

# 华安升级主题股票型证券投资基金

# 2012 第四季度 报告

2012年 12 月 31 日

取得了非常显著的超额收益。本基金报告期内延续三季度思路逐步增加进攻性品种,但是由于心态上略偏保守,在12月份市场突变之后仍然没有能够对组合进攻性进行实质性提升,导致最终净值表现落后于基准。

有了非常丰富的经验，本基在前期仓位上已经表现得比高波动性资产低，但是由于F-2上战略保守，在12月份市场突变之后仍保持仓位。然而有经验的组合对组合仓位进行快速调整，导致整体仓位波动性高于基准。

配上，四月份仓位调整本基可能已经存在组合迹象，考虑到本基中期周期组合中寻找投资机会，因此，由于经济复苏乏力组合仓位可能调整，更多的经济复苏不足，更多是经济复苏不足强化了组合的周期性仓位，因此，在12月份的反转行情中组合仓位仍然显著不足。

42 报告内现金头寸的规模

截至2012年12月31日，本基现金持仓为70.86%，本报告期组合的现金持仓为4.57%，同比现金持仓较前期末增长率为7.06%。

43 管理人对于宏观经济、证券市场以及利率走势的判断摘要

从长期来看，市场大幅回升上升的行情可能将一直告一段落，结构和机会的组合将是本基较久的投资主题。考虑到近期行情将得以维持，本基将保持仓位，并继续寻找投资机会。

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	1,116,133,463.40	89.87
	其中：股票	1,116,133,463.40	89.87
2	固定收益投资	60,018,000.00	4.83
	其中：债券	60,018,000.00	4.83
	货币支持证券	--	--
3	金融衍生品投资	--	--
4	买入返售金融资产	39,600,000.00	3.19
	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	23,553,432.94	1.90
6	其他各项资产	2,635,979.91	0.21
7	合计	1,241,940,873.25	100.00
5.2 报告期末按行业分类的股权投资组合			
代码	行业类别	公允价值（元）	占基金净资产净值比例（%）

B	其他	67,235,900.00	5.64
C	实收资本	774,385,526.50	64.60
C0	制造业	155,743,481.85	12.59
C1	食品、饮料	-	-
C2	纺织、服装、皮毛	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	造纸、印刷	-	-
C5	石油、化学、塑胶、塑料	215,659,931.00	17.43
C6	电子	38,556,115.00	3.12
C8	金属、非金属	30,382,026.91	2.46
C9	机械、设备、仪器	174,046,660.00	14.07
C99	医药、生物制品	158,987,31.74	12.93
C99	其他制造业	-	-

D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	6,424,000.00	0.52
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	56,703,614.90	4.58
H	批发和零售贸易	5,007,462.00	0.40

I	金融、保险业	161,405,400.00	13.05
J	房地产业	27,535,200.00	2.23
K	社会服务业	17,436,360.00	1.41
L	传播与文化产业	-	

M	综合类	-	-
	合计	1,116,133,463.40	90.23

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)	公允价值占净值比例 (%)
1	002450	康得新材	3,990,000	96,957,000.00	7.84
2	002250	联化科技	4,788,000	93,366,000.00	7.55
3	000741	华城汽车	6,900,000	77,142,000.00	6.24
4	600016	民生证券	9,100,000	71,526,000.00	5.78
5	000104	上汽集团	3,990,000	70,383,600.00	5.69
6	601118	中国平安	1,300,000	58,877,000.00	4.76
7	000157	永新能源	4,990,000	46,955,900.00	3.80
8	600887	伊泰股份	1,930,000	42,421,400.00	3.43
9	000858	九鼎投资	1,300,000	36,699,000.00	2.97
10	002001	神州集团	1,880,000	35,344,000.00	2.86

5.4 报告期末按公允价值计量的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值 (元)	公允价值占净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	66,018,000.00	4.85

4	金业稽查					
5	企业短期融资券					
6	中期票据					
7	可转债					
8	其他					
9	合计			60.018.000.00		4.85

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十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量 (亿)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	120118	12进出18	600.000	60.018.000.00	4.85

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 其他资产构成

5.8.1 其他资产构成

报告期末，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 本基金投资前十名证券中，不存在投资于超出基金合同规定投资范围之外的股票。

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	115,200.28
2	应收证券清算款	2,106,648.26
3	应收股利	-
4	应收利息	372,500.39
5	应收中期款	41,621.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他		
9	合计		2,635,976.91

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细  
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	1,543,597,212.94
本报告期基金已申购份额	3,996,231.82
减:本报告期基金已赎回份额	83,904,306.92
本报告期基金净申购/赎回份额	3,112,925.72
本报告期末基金份额总额	1,461,688,937.84

**§7 备查文件目录**

7.1 备查文件目录

1、在中国证监会指定网站披露《证券投资基金合同》

2、在中国证监会指定网站披露《证券投资基金招募说明书》

3、在中国证监会指定网站披露《证券投资基金托管协议》

7.2 存放地点

基金管理人及基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站<http://www.huain.com.cn>。

**7.3 查阅方式**

投资者可登录基金管理人互联网网站查阅,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  
二〇一三年一月二十一日

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	12,363,305.60	0.99

2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,212,000.00	11.26
	其中:政策性金融债	140,212,000.00	11.26
4	企业债券	677,583,734.20	54.80
5	企业短期融资券	514,157,000.00	41.28
6	中期票据	225,773,000.00	18.13
7	可转债	32,207,115.40	2.59
8	其他	-	-
9	合计	1,602,296,145.20	128.63

5.7 报告期内期末公司公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产名称及公允价值					
序号	债券名称	债券名称	数量 (套)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	122003	09富力债	900,000	93,195,000.00	7.48
2	122261	11广汇债	800,000	85,600,000.00	6.87
3	096040	06海信转债	300,000	81,088,000.00	6.51
4	141818	16国投债	600,110	60,897,146.30	4.98
5	181287	19明泰转债(MTN)	900,000	51,460,000.00	4.13
5.8 报告期内期末公允价值计量且其变动计入损益的前十名资产支持证券投资情况					
序号	证券代码	证券名称	数量 (份)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	119024	信邦02	100,000	10,000,000.00	0.80
2	119025	信邦02	100,000	10,000,000.00	0.80
5.9 报告期内公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产名称及公允价值					
本基金本报告期末未持有此类资产。					
5.10 报告期内公允价值计量且其变动计入损益的金融资产名称及公允价值					
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的,在本报告编制前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。					
5.8.2 本基金投资的前十名证券,不存在投资于超出基金合同规定股票范围之外的股票。					
序号	名称			金额 (元)	
1	存出保证金			213,413.77	
2	应收证券清算款			-	
3	应收股利			-	
4	应收利息			40,542,789.31	
5	其他资产			106,156,690.30	

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	140,912,812.88

5.8.4 报告期末持有的以公允价值计量的可供销售金融资产

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	113003	董工转债	27,389,615.40	2.20
2	113001	中行转债	4,817,500.00	0.39

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的情况。

96 开放式基金份额变动		单位:份
本报告期初基金份额总额		1,065,087,765.17
本报告期基金总申购份额		381,690,810.67
减:本报告期基金总赎回份额		236,324,172.41
本报告期基金净变动份额		-

本报告期末基金份额总额	1,210,454,403.43
<b>§7 备查文件目录</b>	
7.1 备查文件目录	
1、《华安基金开放式证券投资基金合同》	
2、《华安基金开放式证券投资基金招募说明书》	
3、《华安基金开放式证券投资基金托管协议》	
7.2 存放地点	
基金管理人、基金托管人的办公场所，并登载基金管理人互联网网站 <a href="http://www.huanan.com">http://www.huanan.com</a> 。	
7.3 查阅方式	
投资者可登录基金管理人互联网网站查询，或在营业时间内向基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。	
<div style="text-align: right;"> <b>华安基金管理有限公司</b>  <b>二〇一三年一月二十一日</b> </div>	

---