

华安强化收益债券型证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 8 月 25 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 4 月 13 日(基金合同生效日)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	5
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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	38
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	38
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	38
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	38
7.9 投资组合报告附注	39
§ 8 基金份额持有人信息	40
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
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	40
§ 9 开放式基金份额变动	40
§ 10 重大事件揭示	41
10.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
10.4 基金投资策略的改变.....	41
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	41
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.....	41
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	41
10.8 其他重大事件	44
§ 11 备查文件目录	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安强化收益债券型证券投资基金	
基金简称	华安强化收益债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 4 月 13 日	
报告期末基金份额总额	1, 757, 703, 391. 44 份	
下属两级基金的基金简称	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
下属两级基金的交易代码	040012	040013
报告期末下属两级基金的份额总额	767, 789, 791. 64 份	989, 913, 599. 80 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过增强信用产品的投资，以获取资产的长期增值。
投资策略	本基金将以宏观经济、市场利率研究主导固定收益资产投资，在控制风险和保持资产流动性的前提下，获取债券市场平均收益；同时在严格的信用评估和利差分析基础上，通过投资于有一定信用风险、具有较高收益率的信用类债券，以获取超越市场平均水平的收益；此外，本基金还将通过积极的新股申购和个股精选来增强基金资产的收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中低风险和中低收益品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	蒋松云
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-50099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		俞妙根	姜建清

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基金管理人互联网网址	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	注册登记机构
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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2009 年 4 月 13 日—2009 年 6 月 30 日)	
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
本期已实现收益	5,965,028.38	6,058,805.61
本期利润	8,120,391.15	8,939,395.54

加权平均基金份额本期利润	0.0072	0.0072
本期加权平均净值利润率	0.72%	0.72%
本期基金份额净值增长率	0.90%	0.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年4月13日—2009年6月30日)	
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
期末可供分配利润	5,111,090.19	5,494,195.47
期末可供分配基金份额利润	0.0067	0.0056
期末基金资产净值	774,616,819.61	997,618,681.85
期末基金份额净值	1.009	1.008
3.1.3 累计期末指标	报告期(2009年4月13日—2009年6月30日)	
	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
基金份额累计净值增长率	0.90%	0.80%

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：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 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不足半年。

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

华安强化收益债券 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
过去一个月	0.60%	0.12%	0.50%	0.14%	0.10%	-0.02%
自基金合同生效起至今	0.90%	0.08%	1.41%	0.17%	-0.51%	-0.09%

华安强化收益债券 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
过去一个月	0.50%	0.12%	0.50%	0.14%	0.00%	-0.02%

自基金合同 生效起至今	0.80%	0.08%	1.41%	0.17%	-0.61%	-0.09%
----------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------

注：本基金的业绩比较基准为中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%

根据本基金合同的有关规定，本基金为债券型基金，投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法发行、上市的国债、金融债、央行票据、企业（公司）债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券、次级债、债券回购等，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。

基金的投资组合比例为：债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。其中，除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值的 30%；持有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%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具，投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。

本基金于 2009 年 4 月 13 日成立，目前处于建仓期内。截至 2009 年 6 月 30 日，本基金的债券类资产的投资比例为基金资产净值的 88.45%，除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产占基金资产净值的比例为基金资产净值的 56.95%，投资于股票等权益类资产的比例为基金资产净值的 11.44%。

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

华安强化收益债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日）

华安强化收益债券 A



注：1. 本基金于 2009 年 4 月 13 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。
 2. 根据《华安强债收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓截止日为 2009 年 10 月 13 日。截至本报告期期末，本基金的投资组合比例已符合基金合同第十一部分 基金的投资中投资范围、投资限制的有关约定。

华安强化收益债券 B



注：1. 本基金于 2009 年 4 月 13 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。
 2. 根据《华安强债收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金建仓截止日为 2009 年 10 月 13 日。截至本报告期期末，本基金的投资组合比例已符合基金

合同第十一部分 基金的投资中投资范围、投资限制的有关约定。

§ 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		
黄勤	本基金的基金经理,固定收益部负责人	2009-4-13	-	8年	经济学硕士，持有基金从业人员资格证书，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，2007年5月起担任华安现金富利基金的基金经理，2009年4月13日起同时担任本基金的基金经理。

周丽萍	本基金的基金经理	2009-4-13	-	8年	硕士，特许金融分析师（CFA）、金融风险管理师（FRM），8年证券、基金从业经历。曾在世纪证券资产管理部、研究所从事固定收益投资和研究工作。2005年8月加入华安基金管理公司，曾任研究发展部研究员，固定收益部债券投资经理，2009年4月13日起担任本基金的基金经理。
-----	----------	-----------	---	----	---

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《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安强化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，不存在违法违规或未履行合同承诺的情形。

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

本基金为强化债券型基金，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

2009 年的上半年，中国经济迎来了停滞之后的恢复，尽管一季度经济同比降幅仍有扩大，但是在强有力的经济政策刺激下，二季度复苏的势头较为明确。债券市场出现了较大幅度的下跌，其中信用产品由于经济企稳所带来的信用利差缩小而表现略好。股票市场在内外环境向好预期不断提升和流动性宽裕的推动下，出现了强劲反弹。

强债基金 4 月 13 日成立，截止 6 月 30 日 A 类和 B 类基金净值分别为 1.009 和 1.008。由于尚在建仓期，基金的操作相对保守，基金规模逐步稳定之后，我们在信用类资产和权益类资产上加大了配置力度，并根据市场变化波段操作。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国一季度 GDP 下降 6.4%，二季度初步预计下降 1.0%，较一季度的下滑速度明显放缓，企业削减库存是美国 GDP 下滑的重要原因，这一趋势在二季度有所缓解。美国新房和现房销售量企稳回升，房价也出现环比明显回升，预测美国未来两个季度 GDP 环比呈回升趋势，第三季度环比转正值。不过，消费者支出表现疲软，同时美国失业率高企，总需求仍然受到抑制。美国经济整体而言呈弱势复苏。

中国 2 季度超预期的经济数据显示经济已进入复苏阶段。由于外部环境会逐步好转，出口的同比降幅可能会逐步缩小，环比改善的空间很大。企业利润增速在未来会大幅回升，尤其是外弱内强的态势会使成本下降的好处得到反映。CPI 在 7 月份触底，PPI 则会在 8 月份触底。大宗商品价格等传导导致的通胀潜在风险或许在中期才能显现。随着中国的贸易顺差的增加，贸易顺差和 FDI 导致的流动性泛滥会有所增强。央行货币政策是下一步国内流性能否维持的重要因素。尽管政策层面表明了对股票市场的呵护态度，但是央行利用市场化手段来逐步收紧流动性，意味着可能会抬高货币市场利率水平抑制银行放贷，进而影响债券市场和股票市场，这一进程值得重点关注和跟踪。

判断未来债市仍然面临一定的压力，趋势性的投资机会尚未显现。信用产品由于流动性差且未来供给压力大，收益率将逐步上行，不过由于贷款利率的压制

作用，新的投资价值也在逐步孕育。

经济的持续增长、企业盈利的改善、充裕的流动性让我们对股票市场和可转债市场的行情谨慎乐观。

华安强化收益债券基金下一阶段的投资将以流动性良好的金融债和央行票据为主，同时择机配置收益率较高且信用状况良好的信用债。在可转债和股票投资方面，本基金将保持一定的仓位并进行波段操作。未来我们将在充分研究国债、金融债、信用类债券、可转换债券、新股申购等各类品种的基础上，稳健投资，充分把握提高收益的机会，努力为基金持有人争取更好的投资回报。

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：

本基金的基金经理作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

本报告期暂不进行收益分配。

§ 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，本基金托管人在对华安强化收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年上半年，华安强化收益债券型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安强化收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安强化收益债券型证券投资基金 2009 年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：华安强化收益债券型证券投资基金

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
资产：		
银行存款	6.4.7.1	50,024,203.45

结算备付金		5,276,305.38
存出保证金		
交易性金融资产	6.4.7.2	1,770,294,696.39
其中：股票投资		202,734,443.64
基金投资		
债券投资		1,567,560,252.75
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
应收证券清算款		51,756,984.42
应收利息	6.4.7.5	31,953,285.88
应收股利		
应收申购款		4,152,879.59
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		1,913,458,355.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		104,499,805.00
应付证券清算款		280,059.26
应付赎回款		34,142,784.71
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	1,156,083.67
应付托管费	6.4.10.2.2	330,309.59

应付销售服务费	6.4.10.2.3	377,084.59
应付交易费用	6.4.7.7	342,969.40
应交税费		1,448.40
应付利息		4,103.40
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	88,205.63
负债合计		141,222,853.65
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	1,757,703,391.44
未分配利润	6.4.7.10	14,532,110.02
所有者权益合计		1,772,235,501.46
负债和所有者权益总计		1,913,458,355.11

注：1.报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,757,703,391.44 份，其中华安强化收益债券 A 份额总额 767,789,791.64 份，华安强化收益债券 B 份额总额 989,913,599.80 份。华安强化收益债券 A 份额净值 1.009 元，华安强化收益债券 B 份额净值 1.008 元。

2.本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

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：华安强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日
一、收入		23,333,462.13
1. 利息收入		13,772,386.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	615,163.13

债券利息收入		12,107,888.78
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,049,334.15
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,247,016.38
其中：股票投资收益	6.4.7.12	7,324,565.65
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	-3,878,880.77
资产支持证券投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	801,331.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,035,952.70
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	278,106.99
二、费用（以“-”号填列）		-6,273,675.44
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	-3,533,028.64
2. 托管费	6.4.10.2.2	-1,009,436.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-1,063,396.02
4. 交易费用	6.4.7.18	-523,407.69
5. 利息支出		-55,346.84
其中：卖出回购金融资产支出		-55,346.84
6. 其他费用	6.4.7.19	-89,059.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		17,059,786.69
所得税费用（以“-”号填列）		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		17,059,786.69

注：本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。
 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：华安强化收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 4 月 13 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）	2,754,868,668.80	-	2,754,868,668.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	17,059,786.69	17,059,786.69
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）	-997,165,277.36	-2,527,676.67	-999,692,954.03
其中：1. 基金申购款	156,047,847.31	384,295.01	156,432,142.32
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1,153,213,124.67	-2,911,971.68	-1,156,125,096.35
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）	1,757,703,391.44	14,532,110.02	1,772,235,501.46

注：1. 本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2. 本表中“期初所有者权益(基金净值)”为基金合同生效日即 2009 年 4 月 13 日的数据。

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

华安强化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[2009]125 号《关于核准华安强化收益债券型证券投资基金募集的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安强化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 2,754,686,507.34 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(2009)第 68 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》于 2009 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,754,868,668.80 份基金份额,其中认购资金利息折合 182,161.46 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》和《华安强化收益债券

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《华安强化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。本基金对债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。其中，金融债、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券等除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值的 30%；持有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%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具，包括一级市场的新股申购或增发新股、因可转债转股或因权证行权所形成的股票、因持仓股票所派发或因参与可分离债券一级市场申购而产生的权证、二级市场股票等法律法规或监管机构允许投资的其他非固定收益类品种。本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。本基金的业绩比较基准为：中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%。

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》、《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2009 年 6 月 30 日止期间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 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2009 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2009 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2009 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(i) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(ii) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环

境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式

分配,但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见相关基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外,一般采用历史成本计量。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 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》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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	50,024,203.45

定期存款	-
其他存款	-
合计	50,024,203.45

6.4.7.2 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	196,660,155.63	202,734,443.64	6,074,288.01	
债券	交易所市场	261,219,158.10	260,208,252.75	-1,010,905.35
	银行间市场	1,307,379,429.96	1,307,352,000.00	-27,429.96
	合计	1,568,598,588.06	1,567,560,252.75	-1,038,335.31
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,765,258,743.69	1,770,294,696.39	5,035,952.70	

6.4.7.3 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
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

6.4.7.4 买入返售金融资产
6.4.7.4.1 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）无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 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。

6.4.7.5 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	17,379.10
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	1,700.58
应收债券利息	31,933,019.61
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	1,186.59
其他	
合计	31,953,285.88

6.4.7.6 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	-

6.4.7.7 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	319,709.40
银行间市场应付交易费用	23,260.00
合计	342,969.40

6.4.7.8 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	-
应付赎回费	13,110.60
预提审计费用	30,038.17
预提信息披露费	45,056.86
合计	88,205.63

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

华安强化收益债券 A

项目	本期(2009年4月13日至2009年6月30日)	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,433,106,240.88	1,433,106,240.88
本期申购	57,635,375.38	57,635,375.38
本期赎回	-722,951,824.62	-722,951,824.62
本期末	767,789,791.64	767,789,791.64

华安强化收益债券 B

项目	本期(2009年4月13日至2009年6月30日)	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	1,321,762,427.92	1,321,762,427.92
本期申购	98,412,471.93	98,412,471.93
本期赎回	-430,261,300.05	-430,261,300.05
本期末	989,913,599.80	989,913,599.80

注：1. 本基金自 2009 年 3 月 9 日至 2009 年 4 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 2,754,686,507.34 元。根据《华安强化收益债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 182,161.46 元，折算为 182,161.46 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《华安强化收益债券型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2009 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2009 年 5 月 11 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务和转换业务自 2009 年 5 月 12 日起开始办理。

3. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

华安强化收益债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	5,965,028.38	2,155,362.77	8,120,391.15
本期基金份额交易产生的变动数	-853,938.19	-439,424.99	-1,293,363.18
其中：基金申购款	105,270.04	57,232.30	162,502.34
基金赎回款	-959,208.23	-496,657.29	-1,455,865.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,111,090.19	1,715,937.78	6,827,027.97

华安强化收益债券 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,058,805.61	2,880,589.93	8,939,395.54
本期基金份额交易产生的变动数	-564,610.14	-669,703.35	-1,234,313.49
其中：基金申购款	122,584.79	99,207.88	221,792.67
基金赎回款	-687,194.93	-768,911.23	-1,456,106.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,494,195.47	2,210,886.58	7,705,082.05

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)
活期存款利息收入	563,745.06
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	49,439.52
其他	1,978.55
合计	615,163.13

6.4.7.12 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 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)
卖出股票成交总额	104,371,243.56

卖出股票成本总额	-97,046,677.91
买卖股票差价收入	7,324,565.65

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2009年4月13日至2009年6月30日)
卖出债券及债券到期兑付成交金额	2,125,471,382.49
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-2,087,555,686.80
应收利息总额	-41,794,576.46
债券投资收益	-3,878,880.77

6.4.7.14 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4月13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	-

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 (2009年4月13日至2009年6月30日)
股票投资产生的股利收益	801,331.50
基金投资产生的股利收益	-
合计	801,331.50

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2009年4月13日至2009年6月30日)
1. 交易性金融资产	5,035,952.70
——股票投资	6,074,288.01
——债券投资	-1,038,335.31
——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	5,035,952.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2009年4月13日至2009年6月30日)
基金赎回费收入	278,106.99
合计	278,106.99

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。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)
交易所市场交易费用	500,957.69
银行间市场交易费用	22,450.00
合计	523,407.69

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)
审计费用	30,038.17
信息披露费	45,056.86
银行汇划费用	13,064.49
其他	900.00
合计	89,059.52

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

无。

6.4.9.2 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
中国工商银行股份有限公司 (“工商银行”)	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内（2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日）没有通过关联

方交易单元进行的股票交易。

本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内（2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日）没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内（2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日）没有应支付关联方的佣金。

本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)
当期应支付的管理费	3,533,028.64
其中：当期已支付	2,376,944.97
期末未支付	1,156,083.67

注：1. 本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

2. 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 0.7% 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 × 0.7% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)
当期应支付的托管费	1,009,436.73
其中：当期已支付	679,127.14
期末未支付	330,309.59

注：1. 本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

无上期可比数据。

2. 支付基金托管人中国工商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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)			
	当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计	
华安收益 A			华安收益 B	
华安基金管理有限公司	88,559.93	46,538.69	-	135,098.62
中国工商银行股份有限公司	395,334.68	214,926.07	-	610,260.75
合计	483,894.61	261,464.76	-	745,359.37

注：1. 本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

2. A 类基金份额不收取销售服务费。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。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 B 类基金份额的基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

6.4.10.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 (2009 年 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)					
	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
中国工商银行股份有限公司	225,679,081.09	201,079,173.97	-	-	-	-

注：本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

注：本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.4.2 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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

注：本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.5 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 4 月 13 日至 2009 年 6 月 30 日)	
	期末存款余额	当期存款利息收入
中国工商银行股份有限公司	50,024,203.45	563,745.06

注：本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

注：本基金于 2009 年 4 月 13 日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上期可比数据。

6.4.11 利润分配情况

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	-	-	-	-	-	-	-

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金未持有期末暂时停牌的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,999,805.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
0801017	08 央行票据 17	2009-7-2	104.59	500,000	52,295,000.00
合计				500,000	52,295,000.00

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 54,500,000.00 元,于 2009 年 7 月 1 日/2009 年 7 月 3 日/2009 年 7 月 7 日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金,属于较高流动性、中低风险品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。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。

6.4.13.2 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中国工商银行，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%。

6.4.13.3 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银行间同业市场交易，其余亦在交易所上市，因此除 6.4.12 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同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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

2009年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	50,024,203.45	-	-	-	50,024,203.45
结算备付金	5,276,305.38	-	-	-	5,276,305.38
交易性金融资产	106,417,458.60	1,047,566,024.05	413,576,770.10	202,734,443.64	1,770,294,696.39
应收证券清算款	-	-	-	51,756,984.42	51,756,984.42
应收利息	-	-	-	31,953,285.88	31,953,285.88
应收申购款	3,045,962.98			1,106,916.61	4,152,879.59
资产总计	164,763,930.41	1,047,566,024.05	413,576,770.10	287,551,630.55	1,913,458,355.11
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	104,499,805.00	104,499,805.00
应付证券清算款	-	-	-	280,059.26	280,059.26
应付赎回款	-	-	-	34,142,784.71	34,142,784.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,156,083.67	1,156,083.67
应付托管费	-	-	-	330,309.59	330,309.59
应付销售服务费	-	-	-	377,084.59	377,084.59
应付交易费用	-	-	-	342,969.40	342,969.40
应交税费	-	-	-	1,448.40	1,448.40
应付利息	-	-	-	4,103.40	4,103.40
其他负债	-	-	-	88,205.63	88,205.63
负债总计	-	-	-	141,222,853.65	141,222,853.65
利率风险敞口	164,763,930.41	1,047,566,024.05	413,576,770.10	146,328,776.90	1,772,235,501.46

6.4.13.4.1.2 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）
	市场利率下降 25 个基点	增加约 1,061
	市场利率上升 25 个基点	下降约 1,048

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

本基金投资组合中债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。其中，除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值的 30%；持有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%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具，投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的 20%。

6.4.13.4.3.1 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）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	202,734,443.64	11.44
交易性金融资产-债券投资	1,567,560,252.75	88.45
衍生金融资产-权证投资	-	-

其他	-	-
合计	1,770,294,696.39	99.89

6.4.13.4.3.2 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）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 0.11
	业绩比较基准下降 5%	下降约 0.11

6.4.14 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	202,734,443.64	10.60
	其中：股票	202,734,443.64	10.60
2	固定收益投资	1,567,560,252.75	81.92
	其中：债券	1,567,560,252.75	81.92
	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	55,300,508.83	2.89
6	其他资产	87,863,149.89	4.59
7	合计	1,913,458,355.11	100.00

7.2 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	14,455,000.00	0.82
B	采掘业	-	-
C	制造业	21,053,271.20	1.19
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	21,053,271.20	1.19
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	22,284,000.00	1.26
G	信息技术业	22,110,000.00	1.25
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	40,587,172.44	2.29
J	房地产业	44,625,000.00	2.52
K	社会服务业	37,620,000.00	2.12
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	202,734,443.64	11.44

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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科 A	3,500,000	44,625,000.00	2.52
2	000069	华侨城 A	1,800,000	37,620,000.00	2.12
3	601318	中国平安	488,014	24,137,172.44	1.36

4	600087	长航油运	3,600,000	22,284,000.00	1.26
5	000839	中信国安	1,500,000	22,110,000.00	1.25
6	600837	海通证券	1,000,000	16,450,000.00	0.93
7	002069	獐子岛	700,000	14,455,000.00	0.82
8	000528	柳工	770,000	12,812,800.00	0.72
9	600320	振华重工	792,353	8,240,471.20	0.46

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	44,088,161.44	2.49
2	600030	中信证券	43,244,439.48	2.44
3	000069	华侨城A	33,870,403.00	1.91
4	600690	青岛海尔	25,244,166.00	1.42
5	600087	长航油运	23,610,866.11	1.33
6	000839	中信国安	22,655,609.60	1.28
7	601318	中国平安	22,145,544.31	1.25
8	600837	海通证券	16,460,000.00	0.93
9	000528	柳工	15,597,503.40	0.88
10	002069	獐子岛	15,061,408.22	0.85
11	600098	广州控股	13,182,069.03	0.74
12	000709	唐钢股份	10,905,000.00	0.62
13	600320	振华重工	7,641,662.95	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600030	中信证券	45,580,853.05	2.57
2	600690	青岛海尔	28,064,789.10	1.58
3	600098	广州控股	13,340,604.35	0.75
4	000709	唐钢股份	11,997,065.02	0.68
5	000528	柳工	5,387,932.04	0.30

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

买入股票成本（成交）总额	293,706,833.54
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	104,371,243.56
--------------	----------------

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	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	144,193,703.70	8.14
2	央行票据	414,125,000.00	23.37
3	金融债券	382,651,000.00	21.59
	其中：政策性金融债	382,651,000.00	21.59
4	企业债券	568,393,090.45	32.07
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	58,197,458.60	3.28
7	其他	-	-
8	合计	1,567,560,252.75	88.45

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	占基金资产净值比例（%）
1	0801017	08 央票 17	2,000,000	209,180,000.00	11.80
2	080213	08 国开 13	1,300,000	140,764,000.00	7.94
3	088039	08 兵器装备债	1,100,000	117,018,000.00	6.60
4	0801011	08 央票 11	1,000,000	104,470,000.00	5.89
5	080309	08 进出 09	1,000,000	101,590,000.00	5.73

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	51,756,984.42
3	应收股利	-
4	应收利息	31,953,285.88
5	应收申购款	4,152,879.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,863,149.89

7.9.4 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110002	南山转债	22,992,628.80	1.30
2	110003	新钢转债	12,627,316.10	0.71
3	110598	大荒转债	11,628,808.20	0.66
4	125960	锡业转债	9,744,405.50	0.55
5	125709	唐钢转债	1,204,300.00	0.07

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

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
华安强化收益债券 A	5,402	142,130.65	423,422,594.23	55.15%	344,367,197.41	44.85%
华安强化收益债券 B	9,778	101,238.86	96,876,686.46	9.79%	893,036,913.34	90.21%
合计	15,180	115,790.74	520,299,280.69	29.60%	1,237,404,110.75	70.40%

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	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	华安强化收益债券 A	77,307.58	0.01%
	华安强化收益债券 B	310,754.46	0.03%
	合计	388,062.04	0.02%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	华安强化收益债券 A	华安强化收益债券 B
基金合同生效日 (2009 年 4 月 13 日) 基金份额总额	1,433,106,240.88	1,321,762,427.92
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	57,635,375.38	98,412,471.93
基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	722,951,824.62	430,261,300.05
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	767,789,791.64	989,913,599.80

§ 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：
无。

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其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。

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	
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

上海证券有限 责任公司	1	132,072,397.02	34.53%	112,260.93	35.11%	-
兴业证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	1	143,965,579.32	37.64%	116,973.05	36.59%	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
联合证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券有限责任 公司	2	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	1	106,442,597.36	27.83%	90,475.42	28.30%	-
国都证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	1	-	-	-	-	-

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		备注
	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	
长城证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-
上海证券有限 责任公司	271,233,854.03	70.03%	11,630,500,000.00	98.40%	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	83,858,632.68	21.65%	-	-	-	-	-

中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
联合证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-
中国建银投资 证券有限责任 公司	-	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	32,226,346.18	8.32%	188,900,000.00	1.60%	-	-	-
国都证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	-	-	-	-	-	-	-

注：1、本基金成立后与华安中小盘成长股票型证券投资基金共用交易单元。

2、本报告期内，本基金和华安中小盘成长股票共同变更交易单元如下：

新增交易单元：

新增齐鲁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。

4、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	关于华安强化收益债券型证券投资基金增加代销机构的公告	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	2009-3-9
2	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
3	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
4	关于新增中信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	2009-3-17
5	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
6	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
7	经普华永道中天会计师事务所有限公司验资，本次募集的净认购金额为 2,754,686,507.34 元人民币，其中 A 类 1,433,048,092.27 元，B 类 1,321,638,415.07 元；认购资金在募集期间产生的银行利息共计 182,161.46 元人民币，其中 A 类 58,148.61 元，B 类 124,012.85 元。募集资金已于 2009 年 4 月 10 日划入本基金在基金托管人中国工商银行股份有限公司开立的基金托管专户。	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	2009-4-14

8	关于新增华安强化收益债券型证券投资基金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	2009-5-8
9	关于新增华安强化收益债券型证券投资基金参加交通银行基金定投优惠推广活动的公告	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	2009-5-8
10	关于新增华安强化收益债券型证券投资基金参加中国农业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	2009-5-8
11	关于华安强化收益债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资与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	2009-5-8
12	关于新增华安强化收益债券型证券投资基金(A类)参加中国建设银行网上银行、电话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	2009-5-12
13	关于华安强化收益债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资与基金转换业务的提示公告	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	2009-5-12
14	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
15	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
16	关于华安核心股票、华安强化收益债券在中国银行开通基金定期定额投资业务并参加网上银行基金申购费率优惠活动、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	2009-5-21
17	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
18	关于在光大银行开通华安强化收益债券型证券投资基金定期定额投资业务并参加网上银行、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	2009-6-2
19	关于新增东海证券为华安强化收益债券型证券投资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	2009-6-8
20	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
21	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
22	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

23	关于新增广东发展银行为华安强化收益债券型证券投资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	2009-7-3
24	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
25	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
26	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
27	关于在中国农业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	2009-7-23
28	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
29	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
30	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
31	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、《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安强化收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安强化收益债券型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安强化收益债券型证券投资基金设立的文件；
- 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