华安可转换债券债券型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司
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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年3月23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6月22日(基金合同生效日)起至2011年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安可转债债券	
基金主代码	040022	
交易代码	040022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	794,543,583.32份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
下属分级基金的交易代码	040022	040023
报告期末下属分级基金的份额总额	553,029,238.84份	241,514,344.48份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于兼具债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种,在控制风险和保持流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调收益的安全性与稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的较高收益。
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的品种。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201

2.4 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、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	2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日	
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
本期已实现收益	-2,904,852.97	-1,267,788.08
本期利润	-23,537,477.70	-11,510,501.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0381	-0.0333
本期基金份额净值增长率	-4.00%	-4.20%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
期末可供分配基金份额利润	-0.0398	-0.0416
期末基金资产净值	530,999,648.73	231,456,812.46
期末基金份额净值	0.960	0.958

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)。

4. 本基金于2011年6 月22 日成立。截止本报告期末,本基金成立不足一年。

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

华安可转债债券A类:

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	2.24%	0.51%	3.37%	0.50%	-1.13%	0.01%
过去六个月	-4.10%	0.45%	-7.77%	0.54%	3.67%	-0.09%
自基金成立起至今	-4.00%	0.44%	-7.33%	0.53%	3.33%	-0.09%

华安可转债债券B类:

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	2.13%	0.51%	3.37%	0.50%	-1.24%	0.01%
过去六个月	-4.30%	0.45%	-7.77%	0.54%	3.47%	-0.09%
自基金成立起至今	-4.20%	0.44%	-7.33%	0.53%	3.13%	-0.09%

注:本基金业绩比较基准为:天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300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,投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。重点投资于固定收益类证券,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等。

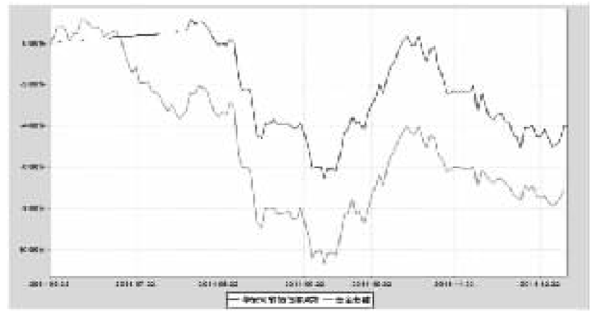
本基金的投资组合比例为:固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

截至2011年12月31日,本基金持有的固定收益类资产的投资比例为基金资产净值的98.18%,其中投资于可转债(含分离交易可转债)的投资比例为固定收益类资产的91.43% 投资于股票、权证等非固定收益类资产的比例为基金资产净值的13.25%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的8.19%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

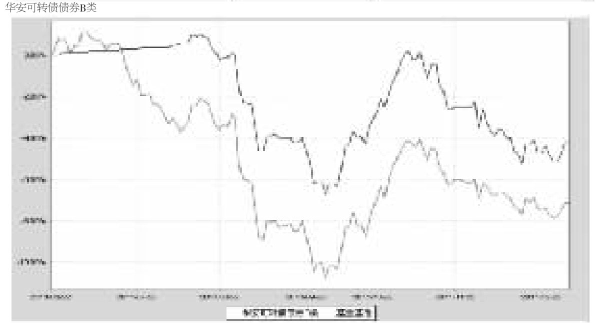
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安可转换债券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
(2011年6月22日至2011年12月31日)

华安可转债债券A类



华安可转债债券B类



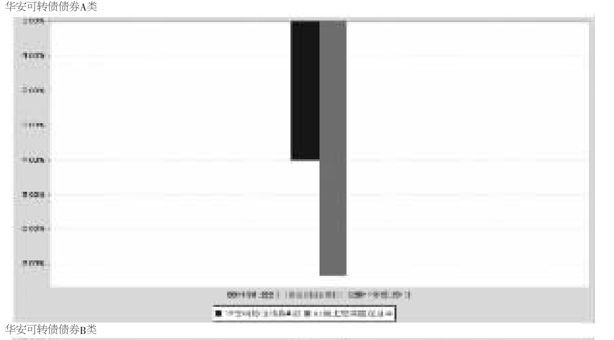
注:1.本基金于2011年6月22日成立,截止本报告期期末,本基金成立不满一年。

2.根据《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》,本基金建仓期为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中投资范围、投资限制的有关约定。

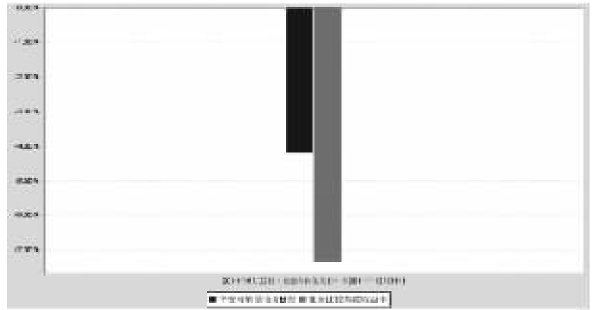
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安可转换债券债券型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图

华安可转债债券A类



华安可转债债券B类



注: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

无。

§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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的基金经理	2011-06-22	-	14年	金融学硕士(金融工程方向),14年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员,华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008年4月起担任华安稳定收益债券基金的基金经理。2011年6月起同时担任本基金的基金经理。

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《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金招募说明书》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

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

2011年没有出现异常交易。

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GDP前高后低,通胀冲高回落。前三季度为抑制通胀,央行进行了严格的信贷管控、六次上调法定存款准备金率、三次加息,并于8月底将保证金存款纳入法定存准缴纳范围。市场资金面持续紧张,银行间回购利率波动上行,下半年持续保持相对高位。中长期国债收益率高位震荡,收益率曲线扁平化。个别城投企业的信用事件和某些地区高利贷资金链断裂风险引发了市场对信用债违约风险的担忧,信用利差持续上行并屡创新高。可转债市场加速扩容,受累于资金面紧张、供给预期恶化、股指重心下移以及缺乏回售条款保护,二、三季度可转债市场跌幅较大,可转债估值向纯债价值靠拢。进入四季度,鉴于欧债危机恶化、地产调控初显成效、通胀回落,宏观调控开始转向“预调微调”,央行下调存准一次。经济下行预期引导中长期债券收益率快速回落,高等级信用债信用利差逐步收窄,低等级信用债收益率仍维持高位。尽管股指反弹失败破位下行,但可转债市场出现相对独立的估值修复行情。新股申购整体收益大幅下降,打新风险上升。

华安可转债基金成立初期较好规避了市场下跌风险,但后续市场下跌幅度仍超出预期。组合立足正股基本面和转债估值,精选偏股型和偏债型转债,稳固防御的同时积极择机进攻。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2011年12月31日, 本基金资产净值为7.62亿元,A类份额累计净值0.960,B类份额累计净值0.958, 本报告期A类份额净值增长率为-4.00%,B类份额净值增长率为-4.20%,同期业绩比较基准增长率为-7.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

为应对危机,欧美等央行持续向金融市场注入大量流动性,银行体系短期崩溃的风险得以化解,为欧债危机的解决争取了时间。展望2012年,欧洲经济将呈现两极分化,欧债问题仍较扰动金融市场,但实体经济衰退程度或好于预期。美国经济将保持“低速”复苏态势、失业率缓步下行。国内经济硬着陆风险降低,整体将呈现前低后高的“软着陆”态势,增速有所降低、波幅或较平缓。宏观政策“稳中求进”、继续“预调微调”防范下行风险。通胀加速下行,CPI低点或出现在三季度。受制于外汇占款增速下降、商业银行较高的存贷比,预计M2将保持相对低位,但通胀下行实际货币供量有所上升。预计法定准备金率仍有下调空间。经济软着陆预期将改善市场风险厌恶程度,另从大类资产选择的角度,随着债券收益率走低、资金供给的增加,偏权益类资产吸引力逐步上升。可转债市场目前估值仍较低,而股债结合的特性将受益于大类资产配置的转换。我们将结合正股和转债的估值,寻找安全边际较高、流动性好、弹性相对较大的个券构建组合,对转债仓位进行动态调整。控制股票仓位,精选个股分散投资。本基金将秉承稳健、专业的投资理念,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,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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,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、金毅签字出具了普华永道中天审字(2012)第20657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:华安可转换债券债券型证券投资基金
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
资 产:	
银行存款	12,519,592.46
结算备付金	3,990,133.40
存出保证金	250,000.00
交易性金融资产	849,592,184.73
其中:股票投资	101,041,527.49
基金投资	-
债券投资	748,550,657.24
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	2,621,562.51
应收股利	-
应收申购款	160,235.88
递延所得税资产	-
其他资产	-
资产总计	869,133,708.98
负债和所有者权益	本期末 2011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	100,000,000.00
应付证券清算款	78,520.48
应付赎回款	5,191,155.77
应付管理人报酬	468,049.51
应付托管费	133,728.44
应付销售服务费	71,260.92
应付交易费用	96,517.82
应交税费	83,937.60
应付利息	9,257.57
应付利润	-
递延所得税负债	-
其他负债	544,819.68
负债合计	106,677,247.79
所有者权益:	
实收基金	794,543,583.32
未分配利润	-32,087,122.13
所有者权益合计	762,456,461.19
负债和所有者权益总计	869,133,708.98

注:1.报告截止日2011年12月31日,基金份额总额794,543,583.32份,其中华安可转换债券A份额总额553,029,238.84份,华安可转换债券B份额总额241,514,344.48份。华安可转换债券A份额净值0.960元,华安可转换债券B份额净值0.958元。

2.本基金于2011年6月22日成立。本基金报告期间为2011年6月22日至2011年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:华安可转换债券债券型证券投资基金
本报告期:2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
一、收入	-28,836,456.57
1.利息收入	11,311,831.57
其中:存款利息收入	450,908.01
债券利息收入	2,818,968.04
资产支持证券利息收入	259,040.00
买入返售金融资产收入	7,782,915.52
其他利息收入	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-9,317,865.42
其中:股票投资收益	-4,099,038.68
债券投资收益	-5,218,826.74
基金投资收益	-
资产支持证券投资收益	-
衍生工具收益	-
股利收益	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-30,875,338.23
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	44,915.51
减:二、费用	6,211,522.71
1.管理人报酬	3,461,620.89
2.托管费	989,034.52
3.销售服务费	619,828.69
4.交易费用	314,306.03
5.利息支出	515,091.85
其中:卖出回购金融资产支出	515,091.85
6.其他费用	311,640.73
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-35,047,979.28
减:所得税费用	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列	-35,047,979.28

注:本基金于2011年6月22日成立。合同生效当期不是完整报告期。

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安可转换债券债券型证券投资基金
本报告期:2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年6月22日(基金合同生效日)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)	1,287,981,171.43	-	1,287,981,171.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-35,047,979.28	-35,047,979.28
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)	-493,437,588.11	2,960,857.15	-490,476,730.96
其中:1.基金申购款	56,104,395.81	-999,799.83	55,104,595.98
2.基金赎回款	-549,541,983.92	3,960,656.98	-545,581,326.94
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)	794,543,583.32	-32,087,122.13	762,456,461.19

注:本基金于2011年6月22日成立。合同生效当期不是完整报告期。

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)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

华安可转换债券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[2011]第606号《关于核准华安可转换债券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《华安可转换债券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1,287,722,831.15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(2011)第251号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于2011年6月22日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为1,287,981,171.43份基金份额,其中认购资金利息折合258,340.28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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》和《华安可转换债券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《华安可转换债券债券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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300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》、《华安可转换债券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。

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6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31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12月31日的财务状况以及2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日止期间 的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日。

7.4.4.2记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,按照公允价值进行后续计量;对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时,终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列,并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见 本基金合同的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

无。

7.4.5.2会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3差错更正的说明

无。

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”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(“招商银行”)	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

无。

7.4.8.1.2权证交易

无。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

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6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,461,620.89
其中:支付销售机构的客户维护费	1,383,591.81

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。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	989,034.52

注:支付基金托管人招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。

7.4.8.2.3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6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类	合计
华安基金管理有限公司	-	180,684.96	180,684.96
招商银行股份有限公司	-	233,843.81	233,843.81
合计	-	414,528.77	414,528.77

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日B类基金份额资产净值0.35%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给 华安基金公司 ,再由 华安基金公司 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类基金份额资产净值×0.35%/ 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

无。

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

无。

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

无。

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6月22日(基金合同生效日)至2011年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	12,519,592.46	360,586.34

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

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

7.4.12.1.1 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
601928	凤凰传媒	2011-11-24	2012-02-29	新股网下认购	8.80	8.36	398,920	3,510,496.00	3,334,971.20	-
601555	东吴证券	2011-12-06	2012-03-12	新股网下认购	6.50	6.57	506,485	3,292,152.50	3,327,606.45	-
601336	新华保险	2011-12-09	2012-03-16	新股网下认购	23.25	27.87	34,976	813,192.00	974,781.12	-
002649	博彦科技	2011-12-28	2012-01-06	新股网上认购	22.00	22.00	500	11,000.00	11,000.00	-
300284	苏交科	2011-12-29	2012-01-10	新股网上认购	13.30	13.30	500	6,650.00	6,650.00	-

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

无。

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

无。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2011年12月31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100,000,000.00元,于2012年1月6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。

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)。

(i) 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799,558,184.73元, 属于第二层级的余额为50,034,000.00元,无属于第三层级的余额。

(ii) 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

无。

(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	101,041,527.49	11.63
	其中:股票	101,041,527.49	11.63
2	固定收益投资	748,550,657.24	86.13
	其中:债券	748,550,657.24	86.13
	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	16,509,725.86	1.90
6	其他各项资产	3,031,798.39	0.35
7	合计	869,133,708.98	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	6,462,000.00	0.85
C	制造业	25,676,109.81	3.37
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	25,676,109.81	3.37
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	-	-
E	建筑业	19,928,277.69	2.61
F	交通运输、仓储业	10,130,320.64	1.33
G	信息技术业	11,000.00	0.00
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	30,381,387.57	3.98
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	5,117,460.58	0.67
L	传播与文化产业	3,334,971.20	0.44
M	综合类	-	-
	合计	101,041,527.49	13.25

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	601628	中国人寿	600,000	10,584,000.00	1.39
2	600502	安徽水利	767,303	10,304,879.29	1.35
3	601333	广深铁路	2,877,932	10,130,320.64	1.33
4	600068	葛洲坝	1,249,792	9,623,398.40	1.26
5	601601	中国太保	500,000	9,605,000.00	1.26
6	600028	中国石化	900,000	6,462,000.00	0.85
7	601989	中国重工	1,200,000	6,132,000.00	0.80
8	600016	民生银行	1,000,000	5,890,000.00	0.77
9	600893	航空动力	402,069	5,464,117.71	0.72
10	601888	中国国旅	194,846	5,110,810.58	0.67

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600068	葛洲坝	11,513,821.17	1.51
2	600502	安徽水利	11,093,600.35	1.45
3	601601	中国太保	10,292,585.00	1.35
4	601628	中国人寿	10,263,488.61	1.35
5	600547	山东黄金	10,081,056.26	1.32
6	601333	广深铁路	9,926,112.35	1.30
7	600016	民生银行	9,020,000.00	1.18
8	000629	攀钢钒钛	8,654,466.04	1.14
9	601100	恒立油缸	8,622,005.00	1.13
10	601989	中国重工	8,306,000.00	1.09
11	600115	东方航空	8,268,537.00	1.08
12	601888	中国国旅	8,132,000.00	1.07
13	600123	兰花科创	7,784,830.12	1.02
14	600028	中国石化	6,532,000.00	0.86
15	600489	中金黄金	5,803,052.44	0.76
16	600893	航空动力	5,602,921.50	0.73
17	600875	东方电气	5,209,365.00	0.68
18	002013	中航精机	5,180,494.40	0.68
19	600795	国电电力	5,120,000.00	0.67
20	600765	中航重机	4,374,590.00	0.57

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。

8.4.2累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600547	山东黄金	9,760,076.00	1.28
2	600115	东方航空	8,080,000.00	1.06
3	000629	攀钢钒钛	7,717,616.08	1.01
4	600123	兰花科创	7,339,292.00	0.96
5	601100	恒立油缸	6,633,934.30	0.87
6	600489	中金黄金	5,800,598.20	0.76
7	600795	国电电力	4,940,000.00	0.65
8	600016	民生银行	2,865,000.00	0.38
9	601888	中国国旅	2,841,339.72	0.37
10	600348	阳泉煤业	2,541,660.91	0.33
11	601101	昊华能源	2,480,622.40	0.33
12	002025	航天电器	261,800.00	0.03
13	601901	方正证券	96,900.00	0.01
14	300274	阳光电源	47,880.00	0.01
15	002612	朗姿股份	47,050.00	0.01
16	300251	光线传媒	40,750.00	0.01
17	002628	成都路桥	24,800.00	0.00
18	002614	蒙发利	23,525.00	0.00
19	002630	华西能源	21,980.00	0.00
20	601222	林洋电子	21,900.00	0.00

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。

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	175,270,918.74
卖出股票的收入(成交)总额	61,764,785.61

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。

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,034,000.00	6.56
	其中:政策性金融债	50,034,000.00	6.56
4	企业债券	132,517,043.50	17.38
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	565,999,613.74	74.23
8	其他	-	-
9	合计	748,550,657.24	98.18

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	113002	工行转债	1,669,120	177,694,515.20	23.31
2	110015	石化转债	1,119,190	112,489,786.90	14.75
3	110016	川投转债	662,110	61,020,057.60	8.00
4	110018	国电转债	510,000	54,054,900.00	7.09
5	110013	国投转债	554,330	53,731,206.90	7.05

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	250,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,621,562.51
5	应收申购款	160,235.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,031,798.39

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	113002	工行转债	177,694,515.20	23.31
2	110015	石化转债	112,489,786.90	14.75
3	110016	川投转债	61,020,057.60	8.00
4	110013	国投转债	53,731,206.90	7.05
5	113001	中行转债	44,907,529.80	5.89
6	110003	新钢转债	23,164,298.00	3.04
7	110011	歌华转债	21,992,929.20	2.88
8	125709	唐钢转债	10,631,500.00	1.39
9	110007	博汇转债	3,803,807.20	0.50
10	125887	中鼎转债	40,150.04	0.01

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§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

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
华安可转债债券A类	5,682	97,330.03	15,237,906.99	2.76%	537,791,331.85	97.24%
华安可转债债券B类	3,553	67,974.77	40,201,403.62	16.65%	201,312,940.86	83.35%
合计	9,235	86,036.12	55,439,310.61	6.98%	739,104,272.71	93.02%

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)。

9.2 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	华安可转债债券A类	66,110.79	0.012%
	华安可转债债券B类	171,393.21	0.071%
	合计	237,504.00	0.030%

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)。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
基金合同生效日(2011年6月22日)基金份额总额	706,745,673.56	581,235,497.87
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	28,239,969.84	27,864,425.97
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	181,956,404.56	367,585,579.36
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	553,029,238.84	241,514,344.48

注:总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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,本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更的公告,李炳旺副总经理因个人原因辞职。

2)、2011年9月17日,本基金管理人发布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,本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更的公告,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,本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更的公告,韩勇副总经理因个人原因辞职。

5)、2011年11月12日,本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更的公告,邵杰军副总经理因个人原因辞职。

6)、2011年12月16日,本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更的公告,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、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下:

本基金托管人总行资产托管部原总经理夏博辉同志已调离招商银行,根据招商银行招银发[2011]331号文,夏博辉先生不再担任招商银行总行资产托管部总经理职务,招商银行已聘任吴晓辉先生担任总行资产托管部负责人。

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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况:84,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限:自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

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。

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	2	228,854,858.85	100.00%	193,682.21	100.00%	-

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	1,052,830,829.27	100.00%	12,469,600,000.00	100.00%	-	-

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:

无。

华安基金管理有限公司
二〇一二年三月二十九日