基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年三月二十七日

华安核心优选股票型证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012年12月31日

报告截止日:2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年 12 月 31 日	上年度末 2011年 12 月 31 日
资 产:		
银行存款	50,693,958.82	22,783,035.49
结算备付金	400,910.34	1,681,360.58
存出保证金	131,045.93	130,350.43
交易性金融资产	195,751,313.87	209,854,232.02
其中:股票投资	195,751,313.87	209,816,075.62
基金投资	-	-
债券投资	-	38,156.40
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	-	2,218,482.55
应收利息	10,194.73	5,140.63
应收股利	-	-
应收申购款	1,499,472.73	14,417.44
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	248,486,896.42	236,687,019.14
负债和所有者权益	本期末 2012年 12 月 31 日	上年度末 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	-	-
应付证券清算款	11,180,386.74	2,003,092.29
应付赎回款	638,138.46	3,241,467.74
应付管理人报酬	270,991.08	307,361.61
应付托管费	45,165.16	51,226.95
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	379,776.37	602,850.98
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	358,391.04	362,173.53
负债合计	12,872,848.85	6,568,173.10
所有者权益:		
实收基金	254,953,722.11	278,259,510.11
未分配利润	-19,339,674.54	-48,140,664.07
所有者权益合计	235,614,047.57	230,118,846.04
负债和所有者权益总计	248,486,896.42	236,687,019.14

注:报告截止日 2012 年 12 月 31 日,基金份额净值 0.9241 元,基金份额总额 254,953,722.11 份。

7.2 利润表
会计主体:华安核心优选股票型证券投资基金
本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2011年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日
一.收入	34,026,199.39	-100,338,480.95
1.利息收入	189,918.73	219,063.02
其中:存款利息收入	188,734.36	219,009.76
债券利息收入	1,184.37	53.26
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益 (损失以 “-”填列)	-7,815,769.41	-1,395,582.19
其中:股票投资收益	-10,503,104.17	-3,637,381.77
基金投资收益	-	-
债券投资收益	111,415.37	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,575,919.39	2,241,799.58
3.公允价值变动收益 (损失以 “-”号填列)	41,585,768.45	-99,273,971.53
4.汇兑收益 (损失以 “-”号填列)	-	-
5.其他收入 (损失以 “-”号填列)	66,281.62	112,009.75
减:二.费用	7,907,995.05	10,714,746.41
1.管理人报酬	3,410,853.85	4,937,216.99
2.托管费	568,475.67	822,869.41
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	3,553,274.03	4,576,279.67
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	375,391.50	378,380.34
三、利润总额 (亏损总额以 “-”号填列)	26,118,204.34	-111,053,227.36
减:所得税费用	-	-
四.净利润 (净亏损以 “-”号填列)	26,118,204.34	-111,053,227.36

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:华安核心优选股票型证券投资基金
本报告期:2012 年 1 月 1 日至 2012 年 12 月 31 日

单位:人民币元

项目	本期 2012年 1 月 1 日至 2012 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)	278,259,510.11	-48,140,664.07	230,118,846.04
二.本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	26,118,204.34	26,118,204.34
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)	-23,305,788.00	2,682,785.19	-20,623,002.81
其中:1.基金申购款	78,690,856.06	-8,470,153.73	70,220,702.33
2.基金赎回款	-101,996,644.06	11,152,938.92	-90,843,705.14
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)	254,953,722.11	-19,339,674.54	235,614,047.57

项目	上年度可比期间 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)	384,728,005.22	74,874,706.25	459,602,711.47
二.本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-111,053,227.36	-111,053,227.36
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)	-106,468,495.11	-11,962,142.96	-118,430,638.07
其中:1.基金申购款	50,938,286.92	2,658,915.07	53,597,201.99
2.基金赎回款	-157,406,782.03	-14,621,058.03	-172,027,840.06
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)	278,259,510.11	-48,140,664.07	230,118,846.04

报告附注为财务报表的组成部分。
本报告 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:李勤,主管会计工作负责人:章国富,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

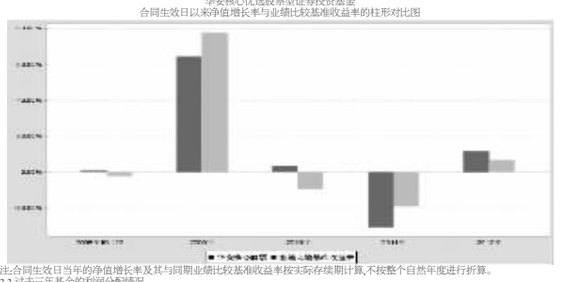
7.4.1 基金基本情况

华安核心优选股票型证券投资基金(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[2008]839 号《关于核准华安核心优选股票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《华安核心优选股票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 813,364,975.21 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(2008)第 149 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 10 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 813,446,720.65 份基金份额,其中认购资金利息折合 81,745.44 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安核心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具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60-95%,其中以沪深 300 指数成份股为核心资产的核心组合的投资比例不低于股票资产的 60%;债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5-40%。基金保留现金或到期日在一年期以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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
华安核心优选股票型证券投资基金
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
(2008 年 10 月 22 日至 2012 年 12 月 31 日)

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
华安核心优选股票型证券投资基金
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图



注: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

金额单位: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
2012年	-	-	-	-	-
2011年	-	-	-	-	-
2010年	5.000	214,559,571.03	106,703,757.88	321,263,328.91	-
合计	5.000	214,559,571.03	106,703,757.88	321,263,328.91	-

§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 2012 年 12 月 31 日,公司旗下共管理了华安证券投资基金,华安创新证券投资基金,华安中国 A 股增强指数,华安现金富利货币,华安证券投资基金,华安主题证券投资基金,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 180ETF,华安上证 180ETF 联接,华安上证龙头企业 ETF,龙头 ETF 联接,华安升级主题股票,华安稳固收益债券,华安可转换债基金,华安深证 300 指数基金(LOF),华安科技动力股票,华安四季红债券,华安香港精选股票,华安大中华升级股票,华安标普石油指数基金(QDII-LOF),华安月盈短期理财债券,华安季季盈短期理财债券,华安双月盈短期理财债券,华安七日盈短期理财债券,华安沪深 300 指数分级,华安逆向策略,华安日日鑫货币,华安安心收益债券,华安信用增强债券等 34 只开放式基金。管理资产规模达到 955.90 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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钧宁	本基金的基金经理、投研发部副总监	2008-10-22	-	17年	工商管理硕士,中国注册会计师协会执业会员,17 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司固证业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业第二工作。2003 年加入华安基金管理有限公司,曾任研发发展部高级研究员、专户理财部投资经理、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,2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任安顺证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2008 年 2 月起担任安信证券投资基金的基金经理,2008 年 10 月起同时担任本基金的基金经理。2011 年 4 月起同时担任华安升级主题股票型证券投资基金的基金经理。2012 年 9 月起兼任投资研究部副总监。
吴丰树	本基金的基金经理	2011-07-19	-	9年	硕士研究生,9 年证券、基金行业从业经历。曾在中金公司固收研究员、华安兴业基金管理有限公司担任基金经理。2011 年 3 月份加入华安基金管理有限公司。2011 年 7 月起担任本基金的基金经理。2012 年 10 月起同时担任华安行业轮动股票型证券投资基金的基金经理。

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《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》、《华安核心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 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过授权限制的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。(1) 交易所一级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配,综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。(2) 交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。(3) 银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先响应的控制原则。通过内部共同的 swiml 群,发布询价需求和结果,最到信息公平。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理向公司投资组合名义集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控风险管理部根据市场公认的第三方信息(如中债登的债券估值),定期对各投资组合与交易对手之间以价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易月、季度和年度的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与跟日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况共出现了 2 次,原因:各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数额少,但由于个股流动性较差,交易量稀少,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,也未发现有异常。

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

2012 年股市跌宕起伏,年初和年尾市场都出现了较好的一轮上涨行情,但年内大部分时间里股市呈现下跌格局。全年来看,经济增速的波动对行情起到了决定性的作用。第一季度经济增长明显超出市场预期,第二季度却又明显偏弱,第三季度和第四季度经济则逐步企稳回升。期中,市场流动性的改善、国内政治换届的波折、中日钓鱼岛的争端、欧洲债务危机的反复、国内地产调控的放松等诸多因素都对市场产生了重大的影响。

全年行业和板块的表现分化特征十分明显。金融和地产领跑市场,超额收益十分突出;汽车、家电、建筑装饰等行业也有较好的表现。有色、电子、医药、电力等行业也有非常出色的阶段性行情。相对而言,机械设备、交通运输、信息服务、商业贸易等行业表现落后。从市场风格来看,大盘股相对小盘股有较为出色的表现。

本基金全年较为成功地超配了地产和保险这两个涨幅居前的行业,并且阶段性地超配了汽车、医药、电力和传媒,这对净值带来较好的正面贡献。不过,我们非常遗憾地错过了在家电和建筑装饰这两个板块上的超配机会。部分电子股票的过晚减持也对净值造成一定的负面影响。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 0.9241 元,本报告期份额净值增长率为 11.74%,同期业绩比较基准增长率为 6.69%。

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 2013 年,我们认为市场存在较大的投资机会。一方面,这是因为经济已经企稳回升,企业逐步进入补库存阶段,工业企业的盈利将有望明显好转。其次,市场资金环境逐渐改善,市场利率在稳步下行,而且,由于国内股票市场的估值水平已基本与国际接轨,境外资金纷纷流入,更为重要的是,随着政治换届的结束,新一代领导人上台之后,国内政治和经济的新一轮改革已开启,我们可以期待中国经济将重新出发,继续增长。我们对于中国经济的中长期前景保持乐观态度。在经济增长持续、通胀水平不高、流动性改善的背景下,我们判断股市中周期股和价值股将具有较好的投资回报,成长股的稀缺性将大大降低。

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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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,首席投资官,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。

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。

黄勤,固定收益部总监,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,指数投资部总监,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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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、庄贤签字出具了普华永道中天审字(2013)第 21420 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:华安核心优选股票型证券投资基金

(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) 各层级金融工具公允价值

于 2012 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 195,751,313.87 元,无属于第二层级以及第三层级的余额(2011 年 12 月 31 日:第一层级 209,854,232.02 元,无属于第二层级以及第三层级的余额)。

(iii) 公允价值所属层级间的重大变动

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,本基金不会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还是第三层级。

(iv) 第三层级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(2011 年 12 月 31 日:同)。本基金本期无第三层次公允价值变动(2011 年度:本基金本期净转入/(转出)第三层级金额为零元,计入损益的第三层级金融工具公允价值变动为零元,涉及同南双汇投资发展股份有限公司发行的股票)。

(2) 除公允价值外,最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	195,751,313.87	78.78
	其中:股票	195,751,313.87	78.78
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	51,094,869.16	20.56
6	其他各项资产	1,640,713.39	0.66
7	合计	248,486,896.42	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	6,931,533.60	2.94
B	采掘业	-	-
C	制造业	81,324,826.86	34.52
C0	食品、饮料	11,469,935.60	4.87
C1	纺织、服装、皮毛	3,887,400.00	1.65
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	17,586,000.00	7.46
C5	电子	7,600,697.40	3.23
C6	金属、非金属	18,100,000.22	7.68
C7	机械、设备、仪表	22,680,793.64	9.63
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	5,423,189.50	2.30
F	交通运输、仓储业	18,788,000.00	7.97
G	信息技术业	19,601,250.11	8.32
H	批发和零售贸易	12,179,100.00	5.17
I	金融、保险业	11,322,500.00	4.81
J	房地产业	31,180,913.80	13.23
K	社会服务业	9,000,000.00	3.82
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	195,751,313.87	83.08

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	600208	新湖中宝	2,999,980	12,929,913.80	5.49
2	600418	江淮汽车	1,702,300	11,626,709.00	4.93
3	300322	硕贝德	594,941	11,428,816.61	4.85
4	601318	中国平安	250,000	11,322,500.00	4.81
5	000069	华侨城A	1,200,000	9,000,000.00	3.82
6	600519	贵州茅台	40,105	8,382,747.10	3.56
7	600050	中国联通	2,000,000	7,000,000.00	2.97
8	002299	圣农发展	649,020	6,931,533.60	2.94
9	601933	永辉超市	260,000	6,554,600.00	2.78
10	600660	福耀玻璃	699,886	6,138,000.22	2.61

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载在 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	600383	金地集团	24,467,926.53	10.63
2	600208	新湖中宝	24,289,084.89	10.56
3	600050	中国联通	21,313,996.62	9.26
4	000002	万 科 A	19,863,818.59	8.63
5	000069	华侨城 A	19,772,053.59	8.59
6	600028	中国石化	19,578,207.31	8.51
7	002299	圣农发展	18,945,816.58	8.23
8	300058	蓝色光标	18,743,208.04	8.15
9	600519	贵州茅台	17,851,247.92	7.76
10	600418	江淮汽车	16,326,128.24	7.09
11	600223	鲁商置业	14,597,732.81	6.34
12	600547	山东黄金	14,464,402.37	6.29
13	600528	中铁二局	14,004,415.99	6.09
14	300322	硕贝德	13,724,204.16	5.96
15	600596	新安股份	13,720,980.54	5.96
16	601601	中国太保	13,666,357.00	5.94
17	600015	华夏银行	13,589,937.48	5.91
18	601933	永辉超市	13,558,564.85	5.89
19	600153	建发股份	13,327,808.72	5.79
20	600660	福耀玻璃	13,198,245.44	5.74
21	601299	中国北车	13,191,977.67	5.73
22	600239	云南城投	13,186,426.11	5.73
23	000800	一汽轿车	13,065,831.40	5.68
24	601318	中国平安	12,532,024.75	5.45
25	600741	华域汽车	12,526,602.87	5.44
26	601669	中国水电	12,003,000.00	5.22
27	000550	江铃汽车	11,334,232.45	4.93
28	601866	中海集运	11,041,617.47	4.80
29	601009	南京银行	11,030,216.00	4.79
30	600266	北京城建	10,421,686.79	4.53
31	600598	北大荒	10,143,242.50	4.41
32	601989	中国重工	9,995,700.28	4.34
33	600518	康美药业	9,271,206.41	4.03
34	000049	德赛电池	9,063,274.28	3.94
35	600642	申能股份	8,662,364.34	3.76
36	600019	宝钢股份	8,479,216.65	3.68
37	000680	山推股份	8,425,026.86	3.66
38	002106	莱宝高科	8,383,858.22	3.64
39	601333	广深铁路	8,215,731.20	3.57
40	601668	中国建筑	7,841,261.00	3.41
41	300027	华谊兄弟	7,704,285.31	3.35
42	000401	冀东水泥	7,699,320.07	3.35
43	600428	中远航运	7,414,126.26	3.22
44	300086	康芝药业	7,291,554.34	3.17
45	002436	兴森科技	7,212,250.79	3.13
46	600881	亚泰集团	7,160,449.25	3.11
47	300302	同有科技	7,109,809.51	3.09
48	300128	锦富新材	6,862,530.00	2.98
49	600809	山西汾酒	6,723,627.20	2.92
50	600832	东方明珠	6,602,122.94	2.87
51	002285	世联地产	6,449,914.00	2.80
52	000630	铜陵有色	6,299,669.82	2.74
53	002397	梦洁家纺	6,231,967.44	2.71
54	600629	攀钢钒钛	6,165,600.00	2.68
55	600895	张江高科	6,143,790.64	2.67
56	600458	时代新材	6,042,831.23	2.63
57	000046	泛海建设	5,994,295.98	2.60
58	002408	齐翔腾达	5,993,106.19	2.60
59	600104	上汽集团	5,719,118.00	2.49
60	601766	中国南车	5,508,518.69	2.39
61	601628	中国人寿	5,497,683.30	2.39
62	002422	科伦药业	5,446,488.38	2.37
63	000012	南 玻 A	5,392,463.57	2.34
64	600537	亿晶光电	5,362,599.18	2.33
65	002161	远 望 谷	5,313,963.90	2.31
66	300253	卫宁软件	5,304,978.45	2.31
67	000776	广发证券	5,221,471.22	2.27
68	002155	辰州矿业	5,129,738.60	2.23
69	002007	华兰生物	5,107,992.47	2.22
70	600761	安徽合力	5,064,372.41	2.20
71	601100	恒立油缸	5,042,581.66	2.19
72	601555	东吴证券	5,008,465.00	2.18
73	600655	豫园商城	5,000,582.87	2.17
74	600720	祁连山	4,957,000.02	2.15
75	002431	棕榈园林	4,911,801.44	2.13
76	000603	盛达矿业	4,770,041.00	2.07
77	600511	国药股份	4,758,368.60	2.07
78	002304	洋河股份	4,718,932.60	2.05
79	000783	长江证券	4,712,915.50	2.05
80	600060	海信电器	4,636,422.83	2.01
81	601088	中国神华	4,629,476.00	2.01

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	600015	华夏银行	26,269,354.25	11.42
2	601601	中国太保	26,229,732.22	11.40
3	300058	蓝色光标	22,269,951.27	9.68
4	600383	金地集团	22,261,605.06	9.67
5	600028	中国石化	21,907,036.