

华安策略优选股票型证券投资基金
2013 年半年度报告摘要
2013 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

报告送出日期：二〇一三年八月二十四日

§ 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 2013 年 8 月 16 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2013 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安策略优选股票	
基金主代码	040008	
交易代码	040008(前端)	041008(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007年8月2日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,027,199,052.93份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	以优选股票为主，配合多种投资策略，在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	① 资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，确定合适的资产配置比例。 ② 股票投资策略 本基金的股票投资策略将采用“自下而上”和“自上而下”相结合的方法，通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票。在构建投资组合时主要以“自下而上”的优选成长策略为主，辅以“自上而下”的主题优选策略、逆势操作策略，优选具有良好投资潜力的个股，力求基金资产的中长期稳定增值。 ③ 债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种，基金管理人通过对收益率、流动性、信用风

	险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。 ④ 权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略。
业绩比较基准	$80\% \times \text{中信标普300指数收益率} + 20\% \times \text{中信标普国债指数收益率}$
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	裴学敏
	联系电话	021-38969999	95559
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	peixm@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的 管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-495,680,255.17
本期利润	-351,472,285.80
加权平均基金份额本期利润	-0.0263
本期基金份额净值增长率	-4.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013 年 6 月 30 日)

期末可供分配基金份额利润	-0.2951
期末基金资产净值	7,287,336,683.02
期末基金份额净值	0.5594

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去 1 个月	-10.85%	1.49%	-10.09%	1.49%	-0.76%	0.00%
过去 3 个月	-4.70%	1.18%	-7.16%	1.14%	2.46%	0.04%
过去 6 个月	-4.73%	1.25%	-7.17%	1.17%	2.44%	0.08%
过去 1 年	-8.07%	1.15%	-5.25%	1.07%	-2.82%	0.08%
过去 3 年	-12.00%	1.22%	-6.36%	1.09%	-5.64%	0.13%
自基金合同生效起至今	-37.19%	1.51%	-32.14%	1.53%	-5.05%	-0.02%

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%

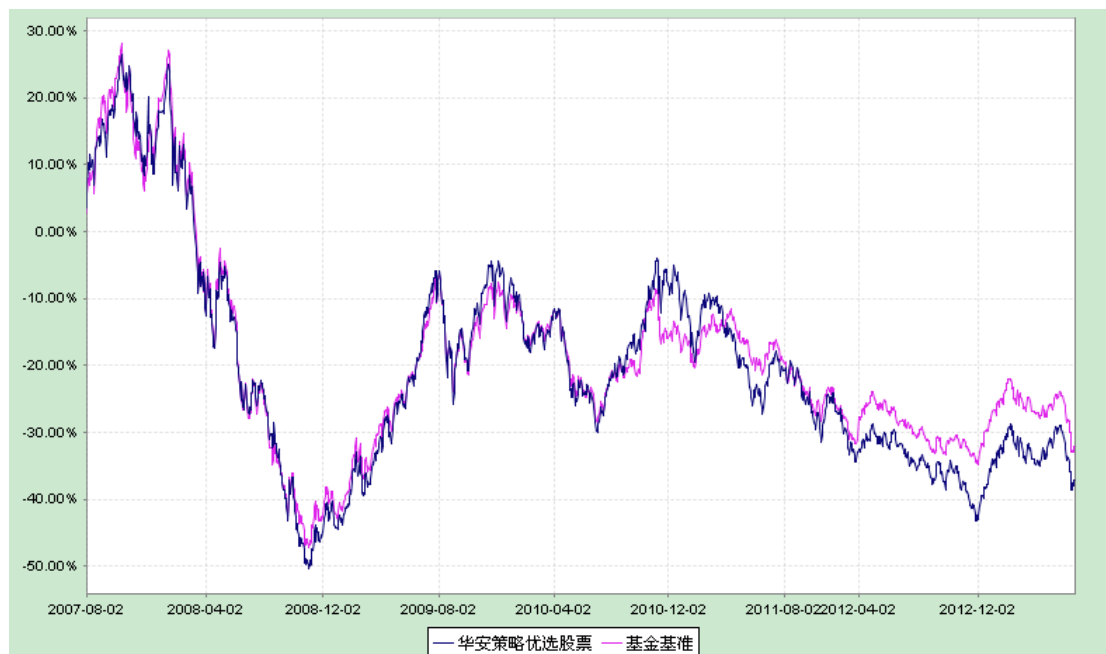
根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%；债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。

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

华安策略优选股票型证券投资基金

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

(2007 年 8 月 2 日至 2013 年 6 月 30 日)



注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型。

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 2013 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安顺封闭 1 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 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业

ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利、华安安信消费等 38 只开放式基金。管理资产规模达到 782.67 亿元人民币。

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		
殷鸣	本基金的基金经理	2010-09-20	2013-03-02	7 年	经济学硕士，拥有基金从业人员资格证书，7 年证券基金从业经历。曾在光大证券研究所担任研究员。2008 年 8 月加入华安基金管理有限公司后，曾任研究发展部研究员。2010 年 9 月至 2013 年 3 月担任本基金基金经理。
汪光成	本基金的基金经理、基金投资部副总监	2013-03-02	-	11 年	管理学博士，持有基金从业资格，11 年证券、基金行业从业经历，2002 年 1 月加入华安基金管理有限公司后，曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008 年 2 月至 2009 年 3 月担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金

					经理, 2009 年 3 月起担任华安创新证券投资基金的基金经理。2011 年 12 月起同时担任华安科技动力股票型证券投资基金的基金经理。2013 年 3 月起同时担任本基金的基金经理。2012 年 6 月起担任基金投资部副总监。
杨明	本基金的基金经理、投资研究部总监	2013-06-05	-	13 年	中央财经大学硕士研究生, 13 年银行、基金从业经历。曾在上海银行从事信贷员、交易员及风险管理。2004 年 10 月加入华安基金管理有限公司, 任研究发展部研究员。现任投资研究部总监。2013 年 6 月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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进

行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 2 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖单只股票的数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场在传统蓝筹板块带动下，延续了去年末的上涨，但很快随着经济增速持续回落以及金融监管的加强，上涨动能迅速转向以新兴电子消费、医疗、环保、软件等为代表的成长板块。经济数据持续走低和政策风格转变日益明确，推动了风格差异的不断扩大。

本基金在报告期内的主要工作分为两段。前一阶段主要以个股梳理为主，将业绩和流动性风险较大的个股进行了调整；后一阶段主要以配置调整为主，在考虑业绩持续性、估值合理性的同时，努力将配置向反映中国经济转型方向的行业或板块上转移。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2013 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.5594 元，本报告期份额净值增长率为-4.73%，同期业绩比较基准增长率为-7.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前蓝筹股的估值中已包含了经济下滑和货币收紧的预期。后者虽然随着货币市场利率回落而消退，但前者仍然形成反弹天花板，且利率的恢复更多代表货币政策中性立场而不是刺激意愿，决策层的思路是将稳增长、保就业与促转型相结合，周期政策和产业政策将会高度融合，宏观调控和制度变革将会高度融合。

因此，对周期性行业投资机会，应更多通过行业发生实质性变化的角度来分析，而不是从整体经济大周期转向来把握。有些细分强周期行业，在市场机制和政策推动双重作用下，其产能和库存调整已然比较充分、供求关系的趋势性改变已然出现，从而会带来盈利和股价的反应。类似的行业会随着投资低增长而不断出现，最终汇集成整个经济周期回升的大势。

对于房地产，考虑到需求持续较强释放后可能会出现一定的休整期，同时考虑政策不确定性，我们仍然较为谨慎，但预计行业发展的政策大环境将会逐渐改善，因此仍值得关注。

利率市场化的推进使得银行的一个利空因素有所释放，但银行短期内仍有利润增速回落、不良率走高、资本充足率下降的压力。

新兴行业估值已然较高，但我们意识到当前经济转型面临的极端压力，可能导致新兴行业出现极端估值，或高估值持续时间的极端性。因此，在关注行业供求短期波动在高估值背景下形成的回撤压力的同时，加强对相关公司业绩的分析，力求在把握转型对业绩促进作用的基础上，选择合适的行业和公司进行投资。

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当期损益的影响

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验的描述

(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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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：

尚志民,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，华安基金管理有限公司副总经理、首席投资官。

翁启森，工业工程学硕士，曾在台湾 JP 证券任金融产业分析师及投资经理，台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理，台湾中信证券投资总监助理，台湾保德信投信基金经理。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，负责 QDII 基金的投资管理工作。现任华安香港精选基金(QDII)、华安大中华升级基金(QDII)的基金经理、全球投资部总监、基金投资部总监。

杨明，投资研究部总监，研究生学历，曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任华安优选基金经理、投资研究部总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。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、华安信用四季红债券、华安

7 日鑫短期理财的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，指数投资部总监，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，华安中国 A 股增强指数、现任华安上证 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，华安深证 300 指数证券投资基金（LOF）的基金经理,指数投资部总监。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，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

本基金的基金经理杨明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

2013 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

2013 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

2013 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：2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	268,034,452.69	303,884,886.55
结算备付金	25,979,108.77	400,480,498.74
存出保证金	1,780,358.27	3,391,706.65
交易性金融资产	6,208,230,344.48	7,357,161,406.26
其中：股票投资	5,510,316,344.48	7,036,825,406.26
基金投资	-	-
债券投资	697,914,000.00	320,336,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	590,002,045.00	85,000,242.50
应收证券清算款	236,057,722.95	-
应收利息	11,268,779.43	5,479,785.52
应收股利	13,151,058.72	-
应收申购款	329,917.66	138,734.27
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	7,354,833,787.97	8,155,537,260.49
负债和所有者权益	本期末 2013 年 6 月 30 日	上年度末 2012 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	47,219,259.87	133,316,481.07
应付赎回款	2,125,594.87	5,058,325.82
应付管理人报酬	9,490,018.04	9,455,457.67
应付托管费	1,581,669.70	1,575,909.62
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,181,704.52	5,578,690.12
应交税费	325,000.00	325,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,573,857.95	2,025,576.36
负债合计	67,497,104.95	157,335,440.66

所有者权益：		
实收基金	5,136,233,364.02	5,370,167,914.57
未分配利润	2,151,103,319.00	2,628,033,905.26
所有者权益合计	7,287,336,683.02	7,998,201,819.83
负债和所有者权益总计	7,354,833,787.97	8,155,537,260.49

注：报告截止日 2013 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5594 元，基金份额总额 13,027,199,052.93。

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日
一、收入	-264,502,295.64	276,208,780.87
1.利息收入	15,322,213.06	9,973,422.41
其中：存款利息收入	3,947,403.09	2,450,428.51
债券利息收入	5,314,646.86	6,964,709.32
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	6,060,163.11	558,284.58
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-424,050,985.60	-105,276,501.09
其中：股票投资收益	-494,270,036.85	-181,749,321.27
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,393,518.07	-10,391,997.17
资产支持证券投资	-	-
收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	68,825,533.18	86,864,817.35
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	144,207,969.37	371,428,221.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	18,507.53	83,638.00
减：二、费用	86,969,990.16	109,752,303.18

1. 管理人报酬	59,729,639.57	64,609,792.70
2. 托管费	9,954,939.91	10,768,298.84
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	17,021,689.00	34,130,142.68
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	263,721.68	244,068.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-351,472,285.80	166,456,477.69
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-351,472,285.80	166,456,477.69

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：2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2013 年 1 月 1 日至 2013 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）	5,370,167,914.57	2,628,033,905.26	7,998,201,819.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-351,472,285.80	-351,472,285.80
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）	-233,934,550.55	-125,458,300.46	-359,392,851.01
其中：1.基金申购款	15,208,392.00	8,011,163.92	23,219,555.92
2.基金赎回款	-249,142,942.55	-133,469,464.38	-382,612,406.93
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）	5,136,233,364.02	2,151,103,319.00	7,287,336,683.02
项目	上年度可比期间 2012 年 1 月 1 日至 2012 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)	5,720,133,037.64	2,946,739,173.69	8,666,872,211.33
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	166,456,477.69	166,456,477.69
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)	-215,502,598.70	-122,075,997.15	-337,578,595.85
其中：1.基金申购款	17,927,619.29	9,583,138.70	27,510,757.99
2.基金赎回款	-233,430,217.99	-131,659,135.85	-365,089,353.84
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)	5,504,630,438.94	2,991,119,654.23	8,495,750,093.17

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李劼，主管会计工作负责人：章国富，会计机构负责人：陈林

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 2013 年 8 月 23 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”)、中国证监会公告

[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》和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 2013 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 2013 年 6 月 30 日的财务状况以及 2013 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 重要会计政策和会计估计

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。

6.4.5 差错更正的说明

无。

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》、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》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。2013 年 1 月 1 日以前，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。自 2013 年 1 月 1 日起，对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按

50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。

(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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）均无应支付关联方的佣金。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6 月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	59,729,639.57	64,609,792.70
其中：支付销售机构的客户维护费	14,091,314.36	15,091,197.96

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,954,939.91	10,768,298.84

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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.8.3 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 2013年1月1日至2013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	150,309,404.79	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	97,194,836.07	-	-	-	-	-

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
期初持有的基金份额	-	40,431,464.44
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份	-	40,431,464.44

额		
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2013 年 6 月 30 日）和上年度末（2012 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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	268,034,452.69	1,572,774.59	265,970,034.14	606,689.04

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2013 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(2012 年 6 月 30 日：同)。

6.4.8.6 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（2013 年 1 月 1 日至 2013 年 6 月 30 日）和上年度可比期间内（2012 年 1 月 1 日至 2012 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。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2013 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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

6.4.12.1.1 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
002037	久联发展	2012-07-05	2013-07-09	非公开发行	19.82	9.6	4,000,000	79,280,000.00	38,400,000.00	-
002037	久联发展	2012-07-05	2013-07-09	非公开发行送股	-	9.6	2,400,000	-	23,040,000.00	-

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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌 日期	复 牌 开 盘 单 价	数量 (股)	期末 成本总 额	期末 估值总 额	备注
600292	中电远达	2013-06-05	重大公告事项	19.37	2013-07-01	17.50	1,000,000	13,119,851.94	19,370,000.00	-

注：本基金截止至 2013 年 6 月 30 日止有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2013 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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	5,510,316,344.48	74.92
	其中：股票	5,510,316,344.48	74.92
2	固定收益投资	697,914,000.00	9.49
	其中：债券	697,914,000.00	9.49
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	590,002,045.00	8.02
	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	294,013,561.46	4.00
6	其他各项资产	262,587,837.03	3.57
7	合计	7,354,833,787.97	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	27,384,000.00	0.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,980,508,980.21	40.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,435,837.80	0.94
E	建筑业	150,307,998.59	2.06
F	批发和零售业	35,597,981.28	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	530,636,385.62	7.28
J	金融业	680,878,567.44	9.34
K	房地产业	748,792,173.99	10.28
L	租赁和商务服务业	92,867,631.24	1.27
M	科学研究和技术服务业	29,250,998.80	0.40
N	水利、环境和公共设施管理业	95,994,551.21	1.32
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	69,661,238.30	0.96
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	5,510,316,344.48	75.61
--	----	------------------	-------

7.3 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	000002	万 科 A	36,160,987	356,185,721.95	4.89
2	600741	华域汽车	28,148,000	219,554,400.00	3.01
3	600048	保利地产	22,062,151	218,635,916.41	3.00
4	600196	复星医药	19,186,028	201,069,573.44	2.76
5	601398	工商银行	49,978,890	200,915,137.80	2.76
6	600104	上汽集团	14,854,878	196,232,938.38	2.69
7	600016	民生银行	22,000,000	188,540,000.00	2.59
8	601169	北京银行	22,020,922	175,506,748.34	2.41
9	002250	联化科技	8,744,246	174,797,477.54	2.40
10	002368	太极股份	8,858,234	169,989,510.46	2.33

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读刊登于 www.huaan.com.cn 网站的半年度报告正文。

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	601398	工商银行	301,177,259.73	3.77
2	601318	中国平安	277,805,972.53	3.47
3	601166	兴业银行	258,907,060.02	3.24
4	600208	新湖中宝	210,096,245.93	2.63
5	600406	国电南瑞	186,975,052.26	2.34
6	000002	万 科 A	180,379,655.17	2.26
7	600048	保利地产	177,295,443.96	2.22
8	601169	北京银行	177,275,201.59	2.22
9	600000	浦发银行	118,049,104.08	1.48
10	600309	万华化学	116,540,899.85	1.46
11	002501	利源铝业	107,553,733.98	1.34
12	600795	国电电力	105,345,335.94	1.32
13	600252	中恒集团	99,821,678.61	1.25

14	300014	亿纬锂能	88,050,424.42	1.10
15	600050	中国联通	86,131,349.79	1.08
16	002415	海康威视	81,210,962.83	1.02
17	002241	歌尔声学	75,992,961.66	0.95
18	300058	蓝色光标	74,058,647.25	0.93
19	000726	鲁 泰 A	71,215,377.11	0.89
20	600837	海通证券	68,757,624.41	0.86

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	364,289,115.57	4.55
2	002029	七 匹 狼	328,168,806.94	4.10
3	601166	兴业银行	322,357,821.54	4.03
4	000550	江铃汽车	317,872,151.74	3.97
5	600000	浦发银行	309,665,332.97	3.87
6	002269	美邦服饰	287,456,794.65	3.59
7	000895	双汇发展	258,451,002.37	3.23
8	600570	恒生电子	257,542,312.71	3.22
9	600104	上汽集团	224,183,965.15	2.80
10	002001	新 和 成	193,193,431.33	2.42
11	600741	华域汽车	193,166,271.79	2.42
12	600016	民生银行	166,764,202.89	2.09
13	600406	国电南瑞	164,705,079.88	2.06
14	600519	贵州茅台	141,748,523.82	1.77
15	600496	精工钢构	130,866,941.42	1.64
16	600029	南方航空	122,829,811.44	1.54
17	600011	华能国际	119,227,092.63	1.49
18	600557	康缘药业	118,878,369.23	1.49
19	000157	中联重科	114,178,364.82	1.43
20	601566	九牧王	108,587,284.78	1.36

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,795,203,614.62
卖出股票的收入（成交）总额	5,972,048,052.39

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	248,875,000.00	3.42
2	央行票据	149,440,000.00	2.05
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	299,599,000.00	4.11
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	697,914,000.00	9.58

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	130002	13 付息国债 02	1,500,000	149,235,000.00	2.05
2	1001060	10 央行票据 60	1,000,000	99,890,000.00	1.37
3	120019	12 付息国债 19	1,000,000	99,640,000.00	1.37
4	071314001	13 银河 CP001	500,000	50,045,000.00	0.69
5	041361007	13 万向 CP001	500,000	49,990,000.00	0.69

7.7 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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1

本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.10.2

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。

7.10.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,780,358.27
2	应收证券清算款	236,057,722.95
3	应收股利	13,151,058.72
4	应收利息	11,268,779.43
5	应收申购款	329,917.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,587,837.03

7.10.4 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。

7.10.5 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不存在流通受限的情况。

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

	额	持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,302,109	10,004.69	99,938,813.07	0.77%	12,927,260,239.86	99.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	2,565.19	0.00%

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0；

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

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
本报告期期初基金份额总额	13,620,535,295.09
本报告期基金总申购份额	38,573,586.51
减：本报告期基金总赎回份额	631,909,828.67
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,027,199,052.93

10 重大事件揭示

10.1 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。

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：

2013 年 3 月 2 日，本基金管理人发布基金经理变更公告，聘任汪光成先生为本基金的基金经理，殷鸣先生不再管理本基金。

2013 年 6 月 5 日，本基金管理人发布基金经理变更公告，聘任杨明先生为

本基金的基金经理，与汪光成先生共同管理本基金。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼事项。报告期内无涉及本基金财产的诉讼事项。本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

无。

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

报告期内无管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
中信证券股份有限公司	2	2,343,331,315.79	21.76%	2,116,931.42	21.71%	-
广发证券股份有限公司	1	1,960,449,974.88	18.21%	1,784,792.31	18.30%	-

公司						
国金证券股份有限公司	1	1,416,352,250.25	13.15%	1,289,446.33	13.22%	-
光大证券股份有限公司	1	1,047,156,957.14	9.73%	939,559.90	9.63%	-
安信证券股份有限公司	1	1,001,691,158.40	9.30%	911,934.33	9.35%	-
中银国际证券有限责任公司	1	780,330,029.71	7.25%	695,422.96	7.13%	-
华创证券有限责任公司	1	538,068,373.17	5.00%	484,980.58	4.97%	-
中信建投证券有限责任公司	1	454,427,116.18	4.22%	413,709.33	4.24%	-
华宝证券有限责任公司	1	377,728,645.40	3.51%	343,883.21	3.53%	-
东兴证券股份有限公司	1	336,776,672.56	3.13%	306,601.55	3.14%	-
东方证券股份有限公司	2	209,379,857.65	1.94%	190,262.10	1.95%	-
瑞银证券有限责任公司	1	173,551,781.54	1.61%	158,001.54	1.62%	-
申银万国证券股份有限公司	1	128,007,534.34	1.19%	116,538.16	1.20%	-
浙商证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
江海证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-

平安证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国海证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中原证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信金通 证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
日信证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

（1）内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

（2）研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

（3）具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

（4）其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2. 券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有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》

牵头部门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相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况

无。

10.7.2 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
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	1,063,000,000.00	49.14%	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	1,100,000,000.00	50.86%	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券	28,754,723.80	100.00%	-	-	-	-

股份有限公司						
中银国际 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
东方证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
申银万国 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
江海证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰联合 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河 证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
国海证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中原证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信金通 证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
日信证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
中航证券 有限公司	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一三年八月二十四日