

# 华安稳定收益债券型证券投资基金 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 3 月 11 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 2010 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华安稳定收益债券		
基金主代码	040009		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2008 年 4 月 30 日		
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		
报告期末基金份额总额	1,653,358,559.25 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B	
下属分级基金的交易代码	040009 (前端)	041009 (后端)	040010
报告期末下属分级基金的份 额总额	967,813,047.19 份		685,545,512.06 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益及市场价格变动收益，以追求资产持续稳健的增值。
投资策略	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各种数量模型工具，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，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产的分配比例。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	yindong@ccb.cn

客户服务电话	40088-50099	010-67595096
传真	021-68863414	010-66275833

## 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 4 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2008 年 12 月 31 日	
	华安稳定 收益债券 A	华安稳定 收益债券 B	华安稳定 收益债券 A	华安稳定 收益债券 B	华安稳定 收益债券 A	华安稳定 收益债券 B
本期已实现收益	43,665,248.73	16,940,565.98	84,033,351.21	34,955,809.55	80,928,227.45	26,578,400.28
本期利润	46,866,072.81	19,668,169.34	-8,233,950.77	-3,748,445.25	189,141,645.94	60,294,898.48
加权平均基金份额本期利润	0.1008	0.1166	-0.0112	-0.0122	0.0874	0.0916
本期基金份额净值增长率	8.73%	8.35%	3.79%	3.33%	9.53%	9.21%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末		2009 年末		2008 年末	
	华安稳定 收益债券 A	华安稳定 收益债券 B	华安稳定 收益债券 A	华安稳定 收益债券 B	华安稳定 收益债券 A	华安稳定 收益债券 B
期末可供分配基金份额利润	0.0462	0.0328	0.1055	0.0972	0.0403	0.0373
期末基金资产净值	1,020,500,969.86	713,793,850.96	410,079,422.11	142,634,760.84	1,974,333,107.35	1,108,989,906.10
期末基金份额净值	1.0544	1.0412	1.1055	1.0972	1.0953	1.0921

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：封闭式基金交易佣金、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 2008 年 4 月 30 日成立。合同生效当期不是完整报告期。

### 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

华安稳定收益债券 A:

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	3.10%	0.35%	-2.25%	0.16%	5.35%	0.19%
过去六个月	8.81%	0.28%	-1.45%	0.12%	10.26%	0.16%
过去一年	8.73%	0.28%	1.92%	0.10%	6.81%	0.18%
自基金合同生效起至今	23.62%	0.26%	11.98%	0.15%	11.64%	0.11%

华安稳定收益债券 B:

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	3.04%	0.35%	-2.25%	0.16%	5.29%	0.19%
过去六个月	8.66%	0.28%	-1.45%	0.12%	10.11%	0.16%
过去一年	8.35%	0.28%	1.92%	0.10%	6.43%	0.18%
自基金合同生效起至今	22.26%	0.26%	11.98%	0.15%	10.28%	0.11%

#### 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

华安稳定收益债券型证券投资基金

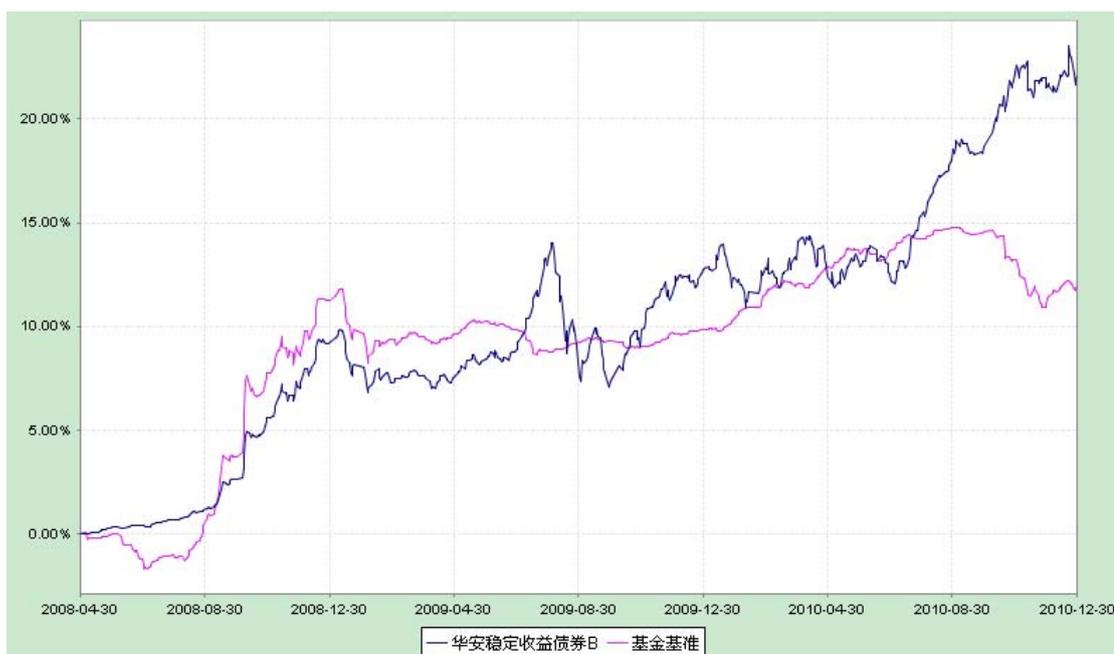
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2008 年 4 月 30 日至 2010 年 12 月 31 日)

华安稳定收益债券 A

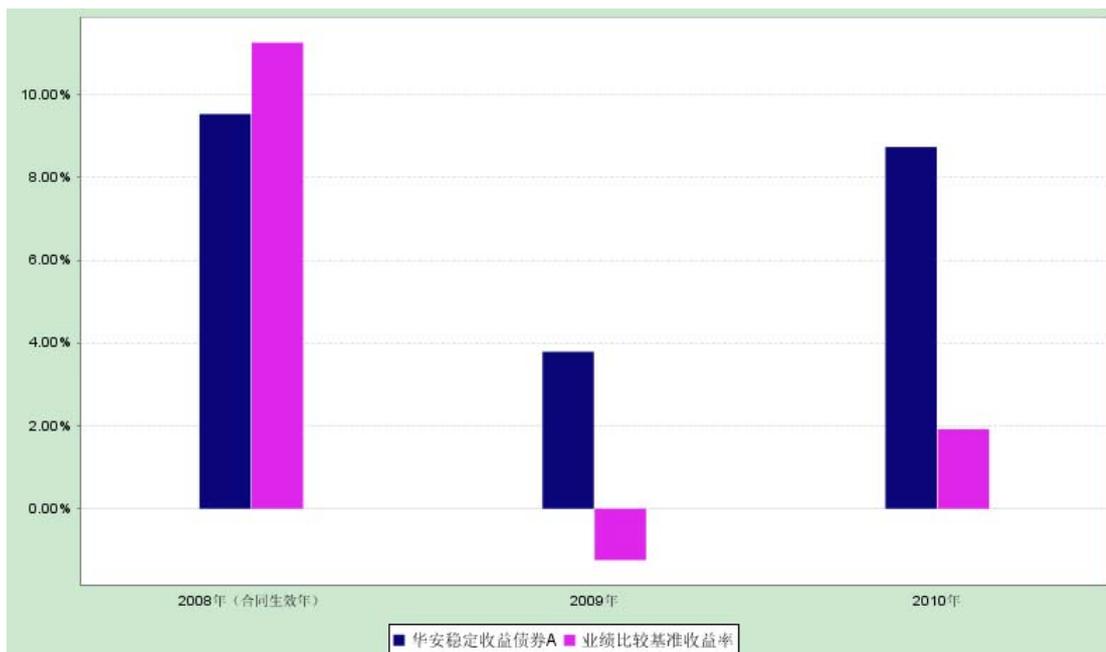


华安稳定收益债券 B

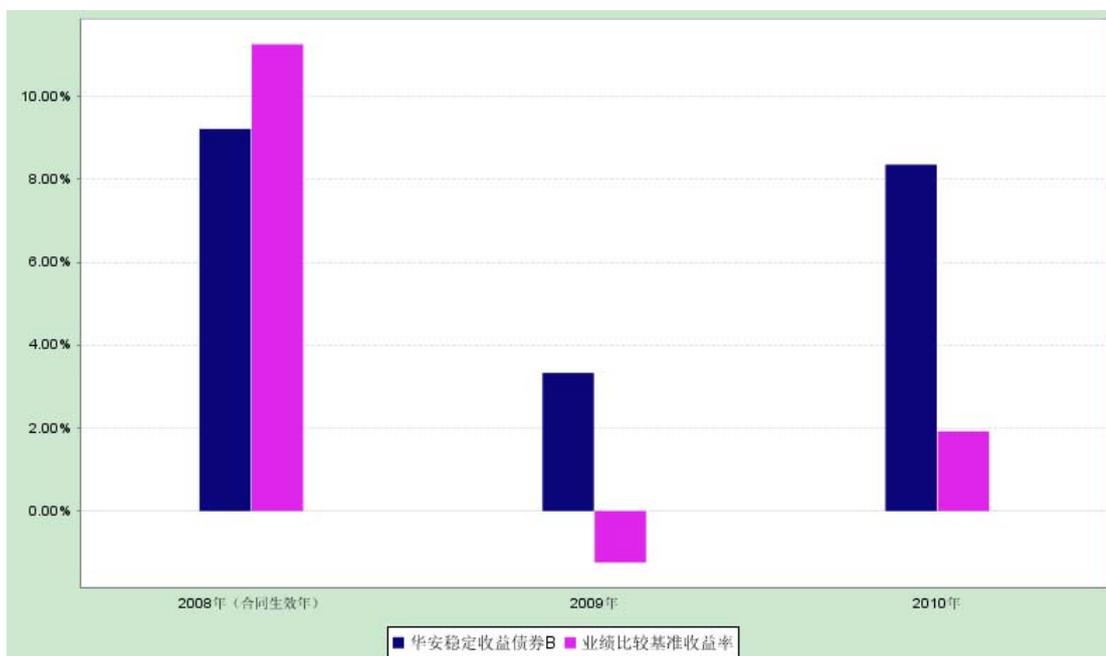


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安稳定收益债券 A



华安稳定收益债券 B



注：基金合同生效以来未满 5 年，图示为基金合同生效以来各年度的数据，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

#### 1、华安稳定收益债券 A

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	1.450	79,374,105.96	16,198,750.57	95,572,856.53	-
2009 年	0.300	42,920,820.63	12,766,976.20	55,687,796.83	-
2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日	-	-	-	-	-
合计	1.750	122,294,926.59	28,965,726.77	151,260,653.36	-

#### 2、华安稳定收益债券 B

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	1.450	40,708,353.51	9,228,767.61	49,937,121.12	-
2009 年	0.300	16,608,450.84	5,674,222.17	22,282,673.01	-
2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日	-	-	-	-	-
合计	1.750	57,316,804.35	14,902,989.78	72,219,794.13	-

## § 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	2008年4月 30日	-	12年	金融学硕士（金融工程方向），12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《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安稳定收益债券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，除 2010 年 2 月 1 日申

购中国一重因最终网下申购中签率大大超出了基金的预估控制线，导致了华安稳定收益债券获配数达到 10,207,553 股，超出了 2 月 3 日基金资产净值的 10%（实际比例 10.78%）外，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

本基金为债券型基金，其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

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 GDP 前高后低，CPI 前低后高。宏观调控亦呈现两头紧中间松的态势，央行全年上调存准六次，加息两次，且下半年针对通胀形势，货币政策基调

由宽松转为稳健。全年货币市场利率前低后高，债券市场先涨后跌，四季度随着加息的启动，中长债收益率出现大幅上行。股票市场震荡剧烈、结构分化。以沪深 300 指数为代表的大盘蓝筹股虽在美国 QE2 的刺激下有所表现，但全年仍出现负收益；而小盘成长股在“调结构、新经济”的热情追捧下，中小板指数全年增长两成以上。可转债市场快速扩容，流动性增加，两行转债和有色行业转债下半年成为市场关注的焦点。新股发行节奏加快，发行市盈率高企，上市首日出现破发，年底深交所改革发行制度，新股获中概率降低。

华安稳定收益债券基金结合宏观和政策面的变化，上半年对中长期债券进行了波段操作，下半年相对谨慎，维持了组合的低久期。组合信用债全年保持相对高的仓位，期间进行了结构调整以优化组合收益。可转债操作方面有得有失，从全年角度来看实现了较大的正收益，尤其把握住了下半年两行转债和有色转债的波段操作机会，并在年底及时兑现了盈利。下半年新股申购收益好于上半年，主要的改进措施是加强与行业研究员的沟通择股申购，并在控制权益类总体仓位的基础上分散化投化，以减少净值下行波动风险。从全年看，信用债、可转债和新股申购对组合的净值增长贡献较大。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，华安稳定收益债券 A 份额净值增长率为 8.73%，华安稳定收益债券 B 份额净值增长率为 8.35%，同期业绩比较基准增长率为 1.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下阶段，美国经济在经过 3~4 年调整后逐步走向复苏，QE2 后金融加速器开始实现正向反馈，我们认为美国经济边际上已达成平衡，2011 年 GDP 有望实现潜在增长速率，但受房地产高库存以及高失业率的影响，美国经济实现存量平衡的过程仍将漫长。全球经济处于复苏阶段，期间受欧债、北非中东局势动荡等事件性的影响仍将有波动。中国经济仍处于调整周期，增速可能略有放缓，但总体较为平稳。预计全年 GDP 前低后高、CPI 前高后低。为管理通胀预期，上半年货币政策将保持偏紧节奏，随着 CPI 回落、M2 增速下行，以及为防范房地产投资下行对经济的可能影响，预计下半年货币政策将保持相对宽松。债市受加息预期以及存款准备金率不断走高而带来的流动性的冲击，预计上半年收益率将

保持相对高位。信用债供给的增加将为投资者提供高票息债券投资机会。可转债市场估值逐渐合理，结构性机会重新开始涌现。新股发行加快，“打新”成为考验投资人择股能力的技术活。我们将结合宏观经济和通胀走势，动态调整组合久期，努力把握因政策密集调控对经济可能造成的下行冲击而为债市带来的波段机会。从获取绝对收益的角度，维持信用债的相对高仓位，动态调整信用债结构。逐步增仓估值合理的可转债，谨慎择股参与新股申购。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、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

2010 年 8 月 23 日，公告向本基金持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 0.80 元。权益登记日、除息日：2010 年 8 月 26 日；红利划出日、红利再投资日：2010 年 8 月 27 日；现金红利再投资的基金份额可赎回起始日：2010 年 8 月 31 日。

2010 年 12 月 20 日，公告向本基金持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 0.65 元。权益登记日、除息日：2010 年 12 月 23 日；红利划出日、红利再投资日：2010 年 12 月 24 日；现金红利再投资的基金份额可赎回起始日：2010 年 12 月 28 日。

## § 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投资运作合规守信、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，发现本基金因参与“中国一重”网下申购而导致监督指标超出监督比例并及时通知了基金管理人，未发现基金管理人有害损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为华安稳定收益债券 A: 95,572,856.53 元；华安稳定收益债券 B: 49,937,121.12 元。

## 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、金毅签字出具了普华永道中天审字(2011)第 20336 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：华安稳定收益债券型证券投资基金

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
-----	--------------------	---------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	538,668,309.77	149,437,842.77
结算备付金	2,905,410.28	1,679,205.77
存出保证金	12,315.79	13,410.83
交易性金融资产	1,014,421,725.54	565,988,825.50
其中：股票投资	86,695,741.68	49,498,908.75
基金投资	-	-
债券投资	927,725,983.86	516,489,916.75
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	690,000,000.00	-
应收证券清算款	5,617,543.74	6,777,798.72
应收利息	12,398,081.52	9,529,743.84
应收股利	-	-
应收申购款	1,643,745.20	2,175,574.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,265,667,131.84	735,602,402.33
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
	<b>2010年12月31日</b>	<b>2009年12月31日</b>
<b>负债：</b>		
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	-	138,999,665.60
应付证券清算款	519,781,082.82	1,559,290.03
应付赎回款	10,277,771.45	41,557,916.85
应付管理人报酬	542,119.91	298,047.66
应付托管费	180,706.62	99,349.21
应付销售服务费	121,743.72	49,660.63
应付交易费用	97,580.29	48,930.79
应交税费	36,746.00	36,746.00
应付利息	-	8,757.05
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	334,560.21	229,855.56
负债合计	531,372,311.02	182,888,219.38
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	1,653,358,559.25	500,950,498.27
未分配利润	80,936,261.57	51,763,684.68
所有者权益合计	1,734,294,820.82	552,714,182.95
负债和所有者权益总计	2,265,667,131.84	735,602,402.33

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，A 类份额净值 1.0544 元，B 类份额净值 1.0412 元；基金份额总额 1,653,358,559.25 份，其中 A 类份额总额 967,813,047.19 份，B 类份额总额 685,545,512.06 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

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	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
<b>一、收入</b>	<b>77,238,843.03</b>	<b>269,939.22</b>
1. 利息收入	28,779,290.32	38,793,621.11
其中：存款利息收入	829,824.86	1,041,686.64
债券利息收入	27,405,098.27	37,370,691.99
资产支持证券利息 收入	-	-
买入返售金融资产 收入	544,367.19	381,242.48
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）	42,038,440.63	91,434,577.17
其中：股票投资收益	28,130,358.19	8,205,681.14
债券投资收益	13,610,459.28	82,515,309.58
基金投资收益	-	-
资产支持证券投资 收益	-	-
衍生工具收益	-	542,685.23
股利收益	297,623.16	170,901.22
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	5,928,427.44	-130,971,556.78
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	492,684.64	1,013,297.72
<b>减：二、费用</b>	<b>10,704,600.88</b>	<b>12,252,335.24</b>
1. 管理人报酬	4,203,661.81	6,889,168.88
2. 托管费	1,401,220.62	2,296,389.56
3. 销售服务费	735,985.02	1,355,719.42

4. 交易费用	700,791.84	418,256.25
5. 利息支出	3,288,821.40	894,178.84
其中：卖出回购金融资产支出	3,288,821.40	894,178.84
6. 其他费用	374,120.19	398,622.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	<b>66,534,242.15</b>	<b>-11,982,396.02</b>
减：所得税费用	-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	<b>66,534,242.15</b>	<b>-11,982,396.02</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

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）	500,950,498.27	51,763,684.68	552,714,182.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	66,534,242.15	66,534,242.15
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）	1,152,408,060.98	108,148,312.39	1,260,556,373.37
其中：1. 基金申购款	2,193,428,174.74	208,040,696.07	2,401,468,870.81
2. 基金赎回款	-1,041,020,113.76	-99,892,383.68	-1,140,912,497.44
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）	-	-145,509,977.65	-145,509,977.65
五、期末所有者权益（基金净值）	1,653,358,559.25	80,936,261.57	1,734,294,820.82
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）	2,818,035,321.77	265,287,691.68	3,083,323,013.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,982,396.02	-11,982,396.02
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）	-2,317,084,823.50	-123,571,141.14	-2,440,655,964.64
其中：1. 基金申购款	1,306,221,361.63	101,438,726.56	1,407,660,088.19

2. 基金赎回款	-3,623,306,185.13	-225,009,867.70	-3,848,316,052.83
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）	-	-77,970,469.84	-77,970,469.84
五、期末所有者权益（基金净值）	500,950,498.27	51,763,684.68	552,714,182.95

报表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：

李勍	李炳旺	陈林
基金管理公司负责人	主管会计工作的负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华安稳定收益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[2008]294 号《关于核准华安稳定收益债券型证券投资基金募集申请的批复》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《华安稳定收益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 3,130,395,744.96 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 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,130,761,926.67 份基金份额,其中认购资金利息折合 366,181.71 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《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》和《华安稳定收益债券型证券投资基金招募说明书》,本基金自募集期起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/申购时收取认/申购费用的,称为 A 类;在投资者认/申购时不收取认/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 和 B 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。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《华安稳定收益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固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、信用等级为投资级的企业(公司)债，以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的 80%-100%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股票等权益类品种的投资比例为基金资产的 0%-20%。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数。

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》、《华安稳定收益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 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有关信息。

#### **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 (“华安基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	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

上海工业投资(集团)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 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	4,203,661.81	6,889,168.88
其中：支付销售机构的客户 维护费	375,516.99	575,897.66

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 0.6% 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 × 0.6% / 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	1,401,220.62	2,296,389.56

注：支付基金托管人中国建设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

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安稳定收益 债券 A	华安稳定收 益债券 B	合计
华安基金管理有限公司	-	309,997.99	309,997.99
中国建设银行股份有限公司	-	156,514.04	156,514.04
合计	-	466,512.03	466,512.03
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	华安稳定收益 债券 A	华安稳定收 益债券 B	合计
华安基金管理有限公司	-	376,932.34	376,932.34
中国建设银行股份有限公司	-	335,131.12	335,131.12
合计	-	712,063.46	712,063.46

注：支付基金销售机构的 B 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值 0.4% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给华安基金管理有限公司，再由华安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A 类基金份额不收取销售服务费。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 ×0.4% / 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
-	-	-	-	-	-	-
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
中国建设银行 股份有限公司	159,715,780.43	79,656,683.84	-	-	-	-

**7.4.8.4 各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
中国建设银行 股份有限公司	538,668,309.77	777,625.54	149,437,842.77	1,003,249.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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（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
300150	世纪瑞尔	2010-12-15	2011-03-22	新股网 下认购	32.99	47.80	770,000	25,402,300.00	36,806,000.00	-
300134	大富科技	2010-10-14	2011-01-26	新股网 下认购	49.50	66.00	93,457	4,626,121.50	6,168,162.00	-
002491	通鼎光电	2010-10-13	2011-01-21	新股网 下认购	14.50	20.81	294,413	4,268,988.50	6,126,734.53	-
002490	山东墨龙	2010-10-13	2011-01-21	新股网 下认购	18.00	23.14	258,143	4,646,574.00	5,973,429.02	-
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	新股网 下认购	5.99	5.99	985,236	5,901,563.64	5,901,563.64	-
601777	力帆股份	2010-11-17	2011-02-28	新股网 下认购	14.50	14.06	208,759	3,027,005.50	2,935,151.54	-
002506	超日太阳	2010-11-10	2011-02-18	新股网 下认购	36.00	44.51	62,041	2,233,476.00	2,761,444.91	-

300140	启源装备	2010-11-03	2011-02-14	新股网 下认购	39.98	45.50	58,767	2,349,504.66	2,673,898.50	-
601890	亚星锚链	2010-12-17	2011-03-28	新股网 下认购	22.50	21.50	88,885	1,999,912.50	1,911,027.50	-
300137	先河环保	2010-10-27	2011-02-09	新股网 下认购	22.00	38.21	45,953	1,010,966.00	1,755,864.13	-
002486	嘉麟杰	2010-09-29	2011-01-17	新股网 下认购	10.90	14.90	112,537	1,226,653.30	1,676,801.30	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股网 下认购	23.00	31.11	48,568	1,117,064.00	1,510,950.48	-
300128	锦富新材	2010-09-27	2011-01-13	新股网 下认购	35.00	47.19	31,026	1,085,910.00	1,464,116.94	-
600998	九州通	2010-10-27	2011-02-09	新股网 下认购	13.00	14.55	80,131	1,041,703.00	1,165,906.05	-
002504	东光微电	2010-11-10	2011-02-18	新股网 下认购	16.00	26.85	42,694	683,104.00	1,146,333.90	-
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	新股网 下认购	23.98	31.24	29,679	711,702.42	927,171.96	-
300157	恒泰艾普	2010-12-29	2011-01-07	新股网 上认购	57.00	57.00	500	28,500.00	28,500.00	-
300155	安居宝	2010-12-29	2011-01-07	新股网 上认购	49.00	49.00	500	24,500.00	24,500.00	-
300158	振东制药	2010-12-29	2011-01-07	新股网 上认购	38.80	38.80	500	19,400.00	19,400.00	-

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

无。

#### 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 519,203,725.54 元，第二层级的余额为 495,218,000.00 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 351,183,825.50 元，第二层级的余额为 214,805,000.00 元，无属于第三层级的余额)。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(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	86,695,741.68	3.83
	其中：股票	86,695,741.68	3.83
2	固定收益投资	927,725,983.86	40.95
	其中：债券	927,725,983.86	40.95
	资产支持证券	-	-

3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	690,000,000.00	30.45
	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	541,573,720.05	23.90
6	其他各项资产	19,671,686.25	0.87
7	合计	2,265,667,131.84	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	5,901,563.64	0.34
B	采掘业	28,500.00	0.00
C	制造业	24,839,618.22	1.43
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	1,676,801.30	0.10
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	5,396,395.75	0.31
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	17,747,021.17	1.02
C8	医药、生物制品	19,400.00	0.00
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,811,999.28	0.10
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	49,100,896.53	2.83
H	批发和零售贸易	2,093,078.01	0.12
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,920,086.00	0.17
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	86,695,741.68	5.00

### 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	300150	世纪瑞尔	770,000	36,806,000.00	2.12
2	300134	大富科技	93,457	6,168,162.00	0.36
3	002491	通鼎光电	294,413	6,126,734.53	0.35
4	002490	山东墨龙	258,143	5,973,429.02	0.34
5	601118	海南橡胶	985,236	5,901,563.64	0.34
6	601777	力帆股份	208,759	2,935,151.54	0.17
7	002469	三维工程	37,437	2,920,086.00	0.17
8	002506	超日太阳	62,041	2,761,444.91	0.16
9	300140	启源装备	58,767	2,673,898.50	0.15
10	601890	亚星锚链	88,885	1,911,027.50	0.11

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	601106	中国一重	58,183,052.10	10.53%
2	600598	北大荒	38,780,812.29	7.02%
3	600352	浙江龙盛	35,378,218.54	6.40%
4	300150	世纪瑞尔	25,402,300.00	4.60%
5	000960	锡业股份	17,288,060.56	3.13%
6	600558	大西洋	12,100,317.81	2.19%
7	601006	大秦铁路	11,705,157.81	2.12%
8	000969	安泰科技	10,625,421.54	1.92%
9	601118	海南橡胶	5,901,563.64	1.07%
10	002490	山东墨龙	4,646,574.00	0.84%
11	300134	大富科技	4,626,121.50	0.84%
12	300122	智飞生物	4,311,527.58	0.78%
13	002491	通鼎光电	4,268,988.50	0.77%
14	002441	众业达	3,091,771.20	0.56%

15	601777	力帆股份	3,027,005.50	0.55%
16	002465	海格通信	3,022,710.00	0.55%
17	002474	榕基软件	2,583,044.00	0.47%
18	002415	海康威视	2,555,848.00	0.46%
19	002479	富春环保	2,383,042.80	0.43%
20	300140	启源装备	2,349,504.66	0.43%

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	601106	中国一重	54,712,636.66	9.90
2	600598	北大荒	38,266,005.08	6.92
3	600352	浙江龙盛	29,899,839.17	5.41
4	000960	锡业股份	16,818,783.18	3.04
5	601006	大秦铁路	11,745,381.72	2.13
6	600558	大西洋	11,714,955.64	2.12
7	601668	中国建筑	10,884,993.38	1.97
8	000969	安泰科技	10,868,595.60	1.97
9	600999	招商证券	4,356,177.00	0.79
10	300122	智飞生物	3,972,224.90	0.72
11	300105	龙源技术	3,959,010.40	0.72
12	300102	乾照光电	3,666,641.96	0.66
13	002428	云南锗业	3,640,331.50	0.66
14	601618	中国中冶	3,593,720.74	0.65
15	002441	众业达	3,500,582.92	0.63
16	002439	启明星辰	3,393,571.80	0.61
17	002431	棕榈园林	3,353,564.00	0.61
18	002474	榕基软件	3,294,236.18	0.60
19	002437	誉衡药业	3,172,836.82	0.57
20	002465	海格通信	3,170,611.71	0.57

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	323,054,214.11
卖出股票的收入（成交）总额	324,909,432.63

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	60,510,952.80	3.49
2	央行票据	244,895,000.00	14.12
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	379,538,397.50	21.88
5	企业短期融资券	119,523,000.00	6.89
6	可转债	123,258,633.56	7.11
7	其他	-	-
8	合计	927,725,983.86	53.49

### 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	1001032	10 央票 32	1,200,000	117,804,000.00	6.79
2	1001077	10 央票 77	1,000,000	97,040,000.00	5.60
3	122939	09 吉安债	557,520	60,741,804.00	3.50
4	122033	09 富力债	513,070	53,718,429.00	3.10
5	1081325	10 沪城控 CP01	500,000	49,770,000.00	2.87

### 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的，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	12,315.79
2	应收证券清算款	5,617,543.74
3	应收股利	-
4	应收利息	12,398,081.52
5	应收申购款	1,643,745.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,671,686.25

**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	113001	中行转债	39,549,600.00	2.28

**8.9.5** 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300150	世纪瑞尔	36,806,000.00	2.12	新股网下认购
2	300134	大富科技	6,168,162.00	0.36	新股网下认购
3	002491	通鼎光电	6,126,734.53	0.35	新股网下认购
4	002490	山东墨龙	5,973,429.02	0.34	新股网下认购
5	601118	海南橡胶	5,901,563.64	0.34	新股网下认购

6	601777	力帆股份	2,935,151.54	0.17	新股网下认购
7	002506	超日太阳	2,761,444.91	0.16	新股网下认购
8	300140	启源装备	2,673,898.50	0.15	新股网下认购
9	601890	亚星锚链	1,911,027.50	0.11	新股网下认购

## § 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
华安稳定收益债券 A	7,718	125,396.87	812,727,384.24	83.98%	155,085,662.95	16.02%
华安稳定收益债券 B	5,438	126,065.74	513,100,268.20	74.85%	172,445,243.86	25.15%
合计	13,156	125,673.35	1,325,827,652.44	80.19%	327,530,906.81	19.81%

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）。

### 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	华安稳定收益债券 A	-	-
	华安稳定收益债券 B	832,846.21	0.1215%
	合计	832,846.21	0.0504%

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	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
----	------------	------------

基金合同生效日(2008年4月30日)基金份额总额	2,398,033,991.27	732,727,935.40
本报告期期初基金份额总额	370,948,351.88	130,002,146.39
本报告期基金总申购份额	1,044,061,384.57	1,149,366,790.17
减:本报告期基金总赎回份额	447,196,689.26	593,823,424.50
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	967,813,047.19	685,545,512.06

## § 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、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2010年1月16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。

(2) 2010年5月13日，本基金管理人发布关于总经理任职的公告，经本公司董事会会议审议通过，聘任李勍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。

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：

(1) 2011年2月9日，本基金托管人发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

(2) 2011年1月31日，本基金托管人发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

### 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

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为人民币 50,900.00 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

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	
齐鲁证券有限公司	1	108,939,197.03	33.53%	88,513.66	32.75%	-
中信证券股份有限公司	1	67,233,240.77	20.69%	57,148.31	21.14%	-
华安证券有限责任公司	1	34,829,349.90	10.72%	29,604.63	10.95%	-
湘财证券有限责任公司	1	25,567,780.67	7.87%	20,773.80	7.69%	-
德邦证券有限责任公司	1	22,197,332.77	6.83%	18,868.29	6.98%	-
中国银河证券股份有限公司	1	22,130,797.12	6.81%	18,810.99	6.96%	-
中山证券有限责任公司	1	17,623,256.37	5.42%	14,319.05	5.30%	-
招商证券股份有限公司	1	15,346,420.24	4.72%	13,044.30	4.83%	-
财富证券有限责任公司	1	3,551,231.88	1.09%	3,018.39	1.12%	-
长江证券股份有限公司	1	3,213,713.00	0.99%	2,731.63	1.01%	-
申银万国证券股份有限公司	1	2,968,467.40	0.91%	2,411.88	0.89%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	1,212,513.48	0.37%	985.17	0.36%	-
宏源证券股份有限公司	1	96,132.00	0.03%	78.11	0.03%	-

海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	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 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
齐鲁证券有限公司	278,870,583.56	15.03%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	353,844,776.98	19.07%	745,100,000.00	8.69%	-	-
华安证券有限责任公司	509,570,845.37	27.45%	3,037,900,000.00	35.42%	-	-
湘财证券有限责任公司	88,102,990.24	4.75%	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	16,708,643.76	0.90%	201,600,000.00	2.35%	-	-
中国银河证券股份有限公司	208,766,723.15	11.25%	1,367,900,000.00	15.95%	-	-
中山证券有限责任公司	16,515,908.19	0.89%	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	189,767,856.90	10.23%	280,000,000.00	3.26%	-	-
财富证券有限责任公司	36,545,624.96	1.97%	110,000,000.00	1.28%	-	-
长江证券股份有限公司	151,422,520.74	8.16%	2,451,500,000.00	28.59%	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	46,037.09	0.00%	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	5,343,178.92	0.29%	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1,080.96	0.00%	220,000,000.00	2.57%	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	162,000,000.00	1.89%	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
万联证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国盛证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金成立后与华安宏利股票型证券投资基金、华安核心优选股票型证券投资基金共用交易单元。

2、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

新增交易单元：

- (1) 新增华安证券有限责任公司上海交易单元 1 个；
- (2) 新增万联证券有限责任公司上海交易单元 1 个；
- (3) 新增国盛证券有限责任公司上海交易单元 1 个。

退租交易单元：无。

3、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。

3、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《证券交易单元使用协议》，并通知基金托管人。

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

(1) 2010 年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

(2) 2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

(3) 2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

(4) 2010 年 7 月 1 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

(5) 2010 年 9 月 15 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

(6) 2010 年 11 月 2 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

华安基金管理有限公司

2011 年 3 月 26 日