

华安策略优选股票型证券投资基金

2008 年年度报告

2008 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2009 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计,普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1	主要会计数据和财务指标	5
3.2	基金净值表现	6
3.3	自基金转型以来基金的利润分配情况	8
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
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	10
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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8	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	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6	审计报告	14
§ 7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	19
§ 8	投资组合报告	38
8.1	期末基金资产组合情况	38
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	39
8.3	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	39
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	41
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	42
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	43
8.7	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	43
8.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	43
8.9	投资组合报告附注	43
§ 9	基金份额持有人信息	44
§ 10	开放式基金份额变动	44
§ 11	重大事件揭示	44
§ 12	备查文件目录	53

§ 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	华安优选	
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	19,485,080,811.69 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	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	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网地址	http://www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2.5 其他相关资料

项目	会计师事务所	登记注册机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	华安基金管理有限公司
办公地址:	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位: 人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008 年	2007 年 8 月 2 日-2007 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-7,211,535,550.05	97,506,591.08
本期利润	-11,240,028,975.61	675,788,257.18
加权平均基金份额本期利润	-0.5571	0.0373
本期加权平均净值利润率	-78.37%	3.56%
本期基金份额净值增长率	-52.81%	17.81%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年 8 月 2 日-2007 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	-4,532,860,327.75	2,845,858,569.84
期末可供分配基金份额利润	-0.2326	0.1277
期末基金资产净值	9,647,171,698.86	23,378,518,955.74
期末基金份额净值	0.4951	1.0492

3.1.3 累计期末指标	2008 年	2007 年 8 月 2 日-2007 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-44.41%	17.81%

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）。

4、本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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
过去三个月	-12.04%	1.96%	-10.56%	2.40%	-1.48%	-0.44%
过去六个月	-25.19%	1.92%	-22.72%	2.36%	-2.47%	-0.44%
过去一年	-52.81%	2.06%	-52.20%	2.40%	-0.61%	-0.34%
自基金转型起至今	-44.41%	1.95%	-42.92%	2.19%	-1.49%	-0.24%

注：1、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 2008 年 12 月 31 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 72.68%，债券的投资比例为基金资产净值的 24.14%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 22.43%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

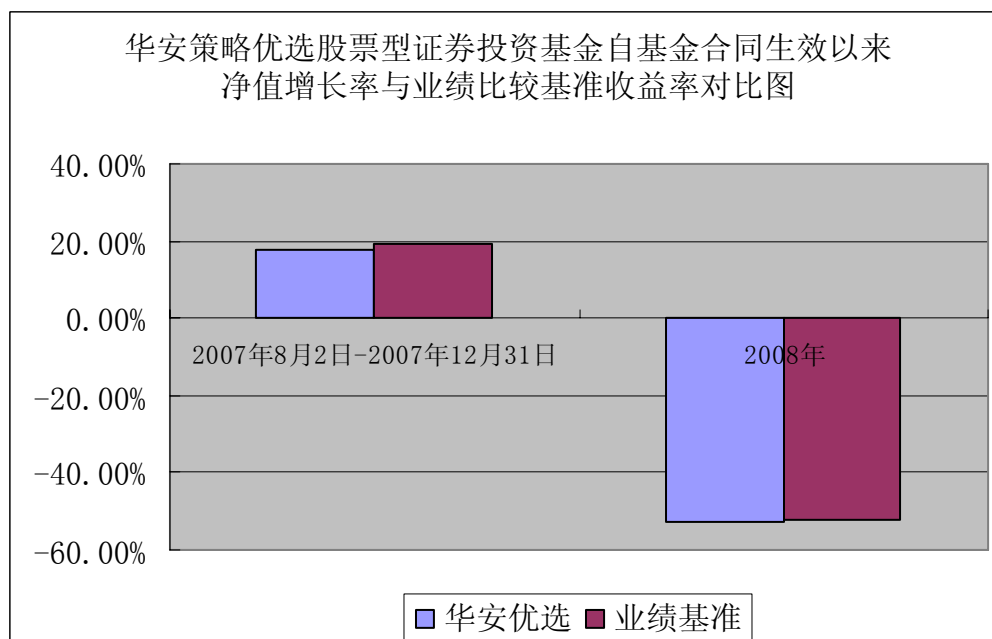
2、本基金于 2007 年 8 月 2 日从安久证券投资基金转型为华安策略优选股票型证券投资基金。

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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金转型以来基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008 年	—	—	—	—	—
2007 年 8 月 2 日 -2007 年 12 月 31 日	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至 2008 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺 2 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、上证 180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等 11 只开放式基金，管理资产规模达到 694.94 亿人民币、0.97 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		
鲍泓	本基金的基金经理	2007-8-2	2008-2-13	15 年	经济学硕士，15 年证券、基金从业经历。1994 年加入天同证券公司，先后担任投资银行总部项目经理、资产管理总部研究员、经理助理等工作。2000 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员，从事行业

					与策略研究等工作，2005 年 5 月-2007 年 8 月担任基金安久的基金经理。2007 年 8 月基金安久转型为开放式基金，更名本基金后，至 2008 年 2 月 13 日担任本基金的基金经理
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有限公司，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	毕业于上海财经大学，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有限公司，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

按照华安优选和基金安顺的基金合同，华安优选和基金安顺都是混合型基金。2008 年度，华安优选净值增长率为-52.81%，基金安顺的净值增长率为-38.22%，基金安顺业绩好于华安优选。差异的主要原因在于基金的股票仓位差异较大，2008 年内，华安优选基金的仓位一直保持在 70%上下，基金安顺的股票仓位期间变化比较大，最低时 40%，最高到达 76.82%，平均仓位 53%。

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

我们认为 2008 年 A 股市场的惨烈下跌主要是四个因素所致，首先是美国经济经历了 1929 年以来的最严重的衰退，并通过金融衍生产品和对外贸易影响到全球经济。其次，经过了前几年的低通胀高成长的黄金时期后，国内经济面临自然调整的需要，政府在经济增长和控制通胀之间的两难选择为国内经济的前景增加了不确定性。第三，A 股市场的高估值特征的脆弱性。最后是大小非改变了 A 股市场的成本概念和估值体系。从结构看，2008 年的 A 股市场几乎没有抗跌的行业，从地产金融等下游行业到机械装备等中游制造业，再到上游的煤炭石化等

行业，各行业根据在经济周期中的位置呈现渐次下跌的态势。

尽管 2008 年曾出现多次由于政策出台的反弹机会，但是由于投资者对经济前景的担忧而夭折。10 月份全球股市和大宗商品价格暴跌以及国内经济进入停滞期等多个超预期因素使投资者对国内经济的悲观预期达到顶峰。11 月初政府经济刺激计划适时出台，财政政策与货币政策双放松，投资者预期经济见底，A 股市场大幅反弹。

本基金在 2008 年比较成功之处在于仓位控制，一季度就降到了 75%左右，并在全年维持在 70%左右。行业配置方面在年初相对较好，针对原先组合偏大股票、偏中上游的特征，增持了消费股和中小市值股票，组合的结构更加均衡。不过下半年在行业轮动方面的把握不够，尤其中期时在航运煤炭化工钢铁等强周期性行业的配置较重，成为下半年拖累业绩表现的决定性因素。这也提示我们，作为目前机构投资者主导的市场，尤其是本基金的规模较大，更加需要注重宏观研究和行业配置的重要性。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对 2009 年中国经济相对乐观，尽管全球经济继续恶化导致出口大幅下降，但是国内政府的巨额财政支出的效应将逐渐在实体经济中显现。国内高财政收入、高居民储蓄的经济特征及中央集权的决策机制都给积极财政政策的实施提供了强有力的保证。我们认为 2009 年 A 股市场的演绎逻辑主要是业绩与估值的再平衡，尤其在上半年最为明显。一方面是上市公司的业绩加速下滑，另一方面是流动性逐步释放带来的估值水平系统性提升。在这两个因素出现明显强弱对比之前，市场将呈现震荡。我们预计这个过程将在 2009 年中期结束，届时估值水平提升到位，国内经济的进一步走势将决定市场未来发展。我们认为全球流动性释放是 2009 年最大的投资机会，周期性行业需要重点关注。比如煤炭行业，资源属性决定了供给方面的刚性，需求方主要是国内又提供了需求的保证，良好的供需状况决定了国内煤炭价格比较坚挺。再比如保险行业，寿险公司的结构性投资机会主要出现于升息周期前期和降息周期的最后阶段。届时保险公司的利差空间逐渐扩大，盈利能力好转，盈利水平提升，结构性投资机会显现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，强化员工的合规意识，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 积极配合公司管理层深化“主动合规”的管理理念，在完善公司合规政策的同时，颁布了公司《合规手册》，进一步明确了公司董事会、管理层、各部门的合规职责，细化了公司在业务运作、道德规范、反洗钱、利益冲突、客户信息保密、市场营销和客户投诉处理，投资和交易行为等环节的合规标准；

(2) 推行合规员制度，在各业务部门设立了部门合规员岗位，将合规控制、风险管理落实在业务第一线；

(3) 合规监察稽核部门经常性地组织员工进行法律法规的学习与培训，提高员工的合规意识；

(4) 组织投资、研究、交易等相关部门落实中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，开展基金交易价差分析，防范利益输送；

(5) 进一步完善投资交易系统控制功能，提高合规监察效率；

(6) 除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察外，还有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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：

根据中国证监会 [2008] 年 38 号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，经与托管银行协商，自 2008 年 9 月 16 日起，对本基金的估值原则作如下调整：

(1) 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，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

如有确凿证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实反映股票的公允价值，基金将与基金托管行协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。

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：

从 2008 年 9 月 16 日至 12 月 31 日，按照调整后的估值原则，本基金对持有的长期停牌的股票估值进行了调整，调整后对本基金的净值及本报告期损益产生的影响如下：

(1) 长江电力，影响本报告期损益 -35,486,864.00 元，影响基金净值比例 -0.37%；

(2) 盐湖钾肥，影响本报告期损益 -555,713.50 元，影响基金净值比例 -0.01%；

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：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任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，曾在鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部负责人，经济学硕士，12 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安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有限公司，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。

4.8 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

2008 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

2008 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。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2008 年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安策略优选股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2009)第 20110 号

华安策略优选股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安策略优选股票型证券投资基金(以下简称“华安策略优选基金”)的财务报表，包括 2008 年 12 月 31 日的资产负债表、2008 年度的利润

表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华安策略优选基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、 注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华安策略优选基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

中国·上海市

注册会计师
薛 竞
注册会计师
金 毅
2009 年 3 月 25 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安策略优选股票型证券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	208,047,204.24	1,265,538,985.34
结算备付金		61,806,568.08	3,366,988,561.88
存出保证金		1,973,012.57	6,344,785.63
交易性金融资产	7.4.7.2	9,340,838,429.59	18,898,844,479.33
其中：股票投资		7,011,857,429.59	17,961,613,055.33
基金投资		-	-
债券投资		2,328,981,000.00	937,231,424.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	578,286.63
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		30,818,123.19	26,173,981.95
应收利息	7.4.7.5	50,969,159.16	12,158,911.76
应收股利		-	-
应收申购款		372,406.44	349,017.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		9,694,824,903.27	23,576,977,010.19
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		23,393,618.53	62,284,387.53
应付赎回款		2,351,578.53	85,570,301.26
应付管理人报酬	7.4.10.2.1	12,653,947.20	28,953,381.39
应付托管费	7.4.10.2.2	2,108,991.20	4,825,563.57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,650,491.34	15,126,985.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,494,577.61	1,697,435.47
负债合计		47,653,204.41	198,458,054.45
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	7,682,380,354.31	8,785,356,163.71
未分配利润	7.4.7.10	1,964,791,344.55	14,593,162,792.03
所有者权益合计		9,647,171,698.86	23,378,518,955.74
负债和所有者权益总计		9,694,824,903.27	23,576,977,010.19

注：1、报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.4951 元，基金份额总额 19,485,080,811.69 份。

后附 7.4 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

7.2 利润表

会计主体：华安策略优选股票型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2008年1月1日至2008年 12月31日	上年度可比期间 2007年8月2日至2007年 12月31日
一、收入		-10,858,678,310.88	909,099,214.85
1. 利息收入		101,367,486.64	33,642,057.77
其中：存款利息收入	7.4.7.11	19,459,520.31	26,152,488.72
债券利息收入		80,568,800.29	7,462,293.35
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,339,166.04	27,275.70
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,935,001,802.57	293,988,143.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-7,036,088,940.05	284,383,188.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,172,971.36	868,060.00
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	1,676,740.63	7,200,755.97
股利收益	7.4.7.15	96,237,425.49	1,536,138.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-4,028,493,425.56	578,281,666.10
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,449,430.61	3,187,347.88
二、费用（以“-”号填列）		-381,350,664.73	-233,310,957.67
1、管理人报酬	7.4.10.2.1	-216,900,469.90	-119,030,238.20

2、托管费	7.4.10.2.2	-36,150,078.34	-19,838,373.04
3、销售服务费		-	-
4、交易费用	7.4.7.18	-121,868,036.58	-86,029,763.58
5、利息支出		-5,934,517.15	-8,205,994.06
其中：卖出回购金融资产支出		-5,934,517.15	-8,205,994.06
6、其他费用	7.4.7.19	-497,562.76	-206,588.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,240,028,975.61	675,788,257.18
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损“-”号填列）		-11,240,028,975.61	675,788,257.18

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

后附 7.4 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

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安策略优选股票型证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	-	-11,240,028,975.61	-11,240,028,975.61
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,102,975,809.40	-1,388,342,471.87	-2,491,318,281.27
其中：1、基金申购款	179,053,110.37	150,152,067.50	329,205,177.87
2、基金赎回款(以“-”号填列)	-1,282,028,919.77	-1,538,494,539.37	-2,820,523,459.14
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)	7,682,380,354.31	1,964,791,344.55	9,647,171,698.86
项目	上年度可比期间 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计

一、期初所有者权益(基金净值)	500,000,000.00	629,381,474.76	1,129,381,474.76
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	675,788,257.18	675,788,257.18
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)	8,285,356,163.71	13,287,993,060.09	21,573,349,223.80
其中：1、基金申购款	9,241,322,110.30	14,881,950,451.85	24,123,272,562.15
2、基金赎回款(以“-”号填列)	-955,965,946.59	-1,593,957,391.76	-2,549,923,338.35
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)	8,785,356,163.71	14,593,162,792.03	23,378,518,955.74

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

后附 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安策略优选股票型证券投资基金是根据原安久证券投资基金(以下简称“基金安久”)基金份额持有人大会 2007 年 6 月 29 日审议通过的《关于安久证券投资基金转型有关事项的议案》并经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]210 号《关于核准安久证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准，由原基金安久转型而来。原基金安久为契约型封闭式基金，于深圳证券交易所(以下简称“深交所”)交易上市，存续期限至 2007 年 8 月 30 日止。根据中国证监会批复及深交所深证复[2007]41 号《关于同意安久证券投资基金终止上市的批复》，原基金安久于 2007 年 8 月 1 日进行终止上市权利登记，自 2007 年 8 月 2 日起，原基金安久终止上市，原基金安久更名为华安策略优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，《安久证券投资基金基金合同》失效的同时《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

原基金安久于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,129,381,474.76 元，已于本基金的合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安久证券投资基金基金份额折算结果的公告》，本基金于 2007 年 8 月 20 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 1: 2.536335136，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 8 月 15 日开放集中申购，共募集人民币 9,853,567,332.90 元，其中用于折合基金份额的集中申购资金利息共计人民币 318,719.94 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2007)第 111 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 8 月 20 日基金份额拆分后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,853,567,332.90 份基金份额，其中集中申购资金利息折合 318,719.94 份基金份额，并于 2007 年 8 月 20 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%；债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具或金融衍生工具投资比例合计为 0-40%；现金以及到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率×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 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[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如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2008 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 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。比较财务报表的实际编制期间为 2007 年 8 月 2 日(基金合同生效日)至 2007 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记帐本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵消

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。

7.4.4.7 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。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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投资者参见基金合同中基金收益分配章节。

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。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和估计

1、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。

2、根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(i) 对于特殊事项停牌股票，2008 年 9 月 16 日之前按停牌前最后交易日的收盘价估值；根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自 2008 年 9 月 16 日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(ii) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37 号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本会计期间不存在会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自 2008 年 9 月 16 日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法，从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于 2008 年 9 月 16 日下调 81,410,305.20 元，相应调减本基金的净利润 81,410,305.20 元和基金资产净值 81,410,305.20 元。

7.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》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)基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2008 年 12 月 31 日）	上年度末（2007 年 12 月 31 日）
活期存款	208,047,204.24	1,265,538,985.34
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	208,047,204.24	1,265,538,985.34

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2008 年 12 月 31 日）		
		成本	公允价值	估值增值
股票		10,023,099,980.88	7,011,857,429.59	-3,011,242,551.29
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	2,279,278,030.00	2,328,981,000.00	49,702,970.00
	合计	2,279,278,030.00	2,328,981,000.00	49,702,970.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		12,302,378,010.88	9,340,838,429.59	-2,961,539,581.29
项目		上年度末（2007 年 12 月 31 日）		
		成本	公允价值	估值增值
股票		16,895,112,336.69	17,961,613,055.33	1,066,500,718.64
债券	交易所市场	100,797,663.57	100,839,424.00	41,760.43
	银行间市场	836,006,540.00	836,392,000.00	385,460.00
	合计	936,804,203.57	937,231,424.00	427,220.43
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		17,831,916,540.26	18,898,844,479.33	1,066,927,939.07

注：1、于 2008 年 12 月 31 日，股票投资余额中包括按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票 163,474,857.32 元（2007 年 12 月 31 日：无）。采用该估值技术的股票投资于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为 157,000,096.31 元（2007 会计期间：无）。

2、于 2008 年 12 月 31 日，债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动收益为 49,317,510.00 元（2007 会计期间：公允价值变动收益 385,460 元）。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末（2008 年 12 月 31 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	-	-	-	-
项目	上年度末（2007 年 12 月 31 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		578,286.63	-	552,381.43
权证投资		578,286.63	-	552,381.43
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	578,286.63	-	552,381.43

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2008 年 12 月 31 日）和上年度末（2007 年 12 月 31 日）买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2008 年 12 月 31 日）和上年度末（2007 年 12 月 31 日）均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末(2008 年 12 月 31 日)	上年度末 (2007 年 12 月 31 日)
应收活期存款利息	25,234.15	728,582.66
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	13,090.30	1,008,030.76
应收债券利息	50,930,531.49	10,421,946.39
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	257.62	306.35
其他	45.60	45.60
合计	50,969,159.16	12,158,911.76

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末(2008 年 12 月 31 日)	上年度末 (2007 年 12 月 31 日)
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末(2008 年 12 月 31 日)	上年度末 (2007 年 12 月 31 日)
交易所市场应付交易费用	5,644,216.34	15,116,846.67
银行间市场应付交易费用	6,275.00	10,138.56
合计	5,650,491.34	15,126,985.23

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末(2008 年 12 月 31 日)	上年度末 (2007 年 12 月 31 日)
应付券商交易单元保证金	1,250,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	4,577.61	317,435.47
预提信息披露费	80,000.00	240,000.00
预提审计费	160,000.00	140,000.00
合计	1,494,577.61	1,697,435.47

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	22,282,586,312.15	8,785,356,163.71
本期申购	454,136,025.25	179,053,110.37
本期赎回	-3,251,641,525.71	-1,282,028,919.77
本期末	19,485,080,811.69	7,682,380,354.31

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	2,845,858,569.84	11,747,304,222.19	14,593,162,792.03
本期利润	-7,211,535,550.05	-4,028,493,425.56	-11,240,028,975.61
本期基金份额交易产生的变动数	-167,183,347.54	-1,221,159,124.33	-1,388,342,471.87
其中：基金申购款	-1,770,227.81	151,922,295.31	150,152,067.50
基金赎回款	-165,413,119.73	-1,373,081,419.64	-1,538,494,539.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,532,860,327.75	6,497,651,672.30	1,964,791,344.55

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 (2008年1月1日至2008年 12月31日)	上年度可比期间 (2007年8月2日至2007年12月 31日)
活期存款利息收入	9,130,295.96	20,066,732.62
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	10,320,083.58	5,812,655.04
其他	9,140.77	273,101.06
合计	19,459,520.31	26,152,488.72

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
卖出股票成交总额	20,616,382,200.52	3,327,318,457.36
卖出股票成本总额	-27,652,471,140.57	-3,042,935,268.71
买卖股票差价收入	-7,036,088,940.05	284,383,188.65

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
卖出债券及债券到期兑 付成交金额	4,550,812,636.41	790,294,681.05
卖出债券及债券到期兑 付成本总额	-4,485,512,847.44	-772,105,720.00
应收利息总额	-62,126,817.61	-17,320,901.05
债券投资收益	3,172,971.36	868,060.00

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
卖出权证成交金额	4,726,713.61	298,587,460.78
卖出权证成本总额	-3,049,972.98	-291,386,704.81
买卖权证差价收入	1,676,740.63	7,200,755.97

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
----	---	--

股票投资产生的股利收益	96,237,425.49	1,536,138.48
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	96,237,425.49	1,536,138.48

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
1. 交易性金融资产	-4,028,467,520.36	587,675,497.68
——股票投资	-4,077,743,269.93	587,119,277.25
——债券投资	49,275,749.57	556,220.43
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-25,905.20	-9,393,831.58
——权证投资	-25,905.20	-9,393,831.58
3. 其他	-	-
合计	-4,028,493,425.56	578,281,666.10

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
基金赎回费收入	3,386,489.49	3,187,347.88
上交所印花税返还收入	62,941.12	-
合计	3,449,430.61	3,187,347.88

注：1. 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。

2. 本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
交易所市场交易费用	121,825,961.58	86,022,788.58

银行间市场交易费用	42,075.00	6,975.00
合计	121,868,036.58	86,029,763.58

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 (2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日)
信息披露费	300,000.00	99,943.98
审计费用	160,000.00	90,000.00
银行划款手续费	24,062.76	12,044.81
债券托管账户维护费	13,500.00	4,500.00
其他	-	100.00
合计	497,562.76	206,588.79

注：本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司 (“华安基金”)	基金管理人 基金注册登记机构 基金销售机构
交通银行股份有限公司 (“交通银行”)	基金托管人 基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日）均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	216,900,469.90	119,030,238.20
其中：当期已支付	204,246,522.70	90,076,856.81
当期未支付	12,653,947.20	28,953,381.39

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。

本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 8 月 2 日至 2008 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	36,150,078.34	19,838,373.04
其中：当期已支付	34,041,087.14	15,012,809.47
当期未支付	2,108,991.20	4,825,563.57

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。

本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.10.3 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

本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限公司	300,151,708.91	149,808,741.49	-	-	-	-
上年度可比期间 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	24,303,410.95	9,582,100.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	10,968,677.18	-
期间因拆分增加的份额	-	14,721,310.95
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	35,272,088.13	24,303,410.95
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.18%	0.11%

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 5,600,000.00 元经代销机构购入本基金 10,968,677.18 份基金份额，申购费 33,399.60 元，申购费率 0.6%。

7.4.10.4.2 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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2008 年 12 月 31 日）和上年度末（2007 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

7.4.10.5 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 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

交通银行股份有限公司	208,047,204.24	9,130,295.96	1,265,538,985.34	20,066,732.62
------------	----------------	--------------	------------------	---------------

注：1. 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 2008 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示（2007 年 12 月 31 日：同）。

2. 本基金于 2007 年 8 月 2 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

7.4.10.6 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（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间内（2007 年 8 月 2 日至 2007 年 12 月 31 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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	-	-	-	-	-	-	-

7.4.12 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
600169	太原重工	2008-12-31	预计 2009-12-29	非公开发行	12.67	12.68	5,000,000	63,350,000.00	63,400,000.00
000698	沈阳化工	2008-8-7	预计 2009-8-8	非公开发行	12.42	5.89	3,000,000	37,260,000.00	17,670,000.00

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。

7.4.12.2 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
600900	长江电力	2008-5-8	公告重大事项	7.35	未知	未知	5,069,552	88,512,334.19	37,261,207.20
000792	盐湖钾肥	2008-6-26	资产重组	56.78	2008-12-26	78.23	2,222,854	202,125,509.40	126,213,650.12

注：本基金期末持有青海盐湖钾肥股份有限公司股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流

通受限证券列示且于 2008 年 12 月 31 日采用指数收益法估值。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板，当日的收盘价为每股 37.99 元。

7.4.12.3 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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%。

7.4.13.3 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证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除 7.4.12 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 (2008 年 12 月 31 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	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
上年度末 (2007 年 12 月 31 日)	6 个月以内	6 个月至 1 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,265,538,985.34	-	-	-	1,265,538,985.34
结算备付金	3,366,988,561.88	-	-	-	3,366,988,561.88
存出保证金	101,282.05	-	-	6,243,503.58	6,344,785.63
交易性金融资产	647,542,000.00	288,420,000.00	1,269,424.00	17,961,613,055.33	18,898,844,479.33
衍生金融资产	-	-	-	578,286.63	578,286.63
应收证券清算款	-	-	-	26,173,981.95	26,173,981.95
应收利息	-	-	-	12,158,911.76	12,158,911.76
应收申购款	349,017.67	-	-	-	349,017.67
资产总计	5,280,519,846.94	288,420,000.00	1,269,424.00	18,006,767,739.25	23,576,977,010.19
负债					
应付证券清算款	-	-	-	62,284,387.53	62,284,387.53
应付赎回款	-	-	-	85,570,301.26	85,570,301.26
应付管理人报酬	-	-	-	28,953,381.39	28,953,381.39

应付托管费	-	-	-	4,825,563.57	4,825,563.57
应付交易费用	-	-	-	15,126,985.23	15,126,985.23
其他负债	-	-	-	1,697,435.47	1,697,435.47
负债总计	-	-	-	198,458,054.45	198,458,054.45
利率敏感度缺口	5,280,519,846.94	288,420,000.00	1,269,424.00	17,808,309,684.80	23,378,518,955.74

7.4.13.4.1.2 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 (2008 年 12 月 31 日)	上年度末 (2007 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 个基点	增加约 392	不重大
	市场利率上升 25 个基点	下降约 390	不重大

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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%。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末（2008 年 12 月 31 日）		上年度末（2007 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	7,011,857,429.59	72.68	17,961,613,055.33	76.83
衍生金融资产-权证投资	-	-	578,286.63	0.00
其他	-	-	-	-
合计	7,011,857,429.59	72.68	17,962,191,341.96	76.83

7.4.13.4.3.2 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 （2008 年 12 月 31 日）	上年度末 （2007 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	增加约 4.2	增加约 10.3
	业绩比较基准下降 5%	下降约 4.2	下降约 10.3

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	7,011,857,429.59	72.33
	其中：股票	7,011,857,429.59	72.33
2	固定收益投资	2,328,981,000.00	24.02
	其中：债券	2,328,981,000.00	24.02
	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	269,853,772.32	2.78
6	其他资产	84,132,701.36	0.87
7	合计	9,694,824,903.27	100.00

8.2 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	405,241,223.44	4.20
C	制造业	2,901,328,083.54	30.07
C0	食品、饮料	405,091,664.39	4.20
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	13,660,000.00	0.14
C4	石油、化学、塑胶、塑料	478,720,916.22	4.96
C5	电子	63,486,865.92	0.66
C6	金属、非金属	189,963,579.59	1.97
C7	机械、设备、仪表	962,010,114.76	9.97
C8	医药、生物制品	788,394,942.66	8.17
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	91,847,207.20	0.95
E	建筑业	437,092,540.28	4.53
F	交通运输、仓储业	344,573,864.70	3.57
G	信息技术业	171,415,711.76	1.78
H	批发和零售贸易	376,115,337.18	3.90
I	金融、保险业	1,482,583,254.41	15.37
J	房地产业	481,870,868.88	4.99
K	社会服务业	66,675,713.68	0.69
L	传播与文化产业	53,000,000.00	0.55
M	综合类	200,113,624.52	2.07
	合计	7,011,857,429.59	72.68

8.3 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	002024	苏宁电器	21,000,298	376,115,337.18	3.90
2	601318	中国平安	12,003,012	319,160,089.08	3.31
3	600036	招商银行	23,000,000	279,680,000.00	2.90
4	600276	恒瑞医药	7,000,000	269,570,000.00	2.79
5	000002	万科A	37,832,235	244,017,915.75	2.53
6	601398	工商银行	63,569,199	225,034,964.46	2.33
7	601088	中国神华	12,537,100	219,900,734.00	2.28
8	601166	兴业银行	14,996,940	218,955,324.00	2.27
9	600519	贵州茅台	2,000,000	217,400,000.00	2.25
10	601186	中国铁建	18,995,932	190,719,157.28	1.98

11	601169	北京银行	19,964,747	177,885,895.77	1.84
12	600048	保利地产	10,657,278	153,464,803.20	1.59
13	600089	特变电工	6,134,405	146,489,591.40	1.52
14	600030	中信证券	8,000,000	143,760,000.00	1.49
15	600428	中远航运	22,420,069	143,488,441.60	1.49
16	600858	银座股份	7,844,500	128,728,245.00	1.33
17	600426	华鲁恒升	12,000,749	127,327,946.89	1.32
18	000651	格力电器	6,496,866	126,299,075.04	1.31
19	000792	盐湖钾肥	2,222,854	126,213,650.12	1.31
20	000983	西山煤电	10,775,375	125,640,872.50	1.30
21	002038	双鹭药业	3,371,732	123,675,129.76	1.28
22	601006	大秦铁路	15,320,000	122,866,400.00	1.27
23	600271	航天信息	4,830,056	121,765,711.76	1.26
24	000513	丽珠集团	6,977,786	121,273,920.68	1.26
25	601628	中国人寿	6,332,814	118,106,981.10	1.22
26	601390	中国中铁	19,000,000	102,980,000.00	1.07
27	002202	金风科技	4,000,000	101,000,000.00	1.05
28	600005	武钢股份	20,333,611	97,194,660.58	1.01
29	000402	金融街	11,089,113	84,388,149.93	0.87
30	600849	上海医药	11,213,063	80,734,053.60	0.84
31	002122	天马股份	1,478,023	78,822,966.59	0.82
32	000422	湖北宜化	9,797,694	75,736,174.62	0.79
33	600415	小商品城	1,300,754	71,385,379.52	0.74
34	000680	山推股份	9,392,390	71,194,316.20	0.74
35	600169	太原重工	5,000,000	63,400,000.00	0.66
36	000425	徐工科技	4,000,000	62,200,000.00	0.64
37	600820	隧道股份	5,495,070	59,896,263.00	0.62
38	002152	广电运通	1,999,976	59,139,290.32	0.61
39	000028	一致药业	3,599,736	59,071,667.76	0.61
40	002028	思源电气	2,030,367	56,850,276.00	0.59
41	000157	中联重科	5,000,000	55,900,000.00	0.58
42	600600	青岛啤酒	2,744,532	54,863,194.68	0.57
43	600795	国电电力	9,800,000	54,586,000.00	0.57
44	600004	白云机场	7,670,951	54,080,204.55	0.56
45	600196	复星医药	5,015,021	53,209,372.81	0.55
46	600880	博瑞传播	4,000,000	53,000,000.00	0.55
47	000729	燕京啤酒	4,002,127	52,868,097.67	0.55
48	600309	烟台万华	5,000,000	50,000,000.00	0.52
49	600100	同方股份	5,000,000	49,650,000.00	0.51
50	600720	祁连山	7,035,759	48,476,379.51	0.50
51	600970	中材国际	1,504,285	48,137,120.00	0.50
52	600395	盘江股份	3,969,361	46,600,298.14	0.48
53	600664	哈药股份	3,740,073	41,814,016.14	0.43
54	600582	天地科技	3,036,635	41,541,166.80	0.43
55	000069	华侨城 A	5,000,000	40,900,000.00	0.42
56	000538	云南白药	1,134,751	39,046,781.91	0.40
57	000869	张裕 A	785,850	38,113,725.00	0.40

58	600900	长江电力	5,069,552	37,261,207.20	0.39
59	000698	沈阳化工	6,315,743	37,199,726.27	0.39
60	600068	葛洲坝	4,000,000	35,360,000.00	0.37
61	000731	四川美丰	5,485,648	35,053,290.72	0.36
62	002008	大族激光	5,436,640	31,804,344.00	0.33
63	600551	时代出版	1,901,712	31,682,521.92	0.33
64	600097	华立科技	2,797,762	31,083,135.82	0.32
65	000895	双汇发展	842,540	29,050,779.20	0.30
66	002109	兴化股份	4,058,228	27,190,127.60	0.28
67	600054	黄山旅游	1,926,436	25,775,713.68	0.27
68	600009	上海机场	2,141,865	24,138,818.55	0.25
69	002073	青岛软控	2,118,549	22,265,949.99	0.23
70	601766	中国南车	5,000,000	21,550,000.00	0.22
71	600219	南山铝业	3,000,000	18,540,000.00	0.19
72	600499	科达机电	2,542,170	17,744,346.60	0.18
73	600425	青松建化	1,929,115	14,082,539.50	0.15
74	002078	太阳纸业	2,000,000	13,660,000.00	0.14
75	000933	神火股份	999,948	13,099,318.80	0.14
76	600195	中牧股份	1,088,084	12,795,867.84	0.13
77	600660	福耀玻璃	3,000,000	11,670,000.00	0.12
78	000887	中鼎股份	1,000,000	6,530,000.00	0.07

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	889,758,906.37	3.81
2	600005	武钢股份	747,003,132.01	3.20
3	600519	贵州茅台	733,330,888.97	3.14
4	002024	苏宁电器	700,463,723.14	3.00
5	601166	兴业银行	603,828,657.07	2.58
6	601398	工商银行	546,966,519.62	2.34
7	601088	中国神华	493,930,238.26	2.11
8	600036	招商银行	354,601,141.54	1.52
9	601006	大秦铁路	348,156,224.79	1.49
10	600030	中信证券	340,946,754.65	1.46
11	600026	中海发展	286,766,919.12	1.23
12	600348	国阳新能	285,730,073.69	1.22
13	600641	万业企业	276,068,556.56	1.18
14	601939	建设银行	270,806,857.73	1.16
15	601169	北京银行	264,700,720.84	1.13
16	000707	双环科技	264,109,323.93	1.13
17	600028	中国石化	261,660,737.17	1.12

18	600428	中远航运	251, 159, 710. 26	1. 07
19	601919	中国远洋	250, 261, 967. 15	1. 07
20	601699	潞安环能	246, 384, 416. 66	1. 05

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	1, 057, 484, 759. 06	4. 52
2	600036	招商银行	896, 821, 745. 21	3. 84
3	601318	中国平安	774, 931, 589. 50	3. 31
4	600000	浦发银行	594, 089, 781. 32	2. 54
5	000069	华侨城 A	590, 206, 241. 10	2. 52
6	601919	中国远洋	531, 212, 297. 09	2. 27
7	600348	国阳新能	512, 944, 887. 53	2. 19
8	000002	万科 A	481, 248, 444. 07	2. 06
9	601166	兴业银行	422, 141, 027. 95	1. 81
10	000157	中联重科	411, 069, 339. 46	1. 76
11	601088	中国神华	398, 436, 530. 89	1. 70
12	600005	武钢股份	374, 906, 755. 20	1. 60
13	600048	保利地产	309, 973, 448. 79	1. 33
14	601111	中国国航	304, 926, 481. 93	1. 30
15	000060	中金岭南	304, 185, 843. 72	1. 30
16	600009	上海机场	292, 914, 724. 78	1. 25
17	600875	东方电气	280, 618, 801. 21	1. 20
18	601939	建设银行	280, 266, 779. 34	1. 20
19	601699	潞安环能	278, 624, 158. 32	1. 19
20	600028	中国石化	266, 613, 567. 74	1. 14

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额：	20, 780, 458, 784. 76
卖出股票的收入（成交）总额：	20, 616, 382, 200. 52

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值
----	------	---------	---------

			比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	2,328,981,000.00	24.14
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	2,328,981,000.00	24.14

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	0801092	08 央票 92	5,000,000	489,200,000.00	5.07
2	0801095	08 央票 95	3,300,000	323,037,000.00	3.35
3	0801050	08 央票 50	2,000,000	213,880,000.00	2.22
4	0801047	08 央票 47	2,000,000	213,800,000.00	2.22
5	0801098	08 央票 98	2,000,000	195,880,000.00	2.03

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

8.9.2 本基金投资前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.9.3 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	1,973,012.57
2	应收证券清算款	30,818,123.19
3	应收股利	-
4	应收利息	50,969,159.16
5	应收申购款	372,406.44
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,132,701.36

8.9.4 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。

8.9.5 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,787,028	10,903.62	401,019,475.92	2.06%	19,084,061,335.77	97.94%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项 目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	64,999.82	0.00%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年8月2日）基金份额总额	500,000,000.00
报告期期初基金份额总额	22,282,586,312.15
报告期间基金总申购份额	454,136,025.25
报告期间基金总赎回份额	-3,251,641,525.71
报告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	19,485,080,811.69

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 2008 年 6 月 10 日，本基金管理人发布关于董事和监事变更的公告，经本公司股东会审议，选举马名驹先生担任本公司董事，顾培柱先生不再担任本公司董事；选举李梅清女士担任本公司监事，戴金宝先生不再担任本公司监事。

(2). 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。

(3). 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。

(4). 2008 年 2 月 13 日，本基金管理人发布关于基金经理调整的公告，鲍泓先生不再担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理，聘任张伟先生、邓跃辉先生为华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金改聘为其审计的会计师事务所情况：本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况如下：160,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 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	7,635,564,354.93	18.73%	6,490,200.78	18.97%	
第一创业有限责任公司	1	551,841,287.94	1.35%	469,059.67	1.37%	
东方证券股份有限公司	2	4,798,756,652.97	11.77%	4,024,227.22	11.76%	
光大证券股份有限公司	1	2,778,652,925.94	6.82%	2,257,681.07	6.60%	
国金证券股份有限公司	1	4,789,421,085.22	11.75%	4,070,980.63	11.90%	

国泰君安证券股份有限公司	1	4,554,994,061.36	11.17%	3,871,734.50	11.32%	
国元证券股份有限公司	1	106,133,914.98	0.26%	90,212.97	0.26%	
联合证券有限责任公司	1	3,513,513,651.16	8.62%	2,854,751.34	8.34%	
平安证券有限责任公司	1	2,754,270,143.66	6.76%	2,341,111.05	6.84%	
齐鲁证券有限公司	1	2,142,908,235.14	5.26%	1,821,473.38	5.32%	
瑞银证券有限责任公司	1	119,754,344.53	0.29%	101,789.10	0.30%	
申银万国证券股份有限公司	1	3,268,276,584.28	8.02%	2,778,027.45	8.12%	
中信证券股份有限公司	1	46,548,025.37	0.11%	37,820.83	0.11%	
中银国际有限责任公司	1	3,701,666,605.10	9.08%	3,007,625.96	8.79%	

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	
安信证券股份有限公司	95,996,226.00	92.16%	-	-	-	-	
第一创业有限责任公司	-	-	-	-	-	-	
东方证券股份有限公司	-	-	954,600,000.00	63.45%	-	-	
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
国金证券股份有限公司	1,242,079.00	1.19%	-	-	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
联合证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	
平安证券有限责任公司	-	-	550,000,000.00	36.55%	-	-	
齐鲁证券有限公司	5,230,289.40	5.02%	-	-	4,726,713.61	100.00%	
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-	
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	

中银国际有 限责任公司	1,689,685.40	1.62%	-	-	-	-	-
----------------	--------------	-------	---	---	---	---	---

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：

新增安信证券股份有限公司上海交易单元1个；

新增中信证券股份有限公司深圳交易单元1个；

新增瑞银证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增第一创业有限责任公司上海交易单元1个；

新增国元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。

11.8 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	关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	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	2008-1-5
2	关于新增中国民生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	2008-1-15
3	关于参加中国光大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	2008-1-18
4	关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	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	2008-1-19
5	关于参加建设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	2008-1-25
6	关于参加建设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	2008-1-28
7	关于新增安信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	2008-1-31
8	关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	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	2008-2-2
9	关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	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	2008-2-16
10	关于在建设银行开通旗下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	2008-2-25
11	关于华安策略优选股票型证券投资基金继续暂停申购（定期定额投资除外）和转入业务的提示性公告	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	2008-3-1
12	关于旗下部分基金参加上海银行基金定期定额申购业务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	2008-3-12
13	关于华安策略优选股票型证券投资基金重新开放申购和转入业务的公告	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	2008-3-15
14	关于华安策略优选股票型证券投资基金重新开放申购和转入业务的提示性公告	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	2008-3-18
15	关于在中国工商银行股份有限公司开通华安策略优选股票型证券投资基金定期定额投资计划的公告	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	2008-3-19
16	关于增加华安策略优选股票型证券投资基金参加中国工商银行基金定投优	在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》或公司网	2008-3-19

	惠活动的公告	站 www.huaan.com.cn 上披露	
17	关于新增深圳平安银行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	2008-3-21
18	关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告	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	2008-3-24
19	关于新增华安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	2008-3-24
20	关于新增华泰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	2008-3-24
21	关于新增东莞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	2008-4-11
22	关于新增平安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	2008-4-17
23	关于新增广东发展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	2008-5-5
24	关于参加北京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	2008-6-3
25	关于开通北京银行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	2008-6-3
26	关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告	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	2008-6-3
27	关于参加交通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	2008-6-12
28	关于网上交易系统开通招商银行网上直销业务的公告	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	2008-6-17
29	关于新增广州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	2008-6-25
30	关于参加中信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	2008-6-26
31	关于新增瑞银证券有限责任公司为开放式基金代销机构及参加瑞银证券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	2008-6-27
32	关于在中国民生银行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	2008-7-10

33	关于新增中银国际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	2008-7-21
34	关于参加广州证券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	2008-7-22
35	关于参加长江证券股份有限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	2008-7-25
36	关于新增中山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	2008-7-25
37	关于旗下基金投资沈阳化工（000698）非公开发行的公告	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	2008-8-11
38	关于新增齐鲁证券有限公司为开放式基金代销机构及参加齐鲁证券有限公司网上交易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	2008-8-13
39	关于推出手机基金交易/查询业务的公告	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	2008-9-1
40	关于暂停参加齐鲁证券有限公司网上交易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	2008-9-3
41	关于新增国联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	2008-9-8
42	关于运用固有资金进行开放式基金投资的公告，本公司从 2008 年 9 月 10 日开始的 6 个月内，通过申银万国证券股份有限公司每月进行等额投资。各基金的投资总额与申购费率如下：华安宏利股票型证券投资基金（基金代码 040005）1680 万元，单笔申购费率为 0.60%；华安创新证券投资基金（基金代码 040001）1260 万元，单笔申购费率为 0.60%；华安策略优选股票型证券投资基金（基金代码 040008）840 万元，单笔申购费率为 0.60%；华安中小盘成长股票型证券投资基金（基金代码 040007）420 万元，单笔申购费率为 0.60%。	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	2008-9-8
43	关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的提示性公告，自 2008 年 9 月 16 日起，对我公司所管理的相关基金的估值原则作如下调整： 1、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，以最近交易日的收盘价估值。	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	2008-9-16

	2、估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。 如有确凿证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实反映股票的公允价值，本基金管理人可以与基金托管人协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。 本基金管理人将聘请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。		
44	关于旗下基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》对基金净值影响的公告	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	2008-9-17
45	关于新增西部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	2008-9-17
46	关于参加齐鲁证券有限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	2008-9-25
47	关于新增东北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	2008-10-6
48	关于新增国元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	2008-10-15
49	关于参加光大证券股份有限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	2008-10-27
50	关于在广东发展银行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	2008-11-3
51	关于新增华龙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	2008-11-17
52	关于新增中国建银投资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	2008-11-25
53	关于新增山西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	2008-12-3
54	关于旗下部分基金开通基金定期定额投资业务后端收费模式和调整赎回适用持有期的公告	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	2008-12-10

55	关于参加深圳平安银行股份有限公司网上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	2008-12-13
56	关于新增红塔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	2008-12-18
57	关于旗下基金对盐湖钾肥继续采用指数收益法进行估值的公告	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	2008-12-27
58	关于参加中国工商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	2008-12-30
59	关于参加中国建设银行定期定额申购长期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	2008-12-31
60	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	2008-12-31
61	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
62	关于旗下基金投资太原重工（600169）非公开发行的公告	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
63	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

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。

§ 12 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 3 月 26 日