

华安策略优选股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010 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

送出日期：2011 年 3 月 26 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 2011 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 2010 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	15,805,415,358.39 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	021-32169999-8755
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-50099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

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	http://www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

§ 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	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	1,323,759,085.61	763,640,792.08	-7,211,535,550.05
本期利润	-476,396,842.16	6,373,988,310.85	-11,240,028,975.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0284	0.3396	-0.5571
本期基金份额净值增长率	-2.88%	67.60%	-52.81%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1077	-0.1898	-0.2326
期末基金资产净值	12,737,751,843.20	14,627,669,405.86	9,647,171,698.86
期末基金份额净值	0.8059	0.8298	0.4951

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	7.91%	1.65%	4.47%	1.39%	3.44%	0.26%
过去六个月	26.77%	1.39%	15.39%	1.22%	11.38%	0.17%
过去一年	-2.88%	1.37%	-7.69%	1.25%	4.81%	0.12%
过去三年	-23.19%	1.74%	-29.98%	1.84%	6.79%	-0.10%
自基金转型起 至今	-9.51%	1.71%	-16.38%	1.80%	6.87%	-0.09%

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%。

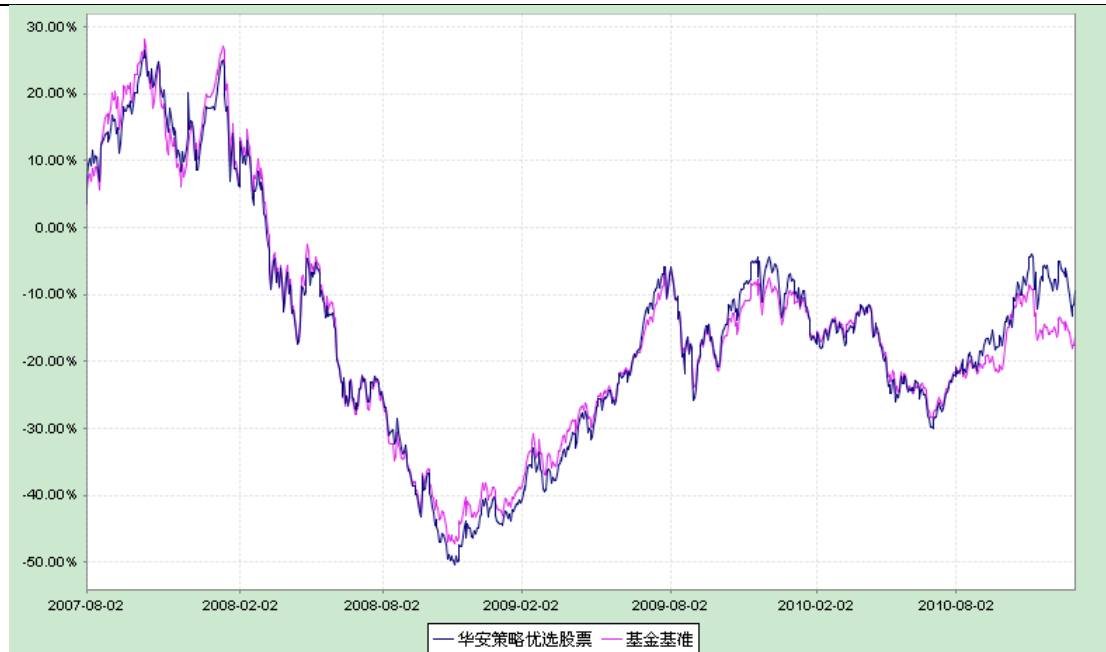
截至 2010 年 12 月 31 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 85.19%，债券的投资比例为基金资产净值的 1.78%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 13.30%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

3.2.2 自基金转型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的历史走势对比图

（2007 年 8 月 2 日至 2010 年 12 月 31 日）

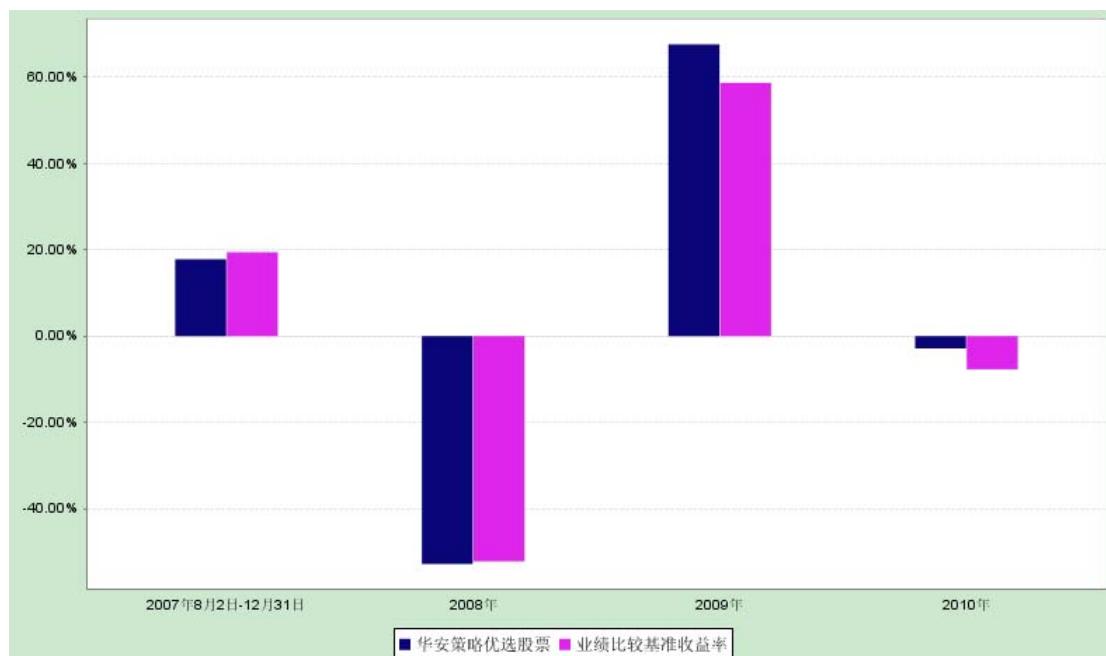


注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型。

3.2.3 自基金转型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

自基金转型以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：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
2010年	-	-	-	-	-
2009年	-	-	-	-	-
2008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 2010 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、上证 180ETF 联接基金、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、上证龙头 ETF 联接基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安稳固收益债券等 19 只开放式基金，管理资产规模达到 825.65 亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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		
张伟	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	2010 年 9 月 21 日	9 年	经济学硕士，持有基金从业资格，9 年证券、基金行业从业经历。曾在平安证券有限公司、天同证券有限公司任职，2004 年 6 月加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员，2008 年 2 月起至 2010 年 9 月 21 日担任本基金的基金经理。

邓跃辉	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	2010 年 3 月 19 日	7 年	经济学硕士，CFA，CPA，7 年基金行业从业经历。2003 年 4 月加入华安基金管理公司，曾任研究发展部高级研究员，2008 年 2 月至 2010 年 3 月担任本基金的基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 3 月同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。
殷鸣	本基金的基金经理	2010 年 9 月 21 日	-	4 年	经济学硕士，拥有基金从业人员资格证书，4 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合规守信情况的说明

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，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

按照华安优选股票和华安安顺封闭的基金合同，华安优选股票和华安安顺封闭都是混合型股票基金。2010 年全年，华安优选股票的净值增长率为-2.88%，华安安顺封闭的净值增长率为 3.79%，华安安顺封闭增长率高于华安优选股票 6.67 个百分点。差异的主要产生于上半年，股票平均仓位的差异是造成两个基金上半年业绩差异较大的主要原因。

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

2010 年国内实体经济强劲复苏，企业盈利快速回升。受全球宽松的流动性影响，以及国内农产品价格快速上涨，通胀预期逐步形成，这也加大了国内政策调控的压力。随着刺激政策的退出和反通胀调控措施密集出台，市场整体处于震荡态势。全年市场行情结构性特征明显，基于对经济转型的预期，电子信息、大消费、医药等受益经济转型的行业表现大幅领先传统周期性行业。结构性行情也导致市场的估值结构性差异较大，成长股的高估值也存在修正风险。

报告期内本基金重点配置转型期受益的电子信息、消费、医药等板块。对绝对估值较低，增长确定的汽车、金融等板块保持一定配置；同时，基于对海外经济复苏以及全球较为宽松的流动性预期，增加对资源品的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.8059 元，本报告期份额净值增长率为-2.88%，同期业绩比较基准增长率为-7.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年是十二五的开局之年，经济逐步进入调整阶段。在全球经济复苏背景下，中国制造业在升值和劳动力成本上升的过程中逐步开始升级的进程，在全球供应链的地位具有提升空间。市场需要逐步接受经济新的均衡情况，表现为相对较低的增速和相对较高的通胀水平。同时宏观政策调控的压力短期不会减轻，市场流动性难以超预期，市场继续震荡可能性大，预期市场将在震荡中找到新的起点或新的平衡。依然看好转型期的结构性机会，十二五期间新的投资方向更值得关注，通信网络、智能电网、多层次交通网的投资等将建设起新经济发展的“高速公路”。投资结构发生的重大转变将对相关设备和下游服务行业起到明显的拉动作用。

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本报告期损益的影响：

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：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任华安安信封闭的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任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，现任华安基金管理有限公司副总裁。

尚志民，基金投资部总经理，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，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在鹏华证券、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、研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部总经理，经济学硕士，13 年银行、基金从业经历。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、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

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 联接的基金经理，金融工程部总经理。

朱永红，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金

管理有限公司，2010 年 11 月 19 日离职前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

2010 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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 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

2010 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(2011)第 20335 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: 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	1,387,614,920.12	528,886.59
结算备付金	277,596,856.83	674,594,425.60
存出保证金	7,868,888.20	6,219,157.91
交易性金融资产	11,076,829,933.93	14,001,382,723.72
其中: 股票投资	10,850,690,900.33	13,523,688,723.72
基金投资	-	-
债券投资	226,139,033.60	477,694,000.00
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	133,135,832.54	61,703,822.63
应收利息	1,139,506.45	2,896,544.87
应收股利	-	-
应收申购款	1,117,182.73	664,729.70
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	12,885,303,120.80	14,747,990,291.02
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2010年12月31日	2009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	105,783,170.41	73,436,457.16
应付赎回款	3,805,881.45	14,469,276.33
应付管理人报酬	16,304,369.00	18,522,524.01
应付托管费	2,717,394.86	3,087,087.35
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	17,152,042.78	9,190,841.09
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,788,419.10	1,614,699.22
负债合计	147,551,277.60	120,320,885.16
所有者权益:		
实收基金	6,231,598,966.59	6,949,879,490.16
未分配利润	6,506,152,876.61	7,677,789,915.70
所有者权益合计	12,737,751,843.20	14,627,669,405.86
负债和所有者权益总计	12,885,303,120.80	14,747,990,291.02

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8059 元，基金份额总额 15,805,415,358.39 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：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期	上年度可比期间
-----	----	---------

	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	-173,672,303.64	6,667,812,559.18
1. 利息收入	26,326,974.87	42,542,106.58
其中：存款利息收入	15,513,901.95	8,968,664.05
债券利息收入	8,097,028.98	33,494,223.24
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,716,043.94	79,219.29
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,599,841,107.70	1,013,863,659.84
其中：股票投资收益	1,526,869,323.68	895,708,478.14
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-1,535,780.00	29,984,579.50
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	74,507,564.02	88,170,602.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-1,800,155,927.77	5,610,347,518.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	315,541.56	1,059,273.99
减：二、费用	302,724,538.52	293,824,248.33
1. 管理人报酬	187,623,582.45	194,780,686.46
2. 托管费	31,270,597.17	32,463,447.82
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	83,167,012.27	65,830,219.17
5. 利息支出	167,762.34	266,658.58
其中：卖出回购金融资产支出	167,762.34	266,658.58
6. 其他费用	495,584.29	483,236.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-476,396,842.16	6,373,988,310.85
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-476,396,842.16	6,373,988,310.85

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：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009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）	7,682,380,354.31	1,964,791,344.55	9,647,171,698.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,373,988,310.85	6,373,988,310.85
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）	-732,500,864.15	-660,989,739.70	-1,393,490,603.85
其中：1. 基金申购款	316,057,804.30	260,798,379.49	576,856,183.79
2. 基金赎回款	-1,048,558,668.45	-921,788,119.19	-1,970,346,787.64
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）	6,949,879,490.16	7,677,789,915.70	14,627,669,405.86

注：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：李劼，主管会计工作负责人：李炳旺，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 $\times$ 80%+中信标普国债指数收益率 $\times$ 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 2011 年 3 月 25 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》、《华安策略优选股票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 2010 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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等

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

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	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

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	187,623,582.45	194,780,686.46
其中：支付销售机构的客户维护费	43,708,491.48	44,975,303.59

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	31,270,597.17	32,463,447.82

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 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	-	-
上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	-	99,807,769.86	-	-	-	-

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

份额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	40,431,464.44	35,272,088.13
期间申购/买入总份额	-	5,159,376.31
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	0.26%	0.23%

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	1,387,614,920.12	4,471,812.93	528,886.59	2,663,049.44

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2010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(2009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(2010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

7.4.9.1.1 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
600104	上海汽车	2010-12-15	2011-12-12	非公开发行	13.87	13.91	11,471,629	159,111,494.23	159,570,359.39	
300157	恒泰艾普	2010-12-29	2011-4-7	新股网下认购	57.00	57.00	440,000	25,080,000.00	25,080,000.00	-
002489	浙江永强	2010-10-13	2011-1-21	新股网下认购	38.00	37.91	270,635	10,284,130.00	10,259,772.85	-
601377	兴业证券	2010-09-29	2011-1-13	新股网下认购	10.00	16.20	503,831	5,038,310.00	8,162,062.20	-
002503	搜于特	2010-11-05	2011-2-17	新股网下认购	75.00	91.26	47,197	3,539,775.00	4,307,198.22	-
300140	启源装备	2010-11-03	2011-2-14	新股网下认购	39.98	45.50	88,151	3,524,276.98	4,010,870.50	-
300130	新国都	2010-10-12	2011-1-20	新股网下认购	43.33	45.25	77,870	3,374,107.10	3,523,617.50	-
300137	先河环保	2010-10-27	2011-2-9	新股网下认购	22.00	38.21	91,907	2,021,954.00	3,511,766.47	-
300131	英唐智控	2010-10-12	2011-1-20	新股网下认购	36.00	56.88	46,547	1,675,692.00	2,647,593.36	-
002486	嘉麟杰	2010-09-29	2011-1-17	新股网下认购	10.90	14.90	112,537	1,226,653.30	1,676,801.30	-
601098	中南传媒	2010-10-22	2011-1-28	新股网下认购	10.66	11.98	91,148	971,637.68	1,091,953.04	-
600998	九州通	2010-10-27	2011-2-9	新股网下认购	13.00	14.55	44,517	578,721.00	647,722.35	-

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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600315	上海家化	2010-12-04	资产重组	37.13	未知	未知	1,900,905	69,234,264.18	70,580,602.65	

注：本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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 2010 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 2010 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

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)。

于 2010 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 10,817,335,971.89 元, 属于第二层级的余额为 259,493,962.04 元, 无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日: 第一层级 13,093,751,723.72 元, 第二层级 907,631,000.00 元, 无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票, 本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级, 并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度: 同)。对于持有的非公开发行股票, 本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级, 并于限售期满后从第二层级转入第一层级(2009 年度: 同)。

(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	10,850,690,900.33	84.21
	其中: 股票	10,850,690,900.33	84.21
2	固定收益投资	226,139,033.60	1.76
	其中: 债券	226,139,033.60	1.76
	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	1,665,211,776.95	12.92
6	其他各项资产	143,261,409.92	1.11
7	合计	12,885,303,120.80	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	178,716,140.55	1.40
B	采掘业	430,015,557.76	3.38
C	制造业	7,002,431,519.95	54.97
C0	食品、饮料	788,524,777.62	6.19
C1	纺织、服装、皮毛	1,676,801.30	0.01
C2	木材、家具	10,259,772.85	0.08

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	496,968,302.84	3.90
C5	电子	455,153,823.56	3.57
C6	金属、非金属	1,325,101,494.18	10.40
C7	机械、设备、仪表	2,892,301,874.06	22.71
C8	医药、生物制品	1,032,444,673.54	8.11
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	97,327,186.30	0.76
E	建筑业	327,869,535.83	2.57
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,473,276,836.35	11.57
H	批发和零售贸易	702,796,752.45	5.52
I	金融、保险业	512,313,396.12	4.02
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	55,262,484.48	0.43
L	传播与文化产业	70,681,490.54	0.55
M	综合类	-	-
	合计	10,850,690,900.33	85.19

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	600104	上海汽车	53,068,062	770,205,995.83	6.05
2	002123	荣信股份	7,505,681	356,519,847.50	2.80
3	601601	中国太保	14,827,176	339,542,330.40	2.67
4	600588	用友软件	14,123,059	328,502,352.34	2.58
5	002024	苏宁电器	24,431,468	320,052,230.80	2.51
6	600570	恒生电子	15,580,690	315,508,972.50	2.48
7	000792	盐湖钾肥	4,088,615	270,829,857.60	2.13
8	600600	青岛啤酒	7,597,428	263,478,803.04	2.07
9	600276	恒瑞医药	4,187,637	249,415,659.72	1.96
10	000012	南玻A	12,597,571	248,802,027.25	1.95

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	601601	中国太保	1,124,854,061.93	7.69
2	600104	上海汽车	1,019,999,719.23	6.97
3	601288	农业银行	599,758,133.23	4.10
4	000002	万 科 A	594,053,970.29	4.06
5	600588	用友软件	468,189,316.79	3.20
6	601106	中国一重	437,510,158.48	2.99
7	601179	中国西电	420,974,586.20	2.88
8	601628	中国人寿	411,499,923.62	2.81
9	000001	深发展 A	352,626,780.77	2.41
10	000012	南 玻 A	352,051,764.70	2.41
11	002123	荣信股份	351,088,553.98	2.40
12	600570	恒生电子	332,150,714.87	2.27
13	600348	国阳新能	326,776,716.19	2.23
14	600312	平高电气	323,536,490.76	2.21
15	600600	青岛啤酒	320,498,079.83	2.19
16	600519	贵州茅台	291,488,134.34	1.99
17	600352	浙江龙盛	272,804,057.86	1.86
18	000792	盐湖钾肥	270,527,916.83	1.85
19	601166	兴业银行	259,856,184.47	1.78
20	600198	大唐电信	254,287,129.99	1.74

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	601318	中国平安	854,057,766.98	5.84
2	601601	中国太保	769,136,946.35	5.26
3	600519	贵州茅台	713,555,488.64	4.88
4	601166	兴业银行	649,802,797.33	4.44
5	600036	招商银行	618,066,550.10	4.23
6	601288	农业银行	580,880,029.09	3.97
7	000002	万 科 A	569,474,518.74	3.89
8	600348	国阳新能	504,894,161.36	3.45
9	601169	北京银行	497,529,279.19	3.40
10	600276	恒瑞医药	491,914,505.36	3.36
11	600352	浙江龙盛	473,177,683.75	3.23
12	601666	平煤股份	412,376,026.07	2.82
13	000425	徐工机械	393,270,631.70	2.69
14	000983	西山煤电	378,262,135.95	2.59

15	601628	中国人寿	373,374,786.91	2.55
16	601179	中国西电	369,064,823.77	2.52
17	600585	海螺水泥	363,382,732.54	2.48
18	600050	中国联通	344,026,166.42	2.35
19	600048	保利地产	339,414,234.25	2.32
20	600028	中国石化	334,898,090.39	2.29
21	601088	中国神华	331,358,430.26	2.27
22	601106	中国一重	324,639,446.91	2.22
23	000963	华东医药	312,580,891.02	2.14
24	600123	兰花科创	311,231,663.60	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	25,820,857,112.41
卖出股票的收入（成交）总额	28,203,911,047.64

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	-	-
2	央行票据	29,343,000.00	0.23
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	196,796,033.60	1.54
7	其他	-	-
8	合计	226,139,033.60	1.78

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	113001	中行转债	1,701,870	186,967,438.20	1.47
2	1001021	10 央票 21	300,000	29,343,000.00	0.23
3	110011	歌华转债	66,260	8,142,691.40	0.06

4	110009	双良转债	13,200	1,685,904.00	0.01
---	--------	------	--------	--------------	------

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,868,888.20
2	应收证券清算款	133,135,832.54
3	应收股利	—
4	应收利息	1,139,506.45
5	应收申购款	1,117,182.73
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	143,261,409.92

8.9.4 期末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	占基金资产净值比例(%)
1	113001	中行转债	186,967,438.20	1.47
2	110009	双良转债	1,685,904.00	0.01

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
----	------	------	----------------	--------------	----------

1	600104	上海汽车	159,570,359.39	1.25	非公开发行股票未上市
---	--------	------	----------------	------	------------

§ 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
1,509,454	10,470.95	429,120,199.54	2.72%	15,376,295,158.85	97.28%

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	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	52,975.15	0.00034%

§ 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	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	17,627,212,320.55
本报告期基金总申购份额	462,048,107.98
减：本报告期基金总赎回份额	2,283,845,070.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	15,805,415,358.39

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、基金管理人的重大人事变动：

2010年1月16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，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

2010年3月19日，基金管理人发布了关于基金经理变更的公告，鉴于邓跃辉先生因个人原因提出辞职，经华安基金管理有限公司研究，同意其辞职申请，并免去其华安宝利配置证券投资基金与华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理职务。

2010年5月13日，基金管理人发布了关于总经理任职的公告，经本公司董事会会议审议通过，聘任李勃先生任本公司总经理。董事长俞妙根先生不再兼任总经理职务。

2010年9月20日，基金管理人发布了关于基金经理调整的公告，因工作需要，经华安基金管理有限公司董事会审议批准，决定聘任殷鸣先生担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理，张伟先生不再担任华安策略优选股票基金的基金经理。

2、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

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

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158,000.00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、托管人的托管业务部门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	
光大证券股份有限公司	1	7,849,627,291.59	14.62%	6,377,872.68	14.20%	-
华泰联合证券有限责任公司	2	5,794,610,678.17	10.80%	4,801,698.02	10.69%	报告期内新增了1个交易单元
瑞银证券有限责任公司	1	4,803,122,044.40	8.95%	4,082,649.85	9.09%	-
安信证券股份有限公司	1	4,750,402,687.49	8.85%	4,037,820.00	8.99%	-
东方证券股份	2	4,413,473,345.28	8.22%	3,585,970.82	7.98%	-

有限公司						
江海证券有限公司	1	4,144,746,036.27	7.72%	3,523,034.65	7.84%	-
申银万国证券股份有限公司	1	3,543,784,742.02	6.60%	3,012,210.16	6.71%	-
中信证券股份有限公司	1	2,691,127,759.29	5.01%	2,186,553.14	4.87%	-
中航证券有限公司	1	2,515,133,175.45	4.69%	2,137,866.10	4.76%	-
齐鲁证券有限公司	1	1,747,972,744.47	3.26%	1,485,777.47	3.31%	-
东海证券有限责任公司	1	1,493,764,998.19	2.78%	1,269,695.32	2.83%	报告期内新增了 1 个交易单元
国金证券股份有限公司	1	1,448,002,841.25	2.70%	1,230,796.77	2.74%	-
中信金通证券有限责任公司	1	1,372,970,374.41	2.56%	1,167,025.29	2.60%	报告期内新增了 1 个交易单元
华宝证券有限责任公司	1	1,228,363,217.10	2.29%	1,044,105.61	2.32%	报告期内新增了 1 个交易单元
国泰君安证券股份有限公司	1	1,122,230,333.95	2.09%	953,894.34	2.12%	-
西部证券股份有限公司	1	1,090,418,205.58	2.03%	926,849.30	2.06%	-
平安证券有限责任公司	1	1,030,556,772.14	1.92%	875,974.51	1.95%	-
国元证券股份有限公司	1	932,519,376.29	1.74%	792,641.27	1.76%	-
中银国际证券有限责任公司	1	751,387,798.97	1.40%	610,506.76	1.36%	-
中信建投证券有限责任公司	1	512,827,383.72	0.96%	435,902.12	0.97%	-
国海证券有限责任公司	1	436,910,228.53	0.81%	371,371.44	0.83%	-
第一创业证券有限责任公司	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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		债券成交总额的比例		购成交总额的比例		证成交总额的比例
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	99,348,679.30	79.38%	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中航证券有限公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	-	-	-	-	-	-
东海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信金通证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	25,810,473.50	20.62%	-	-	-	-

国海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

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

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相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》

研究发展部或基金投资部/市场部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研究发展部或基金投资部/市场部提交的《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。

华安基金管理有限公司
2011 年 3 月 26 日

