3.1 主要财务指标

华安策略优选股票型证券投资基金

2013 第一季度 报告

单位,人民币元

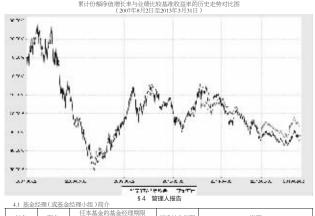
\$1 重要提示 管理人的董事会及董事保证本报告所教资料不存在建假近载,误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性,准确 经年程户列及连带进行。 托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月10日复核了本报告中的财务指标,净值表现和投 括等内容,保证复核内容不存在建假记载,误导性陈述或者重大遗漏。 管理人承诺以源信用,勤龄定劳的原则曾重张应用基金资产,但不保证基金一定盈利。 的过往业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 信率服务资料未签时计。 信等服复约45年3月31日止。 82 基金产足账四

| | § 2 基金产品概况 |
|------------|--|
| 基金简称 | 华安策略优选股票 |
| 基金主代码 | 040008 |
| 前端交易代码 | 040008 |
| 后端交易代码 | 041008 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 13,366,630,346.44(/) |
| 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 於予配置藥路 本基金科通过对定观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研 究和預測,并利用公司研究开发的数量整型工具、分析和比较不同证券于市场 和不同金融工具的收益及风险特征。而使合适的资产包置比例。 ② 股票投资率的 本基金的股票投资策略作采用"目下而上"和"自上而下"相结合的方法、 通过综合应用多种投资策略传采用"目下而上"和"自上而下"相结合的方法、 通过综合应用多种投资策略传采用"目下而上"和"自上而下"的主题投资组合 时主要以上目下而上"的优选成长策略为主确以"目上而下"的主题投资组合 时主要以上目下而上"的优选成长策略为主确以"自上而下"的主题投资 路、远势操作策略、优选具有良好投资槽力的个股、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 人通过实收益率、成本性、信用风险和风险运行等因素持综合评低,各理分配固 定收益效。并经有一种。企业债务可转换。企业债 规则金融工具等产品的比例, 机造成债券组合。 ④ 仅证、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。 |
| 基金管理人 | 华安基金管理有限公司 |
| | |

| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) |
|-------------------------|-----------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | -357,542,075.84 |
| 2.本期利润 | 772,456.48 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0001 |
| 4.期末基金资产净值 | 7,845,602,098.22 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.5870 |
| 司费,红利再投资费,基金转换费等),计人费用户 | 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 |

交通银行股份有限公司 §3 主要财务指标和基金净值表现

| 3.2 基金净值表现 3.2 基金净值表现 3.2.1 本报告期基金份额净 | | | ·基准收益率的b | 比较 | | |
|---|--------------|--------------------|--|-----------------------|--------|-------|
| 阶段 | 净值增长率① | 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 | -0.03% | 1.32% | -0.02% | 1.20% | -0.01% | 0.12% |
| 3.2.2目基金合同生效以来 | 华 累计份额净值增 | 安策略优选股票 长率与业绩比较 | 及其与同期业绩 票型证券投资基 交基准收益率的 至2013年3月31日 | 金 历史走势对比图 | | |
| V V 2 | | | | | | |



| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 证券从业年限 | | ENTER VIEW LA NAME OF THE | 说明 |
|-----|-------------------|--------------------|----------|---------------------------|--|
| 处土石 | BR93 | 任职日期 | 离任日期 | III:3F/M.VIL+PR | 100.97 |
| 殷鸣 | 本基金的基金经理 | 2010-9-20 | 2013-3-2 | 7年 | 经济学硕士,拥有基金从业人员资格证书 7年证券基金从业处历。曾在大正幸研引 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月至2013年3月担任本基金基金经 理。 |
| 汪光成 | 本基金的基金经理、基金投资部副总监 | 2013-3-2 | - | 11年 | 管理学博士,持有基金从业旅格证书,以往 绿、基合学业从业整历,200年1月加 华安基金管理有限公司后,曾先后在跨 策划那,研究处震队,再数量分析和行 研究工作,2008年3月至2006年3月担任安康 基金的基金经理,2009年3月担任华安 市等工作,2008年3月起日任华安 基金的基金经理,2009年3月起租任华安 企的基金经理,2009年3月起租任华安 企的基金经理,2009年3月起租任华安 企的基金经理,2009年3月起租任华安 企的基金经理,2019年3月起1日租任基金 企的基金经理,2019年3月起1日任基金 企的基金经理,2019年3月起1日任基金 投票。 |

| | | 年期內基金的业项表现 年3月31日,本基金份额争值为0.5870元,本报台 | 告期份额净值增长率为 -0.03%,同 | 朝业绩比较基准增长率为 |
|----|-----|--|---------------------|-------------|
|)2 | 2%。 | | 设资组合报告 | |
| | | 期末基金资产组合情况 | | - 1 |
| | 序号 | 项目 | 金額(元) | 占基金总资产的比例(% |
| | 1 | 权益投资 | 6,529,873,571.85 | 82.9 |
| | | 其中:股票 | 6,529,873,571.85 | 82.9 |
| | 2 | 基金投资 | - | |
| | 3 | 固定收益投资 | 360,341,000.00 | 4.5 |
| | | 其中:债券 | 360,341,000.00 | 4.5 |
| | | ② 产 | _ | |

| | 其中:债券 | 360,341,000.00 | 4.58 |
|----|--------------------|------------------|--------------|
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 5 | 买人返售金融资产 | 240,000,780.00 | 3.05 |
| | 其中: 尖断式回购的头人返售金融资产 | - | - |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 684,834,985.91 | |
| 7 | 其他各项资产 | 59,193,730.77 | |
| 8 | 合计 | 7,874,244,068.53 | 100.00 |
| | 前末按行业分类的股票投资组合 | | |
| 代石 | 冯 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| В | 采矿业 | _ | - |
| C | 制造业 | 2,958,845,721.88 | 37.71 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 231,690,410.34 | 2.95 |
| E | 建筑业 | 145,497,678.79 | 1.85 |
| F | 批发和零售业 | 25,509,078.00 | 0.33 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 16,040,872.44 | 0.20 |
| Н | 住宿和餐饮业 | _ | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 864,900,160.76 | 11.02 |
| J | 金融业 | 1,363,057,890.79 | 17.37 |
| K | 房地产业 | 831,264,991.08 | 10.60 |
| L | 租赁和商务服务业 | 28,135,127.50 | 0.36 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | _ |
| N | | 23,712,785.39 | 0.30 |
| 0 | | _ | _ |
| P | | - | _ |
| Q | 卫生和社会工作 | 41,218,854.88 | 0.53 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | _ | - |
| S | | - | - |
| | XXL | (520 072 571 05 | 02.22 |

| | 000101 | TT (NCD) | | 23,770,000 | | 1.70 | |
|--------|-----------|----------|--|------------|----------------|-------|-------------|
| 5 | 600570 | 恒生电子 | | 27,080,000 | 314,669,60 | 00.00 | 4.01 |
| 6 | 601166 | 兴业银行 | | 16,755,193 | 289,864,83 | 38.90 | 3.69 |
| 7 | 600016 | 民生银行 | | 29,000,000 | 279,560,00 | 00.00 | 3.56 |
| 8 | 600000 | 浦发银行 | | 27,000,000 | 273,510,00 | 00.00 | 3.49 |
| 9 | 600196 | 复星医药 | | 21,288,028 | 257,585,13 | 38.80 | 3.28 |
| 10 | 600048 | 保利地产 | | 22,062,151 | 253,273,49 | 93.48 | 3.23 |
| 5.4 报告 | 期末按债券品种分 | 类的债券投资组合 | | | | | |
| 序号 | 债券品种 | | | 公允 | 价值(元) | | 产净值比例 %) |
| 1 | 国家债券 | | | | 250,360,000.00 | | 3.19 |
| 2 | 央行票据 | | | | 99,930,000.00 | | 1.27 |
| 3 | 金融债券 | | | | - | | - |
| | 其中:政策性金融债 | | | | - | | - |
| 4 | 企业债券 | | | | - | | _ |
| | | | | | | | |

数量(股)

422,176,490. 415,992,220.

| | -Marian (3/4 //3 | | | | | |
|--------|-------------------|----------------------|---------------|----------------|------------|------------------|
| | 其中:政策性金融 | 债 | | - | | - |
| 4 | 企业债券 | | | - | | _ |
| 5 | 企业短期融资券 | | 10,051,000.00 | | | 0.13 |
| 6 | 中期票据 | | | - | | _ |
| 7 | 可转债 | | | - | | _ |
| 8 | 其他 | 其他 - | | | _ | |
| 9 | 合计 | | | 360,341,000.00 | | 4.59 |
| 5.5 报告 | 期末按公允价值占 | 基金资产净值比例大小排名 | 的前五名债券投资明 | 9细 | | |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | [(元) | 占基金资产净 值比例(%) |
| 1 | 130002 | 13附息国债02 | 1,500,000 | 150,2 | 210,000.00 | 1.91 |
| | | LAW Life territor Lo | 4 000 000 | 100.1 | 50,000.00 | 1.28 |
| 2 | 120019 | 12附息国债19 | 1,000,000 | 100,1 | 150,000.00 | 1.20 |
| 2 | 120019 1001060 | 10央行票据60 | 1,000,000 | | 30,000.00 | 1.27 |

5.6 报告期末校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北 本基金本报告期末未持有资产技术证券。 5.7 报告期末核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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 5.8.1 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 5.8.1 末基金本报告期没有投资的股指期货货人有机益明细 注:基金本报告期没有投资股指期货。 5.8.2 本基金投资股指期货的投资政策

股票代码

股票名称

6.9.1 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。 5.9.2 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。

| 序号 | 名称 | 金額(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 2,348,164.52 |
| 2 | 应收证券清算款 | 51,968,022.09 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 4,683,859.07 |
| 5 | 应收申购款 | 193,685.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 59,193,730.77 |

5.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细 本期末本基金未持有可转换债券。 5.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明 无

| 9.0 升放式基重仿额受动 | |
|---------------|-------------------|
| | 单位:份 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 13,620,535,295.09 |
| 本报告期基金总申购份额 | 19,078,873.59 |
| 或:本报告期基金总赎回份额 | 272,983,822.24 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | _ |
| 本报告期期末基金份额总额 | 13,366,630,346.44 |
| | |

- § 7 备查文件目录
- 7.2 存放地点 基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。
- 三元774 8者可登录基金管理人互联网站查阅,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

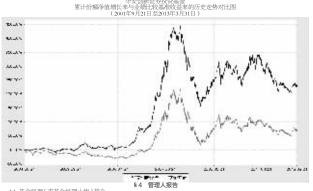
华安创新证券投资基金

2013 第一季度 报告

| 基金简称 | 华安创新混合 |
|------------|--|
| 基金主代码 | 040001 |
| 前端交易代码 | 040001 |
| 后端交易代码 | 041001 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2001年9月21日 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,619,901,500.26份 |
| 投资目标 | 基金管理人将以分散投资风险. 提高基金资产的安全性. 并积极追求投资收益 的稳定增长为目标. 以诚信原则及专业经营方式. 将本基金投资于具有良好流 动性的金融工具. 主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证 监会批准的允许基金投资的其它金融工具。 |
| 投资策略 | 本基金主要投资的研究上市公司以实现基金的投资收益。通过建立科学合理投资设备。为投资者降低和分批投资风险、提高基金资产的安全性。这里的的断是指科技创新、音程创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材等高新技术产业资本或域。包括电子信息及网络技术生物技术人类的医务,把一体化、航空航天技术、满年技术、新材料、新能融等等城内主业实出的上市公司、任宪产业类型的上市公司中,如果已在或正在管理制度、营鲜体系,技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较大潜在发展的聚化验济效益的上市公司也属于本基金的主要投资阻塞。 本基金在选择上市公司的"共和发生",是有较大潜在发展的影响的企为,主营业务市场全国大大、两场状况良好,具有相当是有优秀。 本基金在选择上市公司的"共和发生"的一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个一个 |
| 业绩比较基准 | 基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率 |
| 风险收益特征 | 无 |
| 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 |

| 3.1 TEM 3.184 | 单位:人民币元 |
|-------------------------|----------------------------------|
| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) |
| 1.本期已实现收益 | 1,442,991.89 |
| 2.本期利润 | 70,938,915.31 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0081 |
| 4.期末基金资产净值 | 5,208,432,485.19 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.604 |
| 费、红利再投资费、基金转换费等),计人费用后等 | 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 |

| 3.2.1 本报告期基金份额净 | 值增长率及其与 | 同期业绩比较 | 基准收益率的比 | :较 | | |
|-----------------|------------|------------------|--|-----------------------|-------|--------|
| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 1.34% | 0.99% | -0.16% | 1.13% | 1.50% | -0.14% |
| 3.2.2自基金合同生效以来基 | (计份额净值增 | 华安创新证 长率与业绩比较 | 及其与同期业绩 券投资基金 交基准收益率的 至2013年3月31日 | 历史走势对比[| | |



| 证规 等等 等等 注光成 基金处理、 基金处理、 基金投资 部副监监 | 说明 理学博士,持有基金从业资格证书,11年 券,基金行业从业经历,2002年1月加人 安基金管理有限公司后,曾先后在战略 |
|---|---|
| 证规 等等 等等 注光成 基金处理、 基金处理、 基金投资 部副监监 | |
| 201: 证券 | 安基歐直維利較公司店、管凭后在政勢 第五年。2008年3月至2009年3月担任安康 發入年。2008年3月至2009年3月担任安康 金的基金经理。2009年3月起担任本基金 金的基金经理。2009年3月起担任本基金 或力股票型证券投资基金的基金经理。 初3年3月起间担任李安縣化选股票型 券投资基金的基金经理。2012年6月起担 基金投资和股低。 |

部分品种弹性一般;消费电子因为股票市值相对较小,在配置上采用相关类型批量买人的策略。金融,汽车和地产行业方面。 有您到的分龙头个设估值便宜,且也具备成长性、采用买人持有的策略;化工行业则根据公司质地和其产品特性,以个股选 样项级过了强量。 4.2 报告期内基金的业绩表现 截至2013年3月31日,本基金价额单值为0.604元,本报告期份额净值增长率为 1.34%。同期业绩比较基准增长率为-0. § 5 投资组合报告

| | 其中:形 | 是票 | | | | 3,276,669,488.1 | 5 | 62 |
|--------|------|--------|----------|-------|------------|-----------------|--------|------------------|
| 2 | 基金投 | 资 | | | | | 1 | |
| 3 | 固定收 | 益投资 | | | | 1,348,835,171.7 | 0 | 25 |
| | 其中:億 | | | | | 1,348,835,171.7 | 0 | 25 |
| | 资产支 | 持证券 | | | | | | |
| 4 | | 生品投资 | | | | | - | |
| 5 | | 售金融资产 | | | | 200,000,470.0 | 0 | 3 |
| | | | 的买人返售金融资 | 产 | | | - | |
| 6 | | 款和结算备 | 付金合计 | | | 367,928,328.9 | | 7 |
| 7 | 其他各 | 项资产 | | | | 36,014,287.9 | 2 | 0 |
| 8 | 合计 | | | | | 5,229,447,746.6 | 8 | 100 |
| 5.2 报告 | 期末按行 | f业分类的! | 股票投资组合 | | | | | |
| 代码 | 1 | | 行业类别 | | 公允允 | 介值(元) | 占基金 | 金资产净值比例(% |
| A | | 农、林、牧、 | 渔业 | | | - | | |
| В | | 采矿业 | | | | 48,035,000.0 |) | 0 |
| С | | 制造业 | | | | 2,066,488,179.5 | 8 | 39 |
| D | | 电力、热力 | 、燃气及水生产和 | 1供应业 | | 116,155,533.9 |) | 2 |
| E | | 建筑业 | | | | 927,925.70 | 6 | 0 |
| F | | 批发和零售 | | | | 36,685,250.50 | ó | 0 |
| G | | | 仓储和邮政业 | | | - | | |
| Н | | 住宿和餐馆 | | | | - | | |
| I | | | 软件和信息技术 | 服务业 | | 144,013,814.5 | | 2 |
| J | | 金融业 | | | | 399,955,124.3 | 3 | 7 |
| K | | 房地产业 | | | | 333,034,176.93 | 2 | 6 |
| L | | 租赁和商组 | | | | - | | |
| M | | | 和技术服务业 | | | - | - | |
| N | | | 和公共设施管理 | | | - | - | |
| 0 | | | 修理和其他服务 | W. | | - | - | |
| P | | 教育 | | | | - | - | |
| Q | | 卫生和社会 | | | | - | - | |
| R | | 文化、体育 | 和娱乐业 | | | - | - | |
| S | | 综合 | | | | 131,374,482.4 | | 2 |
| | | 合计 | | | | 3,276,669,488.1 | 5 | 62 |
| 5.3 报告 | 期末按公 | 允价值占 | 基金资产净值比例 | 引大小排序 | 的前十名股票技 | 殳资明细 | | |
| 序号 | 股牙 | 票代码 | 股票名称 | 数 | (股) | 公允价值(元 |) | 占基金资产净值b 例(%) |
| 1 | 60 | 00309 | 烟台万华 | | 15,675,961 | 285,145, | 730.59 | 5. |

| | 600079 | 人福医药 | 4,800,947 | 125,976,84 | 9.28 | 2.42 |
|-----|-----------|----------|------------|------------------|-------|-----------------|
| | 601009 | 南京银行 | 13,222,084 | 119,263,19 | 7.68 | 2.29 |
| | 600252 | 中恒集团 | 9,076,469 | 115,815,74 | 14.44 | 2.22 |
| , | 601231 | 环旭电子 | 7,135,617 | 113,456,31 | 0.30 | 2.18 |
| 报告非 | 期末按债券品种分割 | 类的债券投资组合 | | | | |
| 号 | 1 | 债券品种 | 公允 | 价值(元) | 占法 | 基金资产净值比例 (%) |
| | 国家债券 | | | 128,201,600.00 | | 2.46 |
| | 央行票据 | | | 489,748,000.00 | | 9.40 |
| | 金融债券 | | | 485,211,000.00 | | 9.32 |
| | 其中:政策性金融 | 债 | | 485,211,000.00 | | 9.32 |
| | 企业债券 | | | 120,628.70 | | 0.00 |
| | 企业短期融资券 | | | 10,045,000.00 | | 0.19 |
| | 中期票据 | | | 80,635,000.00 | | 1.55 |
| | 可转债 | | | 154,873,943.00 | | 2.97 |
| | 其他 | | | - | | - |
| | 合计 | | | 1,348,835,171.70 | | 25.90 |
| | | | | | | |

149.286.700.€

| 8 | 其他 | | | - | | - |
|--------|-----------|---------------|-----------|----------------|-----------|------------------|
| 9 | 合计 | | 1, | 348,835,171.70 | | 25.90 |
| .5 报告期 | 用末按公允价值占基 | 基金资产净值比例大小排名的 | 的前五名债券投资明 | 細 | | |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值 | (元) | 占基金资产净 值比例(%) |
| 1 | 1001037 | 10央票37 | 1,500,000 | 149,9 | 70,000.00 | 2.88 |
| 2 | 1001032 | 10央票32 | 1,300,000 | 129,9 | 74,000.00 | 2.50 |
| 3 | 070227 | 07国开27 | 1,200,000 | 122,5 | 56,000.00 | 2.35 |
| 4 | 1001079 | 10央票79 | 1,100,000 | 109,8 | 79,000.00 | 2.11 |
| 5 | 080216 | 08国开16 | 1,000,000 | 103,7 | 80,000.00 | 1.99 |
| .6 报告期 | 用末按公允价值占基 | 基金资产净值比例大小排名的 | 的前十名资产支持证 | E券投资明细 | | |

5.6 报告期末校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1 本基金本报告期末持有资产支持证券。 5.7 报告期末校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 报告期末本基金投资的股본期货交易情况说明 5.8.1 报告期末本基金投资的股본期货交易情况说明 5.8.2 本基金投资股报期货资股票的 5.8.2 本基金投资股报期货资股票 5.8.2 本基金投资股报期货的投资政策 无。

| 2000 2016 | 211-80 | () 15944 | | | |
|-----------|--------|------------|---------|---------------|------------------|
| 序号 | | 名称 | | 金額(元) | |
| 1 | 存出係 | 录证金 | | | 1,525,355.48 |
| 2 | 应收i | E券清算款 | | | 11,040,236.38 |
| 3 | 应收胜 | 2利 | | | _ |
| 4 | 应收利 | 息 | | | 23,221,074.30 |
| 5 | 应收日 | 甲购款 | | | 227,621.76 |
| 6 | 其他區 | 立收款 | | | - |
| 7 | 待摊装 | 専用 | | | _ |
| 8 | 其他 | | | | - |
| 9 | 合计 | | | | 36,014,287.92 |
| 5.9.4 报告 | 期末担 | 持有的处于转股期的可 | 可转换债券明细 | | |
| 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 | | 110015 | 石化转债 | 63,030,342.80 | 1.21 |

| 9 合计 | | | | 36,014,287.9 |
|-------------|-------------------------|----------|---------------|------------------|
| 5.9.4 报告期末持 | 持有的处于转股期的可 | 「转换债券明细 | | |
| 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 | 110015 | 石化转债 | 63,030,342.80 | 1.3 |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 51,991,356.80 | 1.0 |
| 3 | 113002 | 工行转债 | 37,462,643.40 | 0.5 |
| 4 | 110016 | 川投转债 | 2,389,600.00 | 0.0 |
| | 前十名股票中存在流道 末前十名股票不存在 | 流通受限的股票。 | 基金份额变动 | |

§ 7 备查文件目录

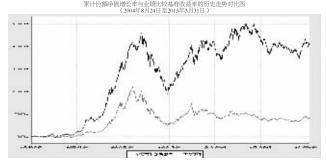
/2 仔放地点 基金管理人和基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网站http://www.huaan.com.cn。

接告送出日期: 二〇一三年四月十九日
\$1 重要提示
基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在废银记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、推确
定整任采担小别反走带责任。基金托百人公遣银行银份有限公司根据本基金合同规定,于2013年4月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现积投
后报告等内容,保证复执守客户在企废记载。误守住陈述或者重大遗漏。
基金管观人所说见读文语用,勤勉不贵的规则管理和运用基金的产。但不证准金一定趋利。
基金管观人所说见读文语用,勤勉不贵的规则管理和运用基金的产。但不证准金一定趋利。
基金管规分成见法或法律,是一段有风险。该旁者在中社投资决准商运行和阅读本基金的招募说明书。

| 基金简称 | 华安宝利配置混合 |
|------------|--|
| 基金主代码 | 040004 |
| 前端交易代码 | 040004 |
| 后端交易代码 | 041004 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2004年8月24日 |
| 报告期末基金份额总额 | 4,121,760,883.44分 |
| 投资目标 | 本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会 反活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础 上获取更高的投资收益。 |
| 投资策略 | 基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资经 合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和赌提市场机会 以实现基金的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 35%×天相转债指数收益率+30%×天相280指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率 |
| 风险收益特征 | 本基金而临与其他开放式基金相同的风险。例如市场风险,流元胜风险、管理风险、转水风险等,但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要而临的风险为,利率风险及贫限风险。经济周期风险。信用风险,再投资风险。上市公司经营风险。新产品的邮带来的风险,购买力风险,流动性风险,现金管理风险、技术风险、管理风险。自然使 |
| 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 |

| 3.1 主要财务指标 | 22,7355)110,140,220,5120,60 |
|------------------------|-------------------------------------|
| 3.1 工女则分旧师 | 单位:人民币: |
| 主要财务指标 | 报告期(2013年1月1日-2013年3月31日) |
| 1.本期已实现收益 | 21,692,883.07 |
| 2.本期利润 | 62,458,359.40 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0147 |
| 4.期末基金资产净值 | 4,196,319,375.04 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.018 |
| 注,1 所述基金业绩指标不句括持有人认账成功 | > 易基金的久顶费用(例加・封闭式基金交易佣金, 开放式基金的由贮障) |

| 费、红利再投资费、基金转换费等 2.本期已实现收益指基金本 | £),计入费用后 期利息收入、投 | 实际收益水平§ 资收益、其他收 | 要低于所列数字 入 (不含公允f) | 。 (| 扣除相关费用 | 后的余额,本期利 |
|----------------------------------|---------------------|--------------------|-----------------------|-----------------------|--------|----------|
| 闰为本期已实现收益加上本期公 | 允价值变动收 | 益。 | | | | |
| 3.2 基金净值表现 | | | | | | |
| 3.2.1 本报告期基金份额净值 | 直增长率及其与 | 同期业绩比较 | 基准收益率的比 | 较 | | |
| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 1.19% | 1.03% | 1.74% | 0.69% | -0.55% | 0.34% |
| 3.2.2目基金合同生效以来基 | 引分额净值增 | 华安宝利配置 长率与业绩比较 | 证券投资基金 | 历史走势对比图 | | |



华安宝利配置证券投资基金

2013 第一季度 报告

2013年3月31日

| 在駅日期 <u> 密任日期</u> 正券从业年限 説明 | | 5小 硕相市场太丰业一部时间成 | 据收号和社协州和 今 关系 |
|---|--|---|-----------------------|
| [工形(口対] [20]工口対] | 生的行业以及军工、环保等主题板块可能持续提供投资机会。在 | 未来的投资中,我们将重点关注 | 能够持续增长的行业和公 |
| 经济学硕士、12年证券,基金厅以从业约 历.历任上海市工商周阳县,京华山一进入 上海公司旅程研究员;中心东方茨严管到 公司旅程研究员,实力证券研究部湾沟面 究员等职。2008年3月加入华安基金管理公 司、任研究发展部高级研究员。2009年5月1 日起至2010年4月2日日任安顿证券投资基金的基金 经理划第2008年4月2日时任安顿证券投资基金的基金 经理划第2008年4月2日时日任华安迪市新 股票型证券投资基金的基金经理。 | 但从2月份开始,市场对中国经济能否真正复求的保险程序 打击,我们从为无论地平线如何,中国经济的高槽等价度 生的行业以及军工。环保等主题核块可能持续推供货机。全 生的行业以及军工。环保等主题核块可能持续推供货机。全 在合理的信值下增加对其配置,对于周期任介业、则根据广能和 5.1 报告期末基金资产组合情况 序号 项目 1 权益投资 其中,股票 2 基金投资 3 国际发出投资 其中,债券 资产支持证券 | が発生的に2011 のでは3年1下9 組合报告 金額(元) 3,168,678,06133 3,168,678,06133 | 占基金总资产的比例(%) 74.47 |
| 上海财经火灾证券期货专业硕士、16年证券基金的生业业全历,曾在大连环车通节, 泰基金的世界。 基金经理 2012-5-30 - 16年 2012-5-30 2 | 4 金融行生品投资 5 天人货售金融资产 其中、实册、无问题的实人及售金融资产 4 年中、实册、无问题的实人及售金融资产 6 银子穿金款就造算备付金合计 7 其他各项设计 8 与计 5.2 银告明末按行业分类的股票投资组合 代码 A 次、林、牧、渔业 | | 1.80 2.14 |

013年初,市场延续12年12月份的走势。在金融股的带领下,指数前期大幅走高,市场人气活跃、大部分板块均有所表达月份开始,市场重新进入分化状态、金融地产为代表的周期股大幅下跌,而以医药、消费电子为代表的成长股走势强。

创业旅报教委创新高。 在马辈、基金室的的仓位有所上升。在转仓结构方面也有所改变,主要增加了医药和消费电子以及军工的危望、减少了 原即任于业的配置、尽管我们还被长股方面加大配置,基起置比例也超过比较基准。但与很多重配、偏配的基金相比,我们在 这方面的配置以后,但是基金的相对表现不住。 442 报告期内基金的业绩表现 据至2013年3月3日。本金必份额价值为1018元。本报告期份额净值增长率为 1.19%,同期业绩比较基准增长率为1.74%。 45 管理人对宏观经济、证券市场及行业生势的简要展望 2012年4度,第一届政府上任,将新型级组作为未来一段时期中国经济增长的主要动力。A股市场给予其高度的热情和期待,以铁路、水泥为代表的基建股大幅上涨。同时,基于对中国经济信心增加,以银行为代表的纸估值板块表现更为突出,

| | | | | MEDIC METHOR | - 1 1V II /2/1/1 |
|------------------|-----------------------------------|------------|-----------------------------|--|------------------|
| 金总资产的比例(% | | 金名 | | | 序号 |
| 74 | 3,168,678,061.33 | | | 是资 | |
| 74 | 3,168,678,061.33 | | | 股票 | |
| | - | | | 支资 | |
| 19 | 849,795,869.77 | | | 女益投资 | |
| 19 | 849,795,869.77 | | | 债券 | |
| | - | | | 支持证券 | |
| | _ | | | 7生品投资 | |
| 1 | 68,820,223.23 | | E AN A TIL MARK | 玄售金融资产 | |
| 1 | 76.654.514.65 | | | 买断式回购的 | |
| 2 | 76,654,514.65 | | VI. | 字款和结算备作 S项资产 | |
| 100 | 90,939,197.96 4,254,887,866.94 | | | ************************************** | 8 合 |
| 100 | 4,234,887,800.94 | | 41人 | 行业分类的股 | |
| 金资产净值比例(% | 値(元) 占基金 | 八会价 | 类别 | TALD SERVICE | 代码 |
| E以11中国1071(7 | IE(76) L1463 | 27,001 | 3C/H | 农、林、牧、渔 | A |
| | | | | 采矿业 | B |
| 41 | 1,736,460,313.57 | | | 制造业 | C |
| 2 | 114,904,418.08 | | 水生产和供应业 | | D |
| 3 | 164,108,879.13 | | Variation (1910) Controlled | 建筑业 | E |
| 5. | 211,489,888.34 | | | 批发和零售 | F |
| 0. | 23,351,772.04 | | 80000 | 交通运输、仓 | G |
| | | | , | 住宿和餐饮 | Н |
| 4 | 206,592,479.00 | | 言息技术服务业 | | I |
| 12 | 530,412,311.17 | | | 金融业 | J |
| 4 | 181,358,000.00 | | | 房地产业 | K |
| | - | | | 租赁和商务 | L |
| | - | | 务业 | 科学研究和 | M |
| | - | | 殳施管理业 | 水利、环境和 | N |
| | - | | 其他服务业 | 居民服务、修 | 0 |
| | - | | | 教育 | P |
| | - | | | 卫生和社会 | Q |
| | - | | lk. | 文化、体育和 | R |
| | - | | | 综合 | S |
| 75 | 3,168,678,061.33 | | | 合计 | Ten II Day I |
| | : 資明细 | 的前十名股票投 | 净值比例大小排序 | 公允价值占基金 | .3 报告期末 |
| 占基金资产净值b 例(%) | 公允价值(元) | 量(股) | 平名称 数 | 比票代码 | 序号 |
| 4. | 199,598,989.25 | 4,778,525 | 平安 | 601318 | 1 |
| 4. | 188,140,323.20 | 12,712,184 | (集团 | 600104 | 2 |
| 3. | 157,860,000.00 | 9,000,000 | 美药业 | 600518 | 3 |
| 3. | 142,200,000.00 | 20,000,000 | 定股份 | 600153 | 4 |
| 3. | 137,391,000.00 | 6,150,000 | 粮 液 | 000858 | 5 |
| 3. | 126,315,383.34 | 5,000,609 | Ł科技 | 002250 | 6 |
| 2. | 122,109,888.60 | 8,363,691 | 1.南瑞 | 600406 | 7 |
| 2. | 116,925,321.92 | 12,962,896 | 7银行 | 601009 | 8 |
| | 116,495,000.00 | 11,500,000 | 银行 | 600000 | 9 |
| 2. | 110, 193,000.00 | | | | |

| 3 | 金融债券 | | : | 189,959,000.00 | 4.53 | | | | |
|---|----------|--------|-------------------|----------------------|------------|------------------|--|--|--|
| | 其中:政策性金融 | 债 | : | 189,959,000.00 | 4.53 | | | | |
| 4 | 企业债券 | | 1 | 243,518,227.40 | 5.80 | | | | |
| 5 | 企业短期融资券 | | | 10,067,000.00 | 0.24 | | | | |
| 6 | 中期票据 | | | - | - | | | | |
| 7 | 可转债 | | - | 381,171,642.37 | 9.08 | | | | |
| 8 | 其他 | | | _ | | - | | | |
| 9 | 合计 | | 849,795,869.77 | | | 20.25 | | | |
| 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五名债券投资明细 | | | | | | | | | |
| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | | 占基金资产净 值比例(%) | | | |
| 1 | 130201 | 13国开01 | 1,500,000 |),000 149,940,000.00 | | 3.57 | | | |
| 2 | 113001 | 中行转债 | 1,250,000 | 127,300,000.00 | | 3.03 | | | |
| 3 | 113003 | 重工转债 | 812,360 | 93,949,434.00 | | 2.24 | | | |
| 4 | 113002 | 工行转债 | 593,450 | 64,110,403.50 | | 1.53 | | | |
| 5 | 110015 | 石化转债 | 450,000 50,418,00 | | 118,000.00 | 1.20 | | | |
| 5.6 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 本基金本报告期末表持有资产支持证券 | | | | | | | | | |

本基金本报告期末末特有资产文种证券。 5.7 报告期末被公允价值主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得到验证明货交易情况记明 3.8.1 报告期末本基金经验的股末期货货仓和损益明细 未基金本报告期6有投资股份的股末期货仓和损益明细 未基金本报告期6有投资股份的股份股份 5.8.2 本基金投资股份的价格的货

| 金額(元) | | | 名称 | | | 序号 | |
|--------------------|--|---------|---------|-----------|-----|----------|--|
| 958,915 | | | 存出保证金 | | | 1 | |
| 学清算款 78,084,904.80 | | 应收证券清算款 | | | 2 | | |
| - | | | 应收股利 | | | 3 | |
| 8,877,288.83 | | | 应收利息 | | | 4 | |
| 3,018,089.11 | | | 应收申购款 | | | 5 | |
| - | | | 其他应收款 | | | 6 | |
| | | | 待摊费用 | | | 7 | |
| | | | 其他 | | | 8 | |
| | | | 合计 | | | 9 | |
| | | - 1 | 「转换债券明细 | 有的处于转股期的可 | 期末持 | 5.9.4 报告 | |
| 公允价值(元) | | | 债券名称 | 债券代码 | | 序号 | |
| 127,300,000.00 | | | 中行转债 | 113001 | | 1 | |
| 93,949,434.00 | | | 重工转债 | 113003 | | 2 | |
| 64,110,403.50 | | | 工行转债 | 113002 | | 3 | |
| 50,418,000.00 | | | 石化转债 | 110015 | | 4 | |
| 22,086,696.80 | | | 国投转债 | 110013 | | 5 | |
| 6,044,487.40 | | | 中海转债 | 110017 | | 6 | |
| 5,115,000.00 | | | 博汇转债 | 110007 | 7 | | |
| 2,424,089.67 | | | 中鼎转债 | 125887 | 8 | | |
| 1,607,250,00 | | | 海运转债 | 110012 | | 9 | |

| § 6 开放式基金份額 | n变动 |
|------------------|------------------|
| - 0 7130-0000000 | 单位:化 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,444,444,237.27 |
| 本报告期基金总申购份额 | 135,458,773.66 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 458,142,127.49 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,121,760,883.44 |
| § 7 备查文件目: | 录 |