

华安策略优选股票型证券投资基金 2009 年半年度报告

2009 年 6 月 30 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：2009 年 8 月 28 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。本半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 2009 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	4
2.2	基金产品说明	4
2.3	基金管理人和基金托管人	4
2.4	信息披露方式	5
2.5	其他相关资料	5
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4	报表附注	15
§ 7	投资组合报告	29
7.1	期末基金资产组合情况	29
7.2	期末按行业分类的股票投资组合	30
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	31
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	32
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	34
7.6	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	34
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	34
7.8	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	34
7.9	投资组合报告附注	34
§ 8	基金份额持有人信息	35
§ 9	开放式基金份额变动	35
§ 10	重大事件揭示	36
§ 11	备查文件目录	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安策略优选股票型证券投资基金	
基金简称	华安策略优选股票	
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	
报告期末基金份额总额	19,058,546,639.15 份	

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	<p>① 资产配置策略</p> <p>本基金将通过宏观经济、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。</p> <p>② 股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>③ 债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>④ 权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略</p>
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	021-68888917
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-50099	95559
传真		021-68863414	021-58408842
注册地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		俞妙根	胡怀邦

2.4、信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的 管理人互联网地址	http://www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2.5 其他相关资料

项目	登记注册机构
名称	华安基金管理有限公司
办公地址:	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2009 年 1 月 1 日—2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-470,139,753.98
本期利润	4,762,276,589.00
加权平均基金份额本期利润	0.2478
本期加权平均净值利润率	40.69%
本期基金份额净值增长率	50.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日—2009 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-4,883,450,039.23
期末可供分配基金份额利润	-0.2562
期末基金资产净值	14,163,155,215.85
期末基金份额净值	0.7431

3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日—2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-16.56%

提示：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）。

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	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
过去一个月	12.45%	1.09%	9.92%	0.95%	2.53%	0.14%
过去三个月	23.34%	1.33%	17.32%	1.22%	6.02%	0.11%
过去六个月	50.09%	1.50%	43.92%	1.55%	6.17%	-0.05%
过去一年	12.28%	1.75%	11.23%	2.03%	1.05%	-0.28%
自基金转型起至今	-16.56%	1.83%	-17.84%	2.06%	1.28%	-0.23%

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 2009 年 6 月 30 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 89.26%，债券的投资比例为基金资产净值的 3.29%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 9.89%。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



注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，根据《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》规定，本基金已自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十一部分（二）投资范围、（五）投资限制的有关规定。

§ 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上海沸点投资发展有限公司。

截至 2009 年 6 月 30 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，华安创新股票、华安中国 A 股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证 180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安国际配置(QDII)等 12 只开放式基金，管理资产规模达到 790.62 亿人民币、0.972 亿美元。

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	2008-2-13	-	8年	经济学硕士，持有基金从业资格证书，8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公司，曾任研究发展部高级研究员，2008年2月起担任本基金的基金经理。
邓跃辉	本基金的基金经理	2008-2-13	-	6年	经济学硕士，CFA，CPA，6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月起担任本基金的基金经理，2008年4月起同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。

注：1. 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。

2. 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《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端基金间公平交易管理办法-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”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，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《交易端基金间公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

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，华安优选和华安安顺封闭都是混合型股票基金。09 年上半年，华安优选股票净值增长率为 50.09%，华安安顺封闭的净值增长率为 48.32%，二基金的差异不大。

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

A 股市场上半年的持续走强主要来自于国内经济和流动性的双重持续超预期。短短半年时间，投资者已经从对国内经济可能存在二次探底的悲观预期发展到对 2010 年国内经济可能超预期的乐观预期。国内银行信贷也前所未有的半年发放了 7 万亿，每月都持续超预期。从 2008 年 11 月到 2009 年一季度推动 A 股反弹的动力主要是政策信心及充足流动性下的估值水平的提升，二季度以后以煤炭地产钢铁为龙头的上涨行情则更多反映的是经济复苏下的业绩预期。

本基金年初对市场的流动性动力估计不够，无论在仓位还是结构上都准备不足。二季度开始坚持积极的投资策略，一直保持较高的仓位水平，行业配置向金融地产煤炭三个行业集中，净值表现较一季度有改观。尤其是地产行业的配置比较成功。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年 A 股市场将呈现先扬后抑的两阶段走势。目前在宏观经济向好、流动性仍然充足的背景下，投资者的预期空前一致，A 股市场有可能进入加

速上涨阶段。这个阶段必然将伴随泡沫的形成，但是作为一个趋势投资为主的市场，我们目前无法预测这个过程将持续多久。A 股市场下半年的拐点可能在于宽松政策的转向，从经济学的逻辑上看政策的转向是必然的，否则对经济的中长期发展弊大于利。我们预计时间点可能在 9、10 月份国内经济明显好转前后。三季度本基金将保持谨慎心态，在市场上涨时逐步降低仓位，并增加前期弱势的中小股票和防御性行业的配置比例。

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、固定收益部负责人、金融工程部负责人、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：

姓名	职务	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公司，曾任基金安信的基金经理、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。
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，基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理，现任基金安顺、华安宏利的基金经理，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公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任研究发展部总经理。
黄勤	固定收益部负责人	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公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。
许之彦	金融工程部负责人	理学博士，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 股基金经理，金融工程部负责人。
朱永红	基金运营部总经理	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公司，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

本报告期由于基金投资当期亏损，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

2009 年上半年度，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

2009 年上半年度，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。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2009 年上半年度，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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年末 2008年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	1,028,614,787.04	208,047,204.24
结算备付金		136,362,087.64	61,806,568.08
存出保证金		4,076,596.37	1,973,012.57
交易性金融资产	6.4.6.2	13,108,295,122.89	9,340,838,429.59
其中：股票投资		12,642,498,122.89	7,011,857,429.59
基金投资		-	-
债券投资		465,797,000.00	2,328,981,000.00
资产支持证券投资		-	-

衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-
应收证券清算款		5,128,058.79	30,818,123.19
应收利息	6.4.6.5	11,261,396.22	50,969,159.16
应收股利		1,767,706.59	-
应收申购款		3,403,593.42	372,406.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		14,298,909,348.96	9,694,824,903.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年末 2008年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		90,527,917.78	23,393,618.53
应付赎回款		14,995,294.47	2,351,578.53
应付管理人报酬	6.4.9.2.1	16,452,146.05	12,653,947.20
应付托管费	6.4.9.2.2	2,742,024.33	2,108,991.20
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	9,400,141.88	5,650,491.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	1,636,608.60	1,494,577.61
负债合计		135,754,133.11	47,653,204.41
所有者权益:			
实收基金	6.4.6.9	7,514,216,519.25	7,682,380,354.31
未分配利润	6.4.6.10	6,648,938,696.60	1,964,791,344.55
所有者权益合计		14,163,155,215.85	9,647,171,698.86
负债和所有者权益总计		14,298,909,348.96	9,694,824,903.27

注：1、报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7431 元，基金份额总额 19,058,546,639.15 份。

后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

6.2 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009年1月1日至 2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年6月30日
一、收入		4,893,201,288.23	-7,665,186,468.60
1. 利息收入		30,928,687.14	44,677,111.05
其中：存款利息收入	6.4.6.11	3,929,541.94	14,122,331.25
债券利息收入		26,999,145.20	30,146,494.24
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	408,285.56
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-370,561,705.85	-3,182,592,999.94
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-456,442,822.30	-3,258,011,986.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	19,398,127.27	1,411,725.58
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	1,676,740.63
股利收益	6.4.6.15	66,482,989.18	72,330,519.86
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	5,232,416,342.98	-4,530,312,546.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	417,963.96	3,041,967.02
二、费用（以“-”号填列）		-130,924,699.23	-263,050,519.43
1、管理人报酬	6.4.9.2.1	-86,504,494.21	-134,026,585.56
2、托管费	6.4.9.2.2	-14,417,415.74	-22,337,764.28
3、销售服务费		-	-
4、交易费用	6.4.6.18	-29,764,532.63	-101,610,526.77
5、利息支出		-	-4,833,124.18
其中：卖出回购金融资产支出		-	-4,833,124.18
6、其他费用	6.4.6.19	-238,256.65	-242,518.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,762,276,589.00	-7,928,236,988.03
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损“-”号填列）		4,762,276,589.00	-7,928,236,988.03

注：后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

6.3 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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 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)	-	4,762,276,589.00	4,762,276,589.00
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)	-168,163,835.06	-78,129,236.95	-246,293,072.01
其中: 1、基金申购款	199,690,770.56	146,102,854.32	345,793,624.88
2、基金赎回款(以“-”号填列)	-367,854,605.62	-224,232,091.27	-592,086,696.89
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)	7,514,216,519.25	6,648,938,696.60	14,163,155,215.85
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30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)	8,785,356,163.71	14,593,162,792.03	23,378,518,955.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,928,236,988.03	-7,928,236,988.03
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)	-883,110,307.69	-1,302,367,355.64	-2,185,477,663.33
其中: 1、基金申购款	121,620,895.05	126,471,376.44	248,092,271.49
2、基金赎回款(以“-”号填列)	-1,004,731,202.74	-1,428,838,732.08	-2,433,569,934.82
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)	7,902,245,856.02	5,362,558,448.36	13,264,804,304.38

注: 后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人: 俞妙根 主管会计工作的负责人: 李炳旺 会计机构负责人: 朱永红

6.4 报表附注

6.4.1 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×80%+中信标普国债指数收益率×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 2009 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 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”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、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》和中国证监会允许的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 年上半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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)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。

(b)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。

(c)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。

(d)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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）
活期存款	1,028,614,787.04
定期存款	-
其他存款	-
合计	1,028,614,787.04

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	10,380,977,563.93	12,642,498,122.89	2,261,520,558.96	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	456,440,797.27	465,797,000.00	9,356,202.73
	合计	456,440,797.27	465,797,000.00	9,356,202.73
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	10,837,418,361.20	13,108,295,122.89	2,270,876,761.69	

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）
----	----------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注 (投资成本)
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
权证投资	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2009 年 6 月 30 日）买入返售金融资产余额为零。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2009 年 6 月 30 日）无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）
应收活期存款利息	166,984.37
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	58,995.84
应收债券利息	11,026,964.38
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	8,419.05
其他	32.58
合计	11,261,396.22

6.4.6.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	-

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）
交易所市场应付交易费用	9,395,391.88
银行间市场应付交易费用	4,750.00
合计	9,400,141.88

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 (2009 年 6 月 30 日)
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00
应付赎回费	30,499.73
预提信息披露费	228,765.71
预提审计费	79,343.16
其他	48,000.00
合计	1,636,608.60

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	19,485,080,811.69	7,682,380,354.31
本期申购	506,462,110.22	199,690,770.56
本期赎回	-932,996,282.76	-367,854,605.62
本期末	19,058,546,639.15	7,514,216,519.25

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,532,860,327.75	6,497,651,672.30	1,964,791,344.55
本期利润	-470,139,753.98	5,232,416,342.98	4,762,276,589.00
本期基金份额交易产生的变动数	119,550,042.50	-197,679,279.45	-78,129,236.95
其中：基金申购款	-132,953,587.74	279,056,442.06	146,102,854.32
基金赎回款	252,503,630.24	-476,735,721.51	-224,232,091.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,883,450,039.23	11,532,388,735.83	6,648,938,696.60

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2009年1月1日至2009年6月30日)
活期存款利息收入	1,439,063.25
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,480,200.06
其他	10,278.63
合计	3,929,541.94

6.4.6.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)
卖出股票成交总额	9,470,520,938.21
卖出股票成本总额	-9,926,963,760.51
买卖股票差价收入	-456,442,822.30

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)
卖出债券及债券到期兑付成交金额	2,055,398,430.67
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-1,972,249,152.73
应收利息总额	-63,751,150.67
债券投资收益	19,398,127.27

6.4.6.14 衍生工具收益

6.4.6.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)
卖出权证成交金额	-
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)
股票投资产生的股利收益	66,482,989.18
基金投资产生的股利收益	-
合计	66,482,989.18

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)
1. 交易性金融资产	5,232,416,342.98
——股票投资	5,272,763,110.25
——债券投资	-40,346,767.27
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	5,232,416,342.98

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2009年1月1日至2009年6月30日)
基金赎回费收入	412,955.11
上交所印花税返还收入	5,008.85
合计	417,963.96

注：基金赎回费收入包括赎回及转换基金补偿收入，本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2009年1月1日至2009年6月30日)
交易所市场交易费用	29,756,507.63
银行间市场交易费用	8,025.00
合计	29,764,532.63

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2009年1月1日至2009年6月30日)
信息披露费	148,765.71
审计费用	79,343.16
银行划款手续费	1,147.78
债券托管账户维护费	9,000.00
其他	-
合计	238,256.65

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

无。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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

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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	86,504,494.21	134,026,585.56
其中：当期已支付	70,052,348.16	116,525,093.16
当期末支付	16,452,146.05	17,501,492.40

注：支付基金管理人华安基金的管理费按前一日基金资产净值的 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 × 1.5% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
----	--	---

当期应支付的托管费	14,417,415.74	22,337,764.28
其中：当期已支付	11,675,391.41	19,420,848.87
当期末支付	2,742,024.33	2,916,915.41

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。

6.4.9.3 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 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
交通银行股份有限公司	-	99,807,769.86	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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
交通银行股份有限公司	198,898,228.09	-	-	-	-	-

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	35,272,088.13	24,303,410.95
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	5,159,376.31	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	40,431,464.44	24,303,410.95
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.21%	0.12%

注：基金管理人华安基金管理有限公司在本年度运用固有资金 2,800,000.00 元经代销机构购入本基金 5,159,376.31 份基金份额，申购费 16,699.80 元，申购费率 0.6%。

6.4.9.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2009 年 6 月 30 日）和上年度末（2008 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

6.4.9.5 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	1,028,614,787.04	1,439,063.25	1,806,869,235.04	6,654,732.65

注：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，按银行同业利率计息。于 2009 年 6 月 30 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（2008 年 6 月 30 日：同）。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间内（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配 合计	备注
-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

6.4.11 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

6.4.11.1.1 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
600169	太原重工	2008-12-31	预计 2009-12-29	非公开发 行	12.67	10.76	5,000,000	63,350,000.00	53,800,000.00
600169	太原重工	2009-5-25	预计 2009-12-29	非公开发 行送股转 增部分	-	10.76	3,000,000	-	32,280,000.00
000698	沈阳	2008-8-7	2009-8-12	非公开	12.42	7.37	3,000,000	37,260,000.00	22,110,000.00

	化工			发行					
000698	沈阳化工	2009-6-3	2009-8-12	非公开发行送股转增部分	-	7.37	900,000	-	6,633,000.00
600239	云南城投	2009-4-14	预计 2010-4-12	非公开发行	15.18	13.34	5,000,000	75,900,000.00	66,700,000.00
600239	云南城投	2009-6-16	预计 2010-4-12	非公开发行送股转增部分	-	13.34	2,500,000	-	33,350,000.00

注：本报告期内本基金未持有流通受限债券以及其它证券类别。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

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
600849	上海医药	2009-6-18	资产重组	12.18	未知	未知	4,000,648	21,916,207.83	48,727,892.64

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金期末无正回购余额，因此没有债券作为抵押。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及资产支持证券投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地

对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除 6.4.11 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，

可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险,其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控,并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息,因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 (2009年6月30日)	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计
资产					
银行存款	1,028,614,787.04	-	-	-	1,028,614,787.04
结算备付金	136,362,087.64	-	-	-	136,362,087.64
存出保证金	103,913.63	-	-	3,972,682.74	4,076,596.37
交易性金融资产	255,817,000.00	-	209,980,000.00	12,642,498,122.89	13,108,295,122.89
应收证券清算款	-	-	-	5,128,058.79	5,128,058.79
应收利息	-	-	-	11,261,396.22	11,261,396.22
应收股利	-	-	-	1,767,706.59	1,767,706.59
应收申购款	1,860,328.99	-	-	1,543,264.43	3,403,593.42
资产总计	1,422,758,117.30	-	209,980,000.00	12,666,171,231.66	14,298,909,348.96
负债					
应付证券清算款	-	-	-	90,527,917.78	90,527,917.78
应付赎回款	-	-	-	14,995,294.47	14,995,294.47
应付管理人报酬	-	-	-	16,452,146.05	16,452,146.05
应付托管费	-	-	-	2,742,024.33	2,742,024.33
应付交易费用	-	-	-	9,400,141.88	9,400,141.88
其他负债	-	-	-	1,636,608.60	1,636,608.60
负债总计	-	-	-	135,754,133.11	135,754,133.11
利率风险敞口	1,422,758,117.30	-	209,980,000.00	12,530,417,098.55	14,163,155,215.85
上年末 (2008年12月31)	6个月以内	6个月至1年	1至5年	不计息	合计

日)					
资产					
银行存款	208,047,204.24	-	-	-	208,047,204.24
结算备付金	61,806,568.08	-	-	-	61,806,568.08
存出保证金	101,282.05	-	-	1,871,730.52	1,973,012.57
交易性金融资产	726,770,000.00	1,174,531,000.00	427,680,000.00	7,011,857,429.59	9,340,838,429.59
应收证券清算款	-	-	-	30,818,123.19	30,818,123.19
应收利息	-	-	-	50,969,159.16	50,969,159.16
应收申购款	285,559.98	-	-	86,846.46	372,406.44
资产总计	997,010,614.35	1,174,531,000.00	427,680,000.00	7,095,603,288.92	9,694,824,903.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	23,393,618.53	23,393,618.53
应付赎回款	-	-	-	2,351,578.53	2,351,578.53
应付管理人报酬	-	-	-	12,653,947.20	12,653,947.20
应付托管费	-	-	-	2,108,991.20	2,108,991.20
应付交易费用	-	-	-	5,650,491.34	5,650,491.34
其他负债	-	-	-	1,494,577.61	1,494,577.61
负债总计	-	-	-	47,653,204.41	47,653,204.41
利率风险敞口	997,010,614.35	1,174,531,000.00	427,680,000.00	7,047,950,084.51	9,647,171,698.86

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末 (2009年6月30日)	上年度末 (2008年12月31日)
	市场利率下降 25 个基点	增加约 3.38	增加约 392
	市场利率上升 25 个基点	下降约 3.36	下降约 390

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境

的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合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%。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 6 月 30 日）		上年末（2008 年 12 月 31 日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	12,642,498,122.89	89.26	7,011,857,429.59	72.68
交易性金融资产-债券投资	465,797,000.00	3.29	2,328,981,000.00	24.14
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	13,108,295,122.89	92.55	9,340,838,429.59	96.82

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币亿元）	
		本期末 （2009 年 6 月 30 日）	上年度末 （2008 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 4.88	增加约 4.2
	业绩比较基准下降 5%	下降约 4.86	下降约 4.2

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	12,642,498,122.89	88.42
	其中：股票	12,642,498,122.89	88.42
2	固定收益投资	465,797,000.00	3.26
	其中：债券	465,797,000.00	3.26
	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	1,164,976,874.68	8.15
6	其他资产	25,637,351.39	0.18
7	合计	14,298,909,348.96	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产的净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	1,182,049,172.80	8.35
C	制造业	3,417,642,249.97	24.13
C0	食品、饮料	349,743,474.40	2.47
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	120,810,760.00	0.85
C4	石油、化学、塑胶、塑料	351,719,842.07	2.48
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	438,930,354.03	3.10
C7	机械、设备、仪表	1,599,878,219.19	11.30
C8	医药、生物制品	556,559,600.28	3.93
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	25,007,744.60	0.18
E	建筑业	766,708,867.89	5.41
F	交通运输、仓储业	183,960,000.00	1.30
G	信息技术业	363,006,632.23	2.56
H	批发和零售贸易	697,484,675.68	4.92
I	金融、保险业	4,023,626,813.38	28.41
J	房地产业	1,369,793,253.56	9.67
K	社会服务业	317,585,488.66	2.24
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	295,633,224.12	2.09
	合计	12,642,498,122.89	89.26

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	601318	中国平安	14,497,501	717,046,399.46	5.06
2	601166	兴业银行	16,974,135	629,910,149.85	4.45
3	601169	北京银行	34,000,000	552,840,000.00	3.90
4	600036	招商银行	20,999,917	470,608,139.97	3.32
5	000002	万科A	33,499,985	427,124,808.75	3.02
6	601390	中国中铁	61,945,235	420,608,145.65	2.97
7	002024	苏宁电器	25,000,000	401,750,000.00	2.84
8	600030	中信证券	12,000,000	339,120,000.00	2.39
9	002202	金风科技	11,000,000	331,320,000.00	2.34
10	601088	中国神华	11,002,821	329,094,376.11	2.32
11	601601	中国太保	13,987,404	313,038,101.52	2.21
12	600837	海通证券	18,000,000	296,100,000.00	2.09
13	600016	民生银行	37,000,000	293,040,000.00	2.07
14	601898	中煤能源	23,504,414	290,044,468.76	2.05
15	600123	兰花科创	8,000,000	282,160,000.00	1.99
16	600519	贵州茅台	1,847,105	273,390,011.05	1.93
17	600739	辽宁成大	8,241,989	272,974,675.68	1.93
18	601009	南京银行	15,031,852	270,423,017.48	1.91
19	600048	保利地产	9,370,509	261,343,496.01	1.85
20	000069	华侨城A	12,200,000	254,980,000.00	1.80
21	600276	恒瑞医药	6,982,784	243,768,989.44	1.72
22	600585	海螺水泥	5,596,943	235,855,178.02	1.67
23	000425	徐工科技	7,019,072	231,488,994.56	1.63
24	600325	华发股份	9,579,568	216,402,441.12	1.53
25	000402	金融街	15,268,849	210,099,362.24	1.48
26	601333	广深铁路	36,000,000	183,960,000.00	1.30
27	600395	盘江股份	6,042,063	163,800,327.93	1.16
28	600089	特变电工	9,000,000	162,360,000.00	1.15
29	600352	浙江龙盛	20,000,000	142,200,000.00	1.00
30	601939	建设银行	23,466,170	141,501,005.10	1.00
31	600487	亨通光电	6,600,000	138,996,000.00	0.98
32	600223	ST鲁置业	14,995,324	135,857,635.44	0.96
33	600266	北京城建	7,387,369	125,733,020.38	0.89
34	000718	苏宁环球	8,378,000	120,810,760.00	0.85
35	600415	小商品城	2,916,762	119,995,588.68	0.85
36	600690	青岛海尔	9,000,000	119,340,000.00	0.84
37	600970	中材国际	4,020,113	117,467,701.86	0.83
38	000680	山推股份	10,014,120	110,255,461.20	0.78
39	601186	中国铁建	10,000,000	102,900,000.00	0.73
40	600050	中国联通	14,985,201	102,798,478.86	0.73
41	600067	冠城大通	7,896,759	102,578,899.41	0.72
42	601899	紫金矿业	10,000,000	102,000,000.00	0.72
43	002133	广宇集团	10,342,104	101,973,145.44	0.72

44	000513	丽珠集团	3,778,290	100,426,948.20	0.71
45	600239	云南城投	7,500,000	100,050,000.00	0.71
46	600169	太原重工	9,000,000	99,810,000.00	0.70
47	000063	中兴通讯	3,316,892	93,204,665.20	0.66
48	002038	双鹭药业	2,838,200	91,815,770.00	0.65
49	000651	格力电器	4,250,000	88,825,000.00	0.63
50	002233	塔牌集团	5,457,854	80,721,660.66	0.57
51	000157	中联重科	3,497,617	78,101,787.61	0.55
52	600195	中牧股份	3,715,497	76,353,463.35	0.54
53	000698	沈阳化工	9,853,496	72,620,265.52	0.51
54	000028	一致药业	3,800,000	71,820,000.00	0.51
55	002028	思源电气	3,176,887	69,669,131.91	0.49
56	600426	华鲁恒升	4,000,000	65,520,000.00	0.46
57	002152	广电运通	2,500,000	64,250,000.00	0.45
58	600582	天地科技	2,916,809	59,940,424.95	0.42
59	600586	金晶科技	4,000,000	53,880,000.00	0.38
60	000006	深振业A	4,000,000	52,800,000.00	0.37
61	600499	科达机电	4,500,000	50,895,000.00	0.36
62	600849	上海医药	4,000,648	48,727,892.64	0.34
63	000422	湖北宜化	3,479,439	39,839,576.55	0.28
64	600858	银座股份	2,000,000	39,780,000.00	0.28
65	002080	中材科技	1,452,930	39,664,989.00	0.28
66	600741	华域汽车	3,968,955	32,148,535.50	0.23
67	600309	烟台万华	2,000,000	31,540,000.00	0.22
68	000530	大冷股份	3,630,821	31,043,519.55	0.22
69	600054	黄山旅游	1,926,436	30,456,953.16	0.22
70	002132	恒星科技	3,361,555	28,808,526.35	0.20
71	600118	中国卫星	1,597,689	28,007,488.17	0.20
72	601918	国投新集	1,516,540	25,007,744.60	0.18
73	000061	农产品	2,000,000	22,760,000.00	0.16
74	000983	西山煤电	500,000	14,950,000.00	0.11

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600030	中信证券	564,613,441.75	5.85
2	601390	中国中铁	364,469,039.29	3.78
3	601088	中国神华	289,912,624.40	3.01
4	600837	海通证券	285,395,377.89	2.96
5	601898	中煤能源	262,277,523.18	2.72
6	000157	中联重科	256,537,767.54	2.66
7	000002	万科A	241,573,453.87	2.50
8	601601	中国太保	238,750,441.62	2.47

9	601333	广深铁路	215,667,145.57	2.24
10	600585	海螺水泥	214,127,534.44	2.22
11	600036	招商银行	208,000,647.77	2.16
12	600123	兰花科创	200,718,836.94	2.08
13	600016	民生银行	199,040,059.76	2.06
14	601009	南京银行	196,006,206.61	2.03
15	600325	华发股份	193,542,756.65	2.01
16	601169	北京银行	185,179,457.93	1.92
17	600739	辽宁成大	184,930,280.23	1.92
18	600635	大众公用	162,994,334.74	1.69
19	600352	浙江龙盛	161,131,966.24	1.67
20	600547	山东黄金	151,638,891.88	1.57

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600030	中信证券	480,638,435.08	4.98
2	000157	中联重科	359,287,176.64	3.72
3	601088	中国神华	293,085,265.65	3.04
4	601398	工商银行	281,399,950.84	2.92
5	000983	西山煤电	278,633,672.28	2.89
6	601628	中国人寿	247,918,869.74	2.57
7	600547	山东黄金	212,503,752.09	2.20
8	000002	万科A	208,355,813.34	2.16
9	600428	中远航运	208,038,425.69	2.16
10	601186	中国铁建	203,540,571.60	2.11
11	002024	苏宁电器	193,050,348.54	2.00
12	600036	招商银行	192,714,938.40	2.00
13	600635	大众公用	181,365,639.39	1.88
14	600426	华鲁恒升	177,348,277.31	1.84
15	600005	武钢股份	173,769,604.22	1.80
16	000933	神火股份	162,335,231.24	1.68
17	601699	潞安环能	158,732,326.21	1.65
18	601006	大秦铁路	137,256,922.09	1.42
19	000527	美的电器	136,838,215.46	1.42
20	000792	盐湖钾肥	135,903,256.45	1.41

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。

7.4.3 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：	10,284,841,343.56
卖出股票的收入（成交）总额：	9,470,520,938.21

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。

7.5 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	335,667,000.00	2.37
3	金融债券	130,130,000.00	0.92
	其中：政策性金融债	130,130,000.00	0.92
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	465,797,000.00	3.29

7.6 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	0801047	08 央票 47	2,000,000	209,980,000.00	1.48
2	040211	04 国开 11	1,300,000	130,130,000.00	0.92
3	0801112	08 央票 112	400,000	38,860,000.00	0.27
4	0801101	08 央票 101	400,000	38,636,000.00	0.27
5	0801095	08 央票 95	300,000	28,947,000.00	0.20

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	4,076,596.37
2	应收证券清算款	5,128,058.79
3	应收股利	1,767,706.59
4	应收利息	11,261,396.22
5	应收申购款	3,403,593.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,637,351.39

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
1,744,332	10,925.99	635,565,987.72	3.33%	18,422,980,651.43	96.67%

8.2 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	63,204.04	0.00%

§ 9 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
报告期期初基金份额总额	19,485,080,811.69

报告期期间基金总申购份额	506,462,110.22
报告期期间基金总赎回份额	-932,996,282.76
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	19,058,546,639.15

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 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). 2009 年 1 月 12 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，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(2). 2009 年 2 月 19 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，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

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：无。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
安信证券股份有限公司	1	5,423,563,944.48	27.56%	4,610,020.14	27.89%	
第一创业有限责任公司	1	152,072,346.27	0.77%	129,261.97	0.78%	
东方证券股份有限公司	2	1,797,471,073.14	9.13%	1,482,219.66	8.97%	

光大证券股份有限公司	1	946,705,411.67	4.81%	769,210.51	4.65%
国海证券有限责任公司	1	277,487,234.45	1.41%	235,863.19	1.43%
国金证券股份有限公司	1	3,329,420,467.02	16.92%	2,829,985.82	17.12%
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	1,470,749,469.37	7.47%	1,250,127.06	7.56%
联合证券有限责任公司	1	263,424,022.46	1.34%	214,034.65	1.30%
平安证券有限责任公司	1	179,365,907.62	0.91%	152,460.91	0.92%
齐鲁证券有限公司	1	287,693,979.43	1.46%	244,535.96	1.48%
瑞银证券有限责任公司	1	2,480,335,125.04	12.60%	2,108,277.85	12.76%
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	1	156,849,175.54	0.80%	133,319.54	0.81%
中信证券股份有限公司	1	1,484,057,077.29	7.54%	1,205,813.69	7.30%
中银国际有限责任公司	1	1,430,267,047.99	7.27%	1,162,101.47	7.03%

注：1、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

新增交易单元：

新增国海证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增西部证券股份有限公司上海交易单元1个；

退租交易单元：无。

2、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/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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于恢复旗下基金持有的“盐湖钾肥”股票进行市价估值的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-6
2	关于旗下基金投资太原重工（600169）非公开发行股票的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-6
3	关于参加深圳发展银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-9
4	关于新增东海证券为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-9
5	关于参加中国光大银行基金定投优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-20
6	关于基金电子直销推出中国农业银行金穗卡持有人定期定额申购业务及相关交易费率调整的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-21
7	关于新增江南证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-1-21
8	关于新增上海农村商业银行开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-2-5
9	关于提请投资者及时更新身份证明文件的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-2-14

10	关于参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-2-25
11	关于参加中国工商银行股份有限公司基智定投业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-2-26
12	关于新增恒泰证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-12
13	关于参加江海证券经纪有限责任公司网上申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-13
14	关于新增江海证券经纪有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-13
15	关于新增兴业银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-18
16	关于参加兴业银行股份有限公司电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-18
17	关于新增国盛证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-24
18	关于新增国金证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-26
19	关于在山西证券股份有限公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-26
20	关于开通电子直销平台后端定期定额投资业务及调低旗下开放式基金定期定额投资申购金额下限的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-31
21	关于参加中国工商银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-3-31
22	关于旗下基金投资云南城投(600239)非公开发行股票的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-4-16
23	关于新增天相投资顾问有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-5-7
24	关于电子直销平台开通“华安-建行 e 付通”基金电子交易业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-5-15
25	关于恢复旗下基金持有的“长江电力”股票进行市价估值的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-5-19
26	关于在中国银行开通基金转换业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-5-20

		站 www.huaan.com.cn 上披露	
27	关于新增爱建证券为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-6-2
28	关于新增临商银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-6-9
29	关于参加兴业银行基金定期定额投资优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-6-10
30	关于电子直销平台开通“定期不定额”基金电子交易业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-7-1
31	关于在中国邮政储蓄银行有限责任公司延长定期定额投资优惠时间的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-7-1
32	关于新增华夏银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-7-8
33	关于电子直销平台“华安—民生银基通”基金电子交易业务升级的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-7-20
34	关于参加华夏银行网上银行基金申购费率优惠活动和定期定额申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-7-21
35	关于参加中信银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-8-3
36	关于在渤海证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-8-6
37	关于在华夏银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-8-6
38	关于新增中国国际金融有限公司为开放式基金代销机构的公告	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露	2009-8-22

前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

- 1、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安策略优选股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；
- 9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：
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>。
查阅方式：投资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。

华安基金管理有限公司
2009 年 8 月 28 日