8.9.2 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。

8.9.3 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	6,019,396.42
2	应收证券清算款	157,947,897.01
3	应收股利	–
4	应收利息	9,950,398.49
5	应收申购款	422,275.79
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	174,339,967.71

8.9.4 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	160,962,864.60	1.86
2	110011	歌华转债	6,130,375.20	0.07

8.9.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
1,409,378	10,294.02	315,412,356.52	2.17%	14,192,753,116.92	97.83%

9.29.3 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	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	151,145.61	0%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007 年 8 月 2 日）基金份额总额	500,000,000
本报告期期初基金份额总额	15,805,415,358.39
本报告期期间基金总申购份额	157,603,964.59
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,454,853,849.54
本报告期期间基金拆分变动份额	–
本报告期期末基金份额总额	14,508,165,473.44

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 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

1、本基金管理人重大人事变动如下：

（1）2011 年 8 月 26 日，基金管理人发布了基金行业高级管理人员变更公告，李炳旺副总经理因个人原因辞职；

（2）2011 年 9 月 17 日，基金管理人发布了关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举朱仲群先生、李勍先生为本公司董事，俞妙根先生、陈兵先生不再担任本公司董事；

（3）2011 年 9 月 17 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，俞妙根董事长因个人原因辞职，由李勍总经理代任董事长职务；

（4）2011 年 9 月 24 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，韩勇副总经理因个人原因辞职；

（5）2011 年 11 月 12 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，邵杰军副总经理因个人原因辞职；

（6）2011 年 12 月 16 日，基金管理人发布了关于基金行业高级管理人员变更公告，朱仲群先生任华安基金管理有限公司董事长。朱仲群先生经中国证监会核准取得高管任职资格。李勍总经理不再代行董事长职务。

2、本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼事项。报告期内无涉及本基金财产的诉讼事项。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金改聘为其审计的会计师事务所情况：无。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况：人民币 159,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2007 年 8 月 2 日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信证券股份有限公司	1	6,017,310,201.50	12.90%	4,889,094.57	12.58%	–
东方证券股份有限公司	2	5,258,743,388.60	11.27%	4,278,403.57	11.01%	–
光大证券股份有限公司	1	4,684,153,771.21	10.04%	3,805,902.20	9.79%	–
江海证券有限公司	1	4,675,730,863.62	10.02%	3,974,360.18	10.22%	–
华泰联合证券有限责任公司	2	3,907,147,307.35	8.38%	3,203,816.87	8.24%	–
安信证券股份有限公司	1	3,624,868,929.13	7.77%	3,081,123.74	7.93%	–
瑞银证券有限责任公司	1	3,524,006,473.84	7.56%	2,995,385.06	7.71%	–
华宝证券有限责任公司	1	3,197,742,642.66	6.86%	2,718,061.32	6.99%	–
中航证券有限公司	1	1,832,869,707.81	3.93%	1,557,930.88	4.01%	–
国金证券股份有限公司	1	1,359,261,898.05	2.91%	1,155,368.75	2.97%	–
国元证券股份有限公司	1	1,223,279,905.40	2.62%	1,039,785.70	2.67%	–
中信金通证券有限责任公司	1	1,218,571,006.92	2.61%	1,035,780.82	2.66%	–
浙商证券有限责任公司	1	1,173,249,932.46	2.52%	997,261.65	2.57%	–
国海证券有限责任公司	1	1,004,101,189.38	2.15%	853,481.78	2.20%	–
西部证券股份有限公司	1	925,151,472.25	1.98%	786,379.05	2.02%	–
中银国际证券有限责任公司	1	895,431,076.60	1.92%	727,540.20	1.87%	–
东兴证券股份有限公司	1	858,551,255.51	1.84%	697,578.94	1.79%	–
日信证券有限责任公司	1	851,693,399.68	1.83%	723,939.72	1.86%	–
平安证券有限责任公司	1	412,509,089.04	0.88%	350,632.97	0.90%	–
齐鲁证券有限公司	1	–	–	–	–	–
第一创业证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
申银万国证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中信建投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
东海证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–

11.7.2 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
中信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
东方证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
光大证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
江海证券有限公司	–	–	–	–	–	–
华泰联合证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
安信证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
瑞银证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
华宝证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
中航证券有限公司	–	–	–	–	–	–
国金证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国元证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信金通证券有限责任公司	1,341,746.00	100.00%	–	–	–	–
浙商证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
国海证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
西部证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
东兴证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
日信证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
平安证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	–	–	–	–	–	–
第一创业证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
申银万国证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–
中信建投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–
东海证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–

注：1. 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。

2. 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

由相关部门牵头并组织有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》

牵头部门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相关部门提交的《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。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

新增浙商证券、日信证券和东兴证券 3 个交易单元。

华安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日