

华安稳定收益债券型证券投资基金 2009 年年度报告摘要

2009 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2010 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年3月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2009年1月1日起至2009年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安稳定收益债券		
基金主代码	040009		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2008 年 4 月 30 日		
基金管理人	华安基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	500,950,498.27 份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B	
下属分级基金的交易代码	040009(前端)	041009(后端)	040010
报告期末下属分级基金的份额总额	370,948,351.88 份	130,002,146.39 份	

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制投资风险的基础上，通过主动管理，获取证券的利息收益及市场价格变动收益，以追求资产持续稳健的增值。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产的分配比例。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中较高流动性、低风险的品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司 (简称“华安基金”)	中国建设银行股份有限公司 (简称“中国建设银行”)
信息披露负责人	姓名	冯颖	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		40088-50099	010-67595096

传真	021-68863414	010-66275833
----	--------------	--------------

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	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

§ 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	2009 年		2008 年 4 月 30 日—2008 年 12 月 31 日	
	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
本期已实现收益	84,033,351.21	34,955,809.55	80,928,227.45	26,578,400.28
本期利润	-8,233,950.77	-3,748,445.25	189,141,645.94	60,294,898.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0112	-0.0122	0.0874	0.0916
本期基金份额净值增长率	3.79%	3.33%	9.53%	9.21%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末		2008 年末	
	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
期末可供分配基金份额利润	0.1055	0.0972	0.0403	0.0373
期末基金资产净值	410,079,422.11	142,634,760.84	1,974,333,107.35	1,108,989,906.10
期末基金份额净值	1.1055	1.0972	1.0953	1.0921

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金、开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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

4、本基金于 2008 年 4 月 30 日成立。合同生效当期不是完整报告期。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安稳定收益债券 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④

过去三个月	5.27%	0.23%	0.53%	0.04%	4.74%	0.19%
过去六个月	3.92%	0.37%	0.00%	0.05%	3.92%	0.32%
过去一年	3.79%	0.29%	-1.24%	0.10%	5.03%	0.19%
自基金合同生效起至今	13.69%	0.24%	9.87%	0.18%	3.82%	0.06%

华安稳定收益债券 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	5.15%	0.23%	0.53%	0.04%	4.62%	0.19%
过去六个月	3.68%	0.37%	0.00%	0.05%	3.68%	0.32%
过去一年	3.33%	0.29%	-1.24%	0.10%	4.57%	0.19%
自基金合同生效起至今	12.84%	0.24%	9.87%	0.18%	2.97%	0.06%

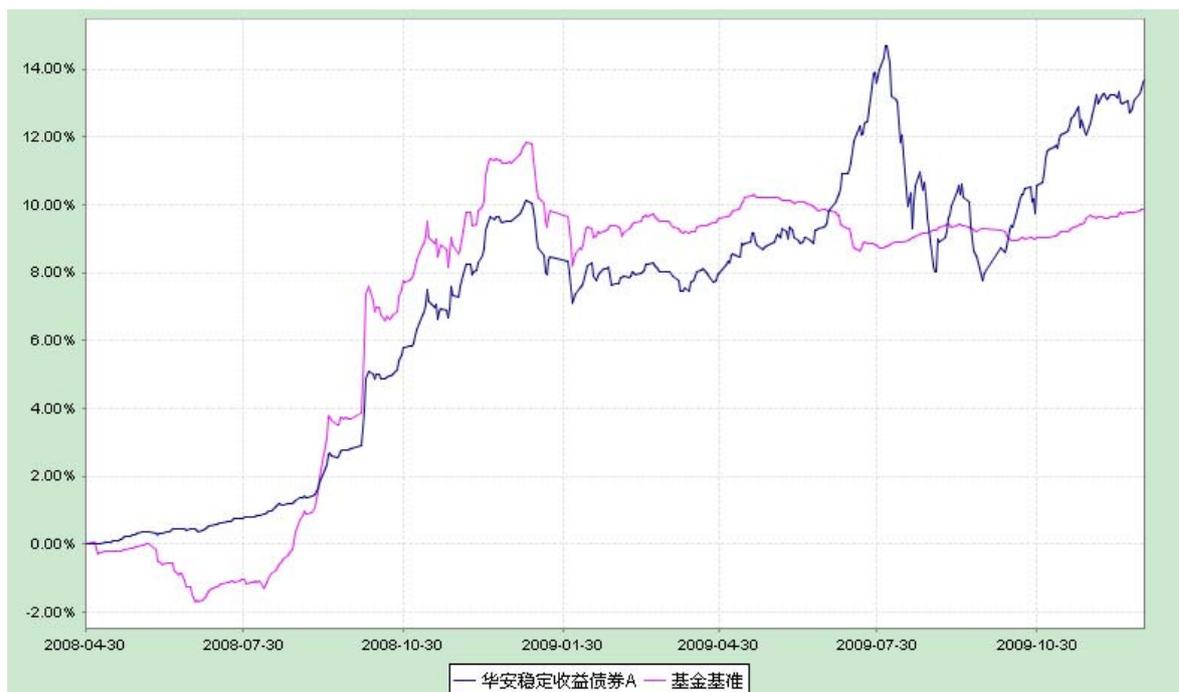
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安稳定收益债券型证券投资基金

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

(2008 年 4 月 30 日至 2009 年 12 月 31 日)

1. 华安稳定收益债券 A:

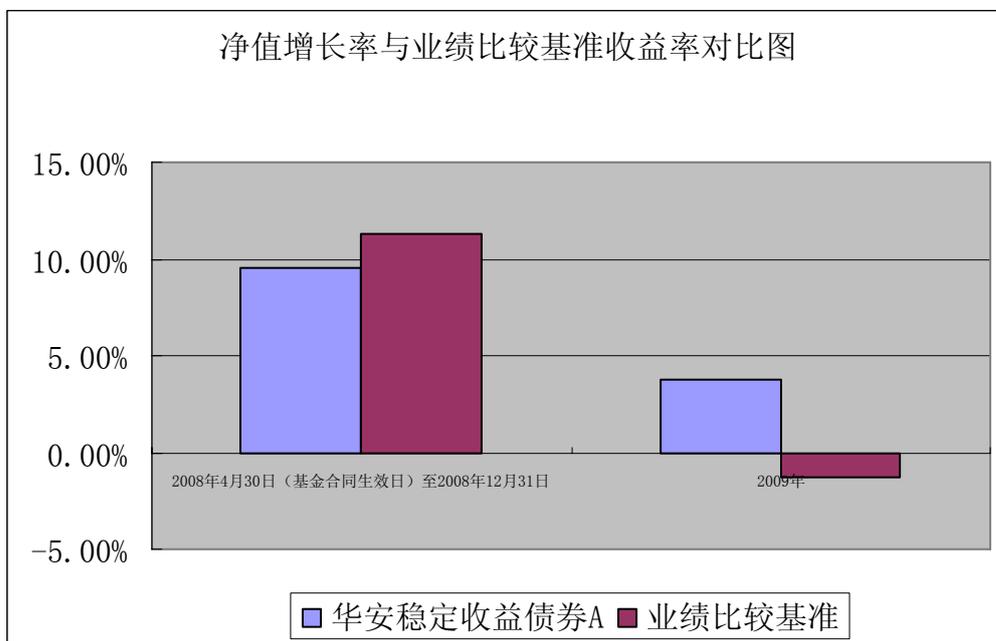


2. 华安稳定收益债券 B:

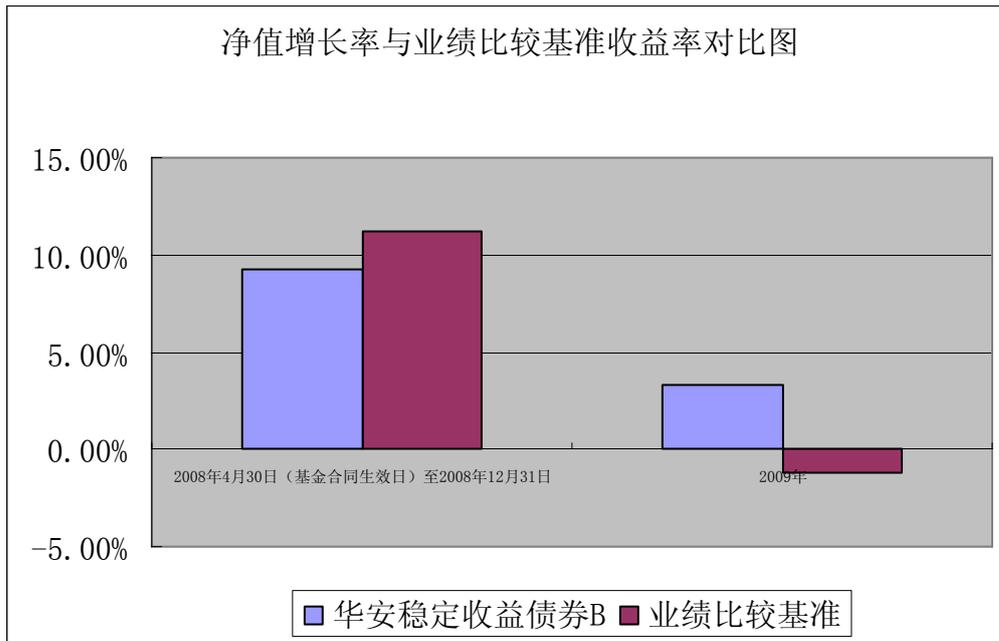


3. 2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安稳定收益债券 A



华安稳定收益债券 B



注：基金合同生效以来未满 5 年，图示为基金合同生效以来各年度的数据，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

华安稳定收益债券 A

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009 年	0.300	42,920,820.63	12,766,976.20	55,687,796.83	-
2008 年 4 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2008 年 12 月 31 日	-	-	-	-	-
合计	0.300	42,920,820.63	12,766,976.20	55,687,796.83	-

华安稳定收益债券 B

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
2009 年	0.300	16,608,450.84	5,674,222.17	22,282,673.01	-
2008 年 4 月 30 日 (基金合同生效)	-	-	-	-	-

效日)至 2008年 12月31 日					
合计	0.300	16,608,450.84	5,674,222.17	22,282,673.01	-

§ 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2009年12月31日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭2只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安宝利配置混合、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、华安动态灵活配置混合、华安上证180ETF联接、华安国际配置(QDII)等14只开放式基金，管理资产规模达到930.18亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理)期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的 基金经理	2008年4月 30日	-	12年	金融学硕士（金融工程方向），12年证券、基金从业经历。曾任长城证券有限责任公司债券研究员，华安基金管理有限公司债券研究员、债券投资风险管理员、固定收益投资经理。2008年4月起担任本基金的基金经理。

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安稳定收益债券型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金（账户）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《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》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

本基金为债券型基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年随着“保增长”政策的落实，信贷放量、投资高速增长、出口逐步恢复、CPI 年底由负转正，中国经济实现“V”型反转。根据宏观和市场变化，年初组合采取了减持中长期债券、压缩债券久期的策略，并将配置重点逐步转向可转债。年中新股发行重启，组合积极参与了网下询价和申购。三季度信用债密集发行、票面利率接近降息前的水平，组合加大了信用债的配置力度。年底随着一级市场发行市盈率走高，组合“打新”趋于谨慎。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，华安稳定收益债券 A 份额净值增长率为 3.79%，华安稳定收益债券 B 份额净值增长率为 3.33%，同期业绩比较基准增长率为-1.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2010 年，外需趋稳内需依然强劲，经济增速或将超潜在增长水平。为防止过热，货币政策回归常态，预计央行将以“数量”调控为主，并根据外需与通胀变化择机加息与升值。“紧信贷宽货币”下债券市场流动性依然充裕，但随着准备金率上升、货币增速的下降，货币市场利率有抬升趋势。目前市场通胀预期较强，但中长期债券收益率已部分提前反映，若实际通胀水平与预期产生差异将引发中长债收益率波动。信用债从绝对收益率和相对利差角度考察依然有较高配置价值。股市震荡、可转债转股溢价率下降，为投资者提供波段操作机会。新股破发、中签率上升，深入研究精选个股是提高新股申购安全和收益的前提。本基金将密切跟踪发电量、信贷和进出口等经济领先指标数据，在研判市场短期变化和中期趋势基础上，努力提高组合配置效率。未来一段时间组合仍将以企业债和公司债作为配置重点，结合转债条款和正股基本面灵活操作可转债，谨慎参与新股申购。

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历的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、风险管理和金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任华安安信封闭的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

尚志民，基金投资部总经理，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究

所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部总经理，经济学硕士，13 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦，风险管理和金融工程部总经理，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接的基金经理，风险管理和金融工程部总经理。

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等复核和核查的责任。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、2008 年度在本报告期内实施的利润分配：

向全体持有人按每 10 份基金份额收益分配金额 0.30 元。红利发放的公告日：2009 年 1 月 13 日，权益登记日、除息日：2009 年 1 月 19 日，红利划出日、红利再投资日：2009 年 1 月 20 日。

2、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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金实施利润分配的金额为华安稳定收益债券 A: 55,687,796.83 元;华安稳定收益债券 B: 22,282,673.01 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计,注册会计师马颖旎、金毅签字出具了普华永道中天审字(2010)第 20132 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文,应阅读年度报告正文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安稳定收益债券型证券投资基金
报告截止日:2009 年 12 月 31 日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	149,437,842.77	197,609,385.80
结算备付金	1,679,205.77	301,544.61
存出保证金	13,410.83	330.11

交易性金融资产	565,988,825.50	2,818,986,302.26
其中：股票投资	49,498,908.75	-
基金投资	-	-
债券投资	516,489,916.75	2,818,986,302.26
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	6,777,798.72	5,308,135.32
应收利息	9,529,743.84	44,681,445.04
应收股利	-	-
应收申购款	2,175,574.90	22,390,476.02
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	735,602,402.33	3,089,277,619.16
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2009年12月31日	2008年12月31日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	138,999,665.60	-
应付证券清算款	1,559,290.03	1,088,037.13
应付赎回款	41,557,916.85	2,500,598.76
应付管理人报酬	298,047.66	1,455,752.91
应付托管费	99,349.21	485,250.96
应付销售服务费	49,660.63	306,342.61
应付交易费用	48,930.79	23,369.65
应交税费	36,746.00	-
应付利息	8,757.05	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	229,855.56	95,253.69
负债合计	182,888,219.38	5,954,605.71
所有者权益：		

实收基金	500,950,498.27	2,818,035,321.77
未分配利润	51,763,684.68	265,287,691.68
所有者权益合计	552,714,182.95	3,083,323,013.45
负债和所有者权益总计	735,602,402.33	3,089,277,619.16

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，A 类份额净值 1.1055 元，B 类份额净值 1.0972 元；基金份额总额 500,950,498.27 份，其中 A 类份额总额 370,948,351.88 份，B 类份额总额 130,002,146.39 份。

7.2 利润表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2009年1月1日至2009 年12月31日	上年度可比期间 2008年4月30日（基金合 同生效日）至2008年12 月31日
一、收入	269,939.22	268,184,187.53
1. 利息收入	38,793,621.11	73,579,102.00
其中：存款利息收入	1,041,686.64	1,882,083.34
债券利息收入	37,370,691.99	69,179,014.90
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	381,242.48	2,518,003.76
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	91,434,577.17	52,083,297.41
其中：股票投资收益	8,205,681.14	10,380,734.83
基金投资收益	-	-
债券投资收益	82,515,309.58	41,045,599.51
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	542,685.23	656,963.07
股利收益	170,901.22	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-130,971.556.78	141,929,916.69
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,013,297.72	591,871.43
减：二、费用	12,252,335.24	18,747,643.11
1. 管理人报酬	6,889,168.88	11,645,328.93
2. 托管费	2,296,389.56	3,881,776.31
3. 销售服务费	1,355,719.42	1,814,643.90
4. 交易费用	418,256.25	127,576.77
5. 利息支出	894,178.84	1,132,987.40
其中：卖出回购金融资产支出	894,178.84	1,132,987.40
6. 其他费用	398,622.29	145,329.80

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-11,982,396.02	249,436,544.42
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损“-”号填列）	-11,982,396.02	249,436,544.42

注：本基金于 2008 年 4 月 30 日成立。上年度可比期间为 2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	2,818,035,321.77	265,287,691.68	3,083,323,013.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-11,982,396.02	-11,982,396.02
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-2,317,084,823.50	-123,571,141.14	-2,440,655,964.64
其中：1. 基金申购款	1,306,221,361.63	101,438,726.56	1,407,660,088.19
2. 基金赎回款	-3,623,306,185.13	-225,009,867.70	-3,848,316,052.83
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-77,970,469.84	-77,970,469.84
五、期末所有者权益(基金净值)	500,950,498.27	51,763,684.68	552,714,182.95
	上年度可比期间 2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）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)	3,130,761,926.67	-	3,130,761,926.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	249,436,544.42	249,436,544.42
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)	-312,726,604.90	15,851,147.26	-296,875,457.64
其中：1. 基金申购款	2,098,352,733.27	99,449,688.29	2,197,802,421.56
2. 基金赎回款	-2,411,079,338.17	-83,598,541.03	-2,494,677,879.20

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）	2,818,035,321.77	265,287,691.68	3,083,323,013.45

注：本基金于 2008 年 4 月 30 日成立。上年度可比期间为 2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安稳定收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]294 号《关于核准华安稳定收益债券型证券投资基金募集申请的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,130,395,744.96 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 48 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》于 2008 年 4 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 3,130,761,926.67 份基金份额，其中认购资金利息折合 366,181.71 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》和《华安稳定收益债券型证券投资基金招募说明书》，本基金自募集期起根据费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认/申购时收取认/申购费用的，称为 A 类；在投资者认/申购时不收取认/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 B 类。本基金 A 和 B 类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为固定收益类金融工具，包括国内依法公开发行、上市的国债、金融债、可转换债券、可分离债券、债券回购、央行票据、信用等级为投资级的企业(公司)债，以及股票等权益类品种和法律法规或监管机构允许基金投资的其它金融工具。本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为基金资产的 80%-100%；现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；股票等权益类品种的投资比例为基金资产的 0%-20%。本基金的业绩比较基准为：中国债券总指数。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2010 年 3 月 26

日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》和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 2009 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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

本会计期间不存在会计估计变更。

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》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司 (“华安基金”)	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 (“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的原股东(2009 年 11 月 4 日以前)
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东(自 2009 年 11 月 4 日起)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

注：根据华安基金管理有限公司于 2009 年 11 月 4 日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监许可[2009]1087 号文批准，公司原股东上海沸点投资发展有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 20% 股权全部转让给国泰君安投资管理股份有限公司。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日)应支付关联方的佣金均为零。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	2008 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,889,168.88	11,645,328.93
其中：支付销售机构的客户维护费	575,897.66	811,859.92

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.6% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,296,389.56	3,881,776.31

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.2% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安稳定收益 债券 A	华安稳定收 益债券 B	合计
华安基金管理有限公司	-	376,932.34	376,932.34
中国建设银行股份有限公司	-	335,131.12	335,131.12
合计	-	712,063.46	712,063.46
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安稳定收益 债券 A	华安稳定收 益债券 B	合计
华安基金管理有限公司	-	305,507.46	305,507.46
中国建设银行股份有限公司	-	555,701.58	555,701.58
合计	-	861,209.04	861,209.04

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

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.4% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易 金额	利息 收入	交易 金额	利息 支出
中国建设银行股份有限公司	159,715,780.43	79,656,683.84	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日）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
中国建设银行股份有限公司	707,828,925.84	-	-	-	-	-

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）和上年度可比期间内（2008 年 4 月 30 日至 2008 年 12 月 31 日）均无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.8.4.2 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（2009 年 12 月 31 日）和上年度末（2008 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 4 月 30 日（基金合同生效日） 至 2008 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行 股份有限公司	149,437,842.77	1,003,249.61	197,609,385.80	1,785,690.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）和上年度可比期间内（2008 年 4 月 30 日至 2008 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券
7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600999	招商证券	2009 年 11 月 12 日	2010 年 2 月 22 日	新股网下认购	31.00	29.39	150,213	4,656,603.00	4,414,760.07	-
601888	中国国旅	2009 年 9 月 25 日	2010 年 1 月 15 日	新股网下认购	11.78	20.94	74,466	877,209.48	1,559,318.04	-
002304	洋河股份	2009 年 10 月 29 日	2010 年 2 月 8 日	新股网下认购	60.00	113.99	9,651	579,060.00	1,100,117.49	-
002312	三泰电子	2009 年 11 月 26 日	2010 年 3 月 3 日	新股网下认购	28.60	47.01	19,736	564,449.60	927,789.36	-
002313	日海通讯	2009 年 11 月 26 日	2010 年 3 月 3 日	新股网下认购	24.80	40.82	17,281	428,568.80	705,410.42	-
002315	焦点科技	2009 年 12 月 1 日	2010 年 3 月 9 日	新股网下认购	42.00	69.18	7,275	305,550.00	503,284.50	-
002319	乐通股份	2009 年 12 月 3 日	2010 年 3 月 11 日	新股网下认购	13.70	31.28	34,019	466,060.30	1,064,114.32	-
002321	华英农业	2009 年 12 月 9 日	2010 年 3 月 16 日	新股网下认购	16.98	26.61	82,149	1,394,890.02	2,185,984.89	-
002322	理工监测	2009 年 12 月 11 日	2010 年 3 月 18 日	新股网下认购	40.00	61.88	9,088	363,520.00	562,365.44	-
002323	中联电气	2009 年 12 月 11 日	2010 年 3 月 18 日	新股网下认购	30.00	40.57	17,283	518,490.00	701,171.31	-
002324	普利特	2009 年 12 月 11 日	2010 年 3 月 18 日	新股网下认购	22.50	34.62	19,527	439,357.50	676,024.74	-
002326	永太科技	2009 年 12 月 15 日	2010 年 3 月 22 日	新股网下认购	20.00	31.27	28,246	564,920.00	883,252.42	-
002327	富安娜	2009 年 12 月 22 日	2010 年 3 月 30 日	新股网下认购	30.00	39.66	15,960	478,800.00	632,973.60	-
002330	得利斯	2009 年 12 月 25 日	预计 2010 年 4 月 7 日	新股网下认购	13.18	13.18	18,684	246,255.12	246,255.12	-
002331	皖通科技	2009 年 12 月 25 日	预计 2010 年 4 月 7 日	新股网下认购	27.00	27.00	26,748	722,196.00	722,196.00	-
002332	仙琚制药	2009 年 12 月 30 日	预计 2010 年 4 月 13 日	新股网下认购	8.20	8.20	97,604	800,352.80	800,352.80	-
300003	乐普医疗	2009 年 9 月 29 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	29.00	51.20	8,611	249,719.00	440,883.20	-
300005	探路者	2009 年 9 月 29 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	19.80	43.71	8,581	169,903.80	370,441.77	-
300006	莱美药业	2009 年 9 月 29 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	16.50	33.43	20,842	343,893.00	696,748.06	-
300007	汉威电子	2009 年 9 月 29 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	27.00	44.01	14,104	380,808.00	620,717.04	-
300009	安科生物	2009 年 9 月 29 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	17.00	42.67	12,958	220,286.00	552,917.86	-

300014	亿纬锂能	2009年10月15日	2010年2月1日	新股网下认购	18.00	39.55	32,686	588,348.00	1,292,731.30	-
300017	网宿科技	2009年10月15日	2010年2月1日	新股网下认购	24.00	42.71	16,323	391,752.00	697,155.33	-
300024	机器人	2009年10月19日	2010年2月1日	新股网下认购	39.80	72.28	25,175	1,001,965.00	1,819,649.00	-
300026	红日药业	2009年10月19日	2010年2月1日	新股网下认购	60.00	91.20	24,118	1,447,080.00	2,199,561.60	-
300029	天龙光电	2009年12月18日	2010年3月25日	新股网下认购	18.18	29.10	47,992	872,494.56	1,396,567.20	-
300030	阳普医疗	2009年12月18日	2010年3月26日	新股网下认购	25.00	35.10	20,313	507,825.00	712,986.30	-
300032	金龙机电	2009年12月18日	2010年3月25日	新股网下认购	19.00	29.80	29,419	558,961.00	876,686.20	-
300033	同花顺	2009年12月18日	2010年3月25日	新股网下认购	52.80	70.86	13,084	690,835.20	927,132.24	-
300034	钢研高纳	2009年12月18日	2010年3月25日	新股网下认购	19.53	34.53	22,552	440,440.56	778,720.56	-
300036	超图软件	2009年12月18日	2010年3月25日	新股网下认购	19.60	38.31	12,805	250,978.00	490,559.55	-
300039	上海凯宝	2009年12月28日	预计2010年4月9日	新股网下认购	38.00	38.00	22,704	862,752.00	862,752.00	-
300040	九州电气	2009年12月28日	预计2010年4月9日	新股网下认购	33.00	33.00	22,597	745,701.00	745,701.00	-

7.4.9.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123000	09宜华债	2009年10月28日	未知	未上市新债	100.00	100.00	100,000	10,000,000.00	10,000,000.00	-

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。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 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 89,599,665.60 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
088044	08 无锡公用债	2010年1月12日	103.18	200,000	20,636,000.00
088015	08 甬交投债	2010年1月12日	105.19	300,000	31,557,000.00
098009	09 上实债	2010年1月	98.73	200,000	19,746,000.00

		12 日			
088029	08 峰峰债	2010 年 1 月 12 日	104.19	200,000	20,838,000.00
合计	-	-	-	900,000	92,777,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 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 49,400,000.00 元，于 2010 年 1 月 6 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。

7.4.10 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	49,498,908.75	6.73
	其中：股票	49,498,908.75	6.73
2	固定收益投资	516,489,916.75	70.21
	其中：债券	516,489,916.75	70.21
	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	151,117,048.54	20.54
6	其他各项资产	18,496,528.29	2.51
7	合计	735,602,402.33	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,185,984.89	0.40
B	采掘业	-	-
C	制造业	20,961,479.69	3.79
C0	食品、饮料	1,346,372.61	0.24
C1	纺织、服装、皮毛	632,973.60	0.11

C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	370,441.77	0.07
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,623,391.48	0.47
C5	电子	2,169,417.50	0.39
C6	金属、非金属	778,720.56	0.14
C7	机械、设备、仪表	7,927,829.85	1.43
C8	医药、生物制品	5,112,332.32	0.92
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	16,331,628.02	2.95
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	4,045,738.04	0.73
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	4,414,760.07	0.80
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,559,318.04	0.28
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	49,498,908.75	8.96

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601668	中国建筑	2,605,514	12,298,026.08	2.23
2	600999	招商证券	150,213	4,414,760.07	0.80
3	601618	中国中冶	744,207	4,033,601.94	0.73
4	300026	红日药业	24,118	2,199,561.60	0.40
5	002321	华英农业	82,149	2,185,984.89	0.40
6	300024	机器人	25,175	1,819,649.00	0.33
7	601888	中国国旅	74,466	1,559,318.04	0.28
8	300029	天龙光电	47,992	1,396,567.20	0.25
9	300014	亿纬锂能	32,686	1,292,731.30	0.23
10	002304	洋河股份	9,651	1,100,117.49	0.20

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.huaan.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600219	南山铝业	95,957,569.72	3.11
2	000528	柳 工	23,091,381.27	0.75
3	601668	中国建筑	10,891,048.52	0.35

4	600227	赤天化	9,760,000.00	0.32
5	600598	北大荒	8,652,000.00	0.28
6	600368	五洲交通	8,008,586.88	0.26
7	600267	海正药业	7,089,929.28	0.23
8	600971	恒源煤电	5,860,235.75	0.19
9	600999	招商证券	4,656,603.00	0.15
10	601618	中国中冶	4,033,601.94	0.13
11	601788	光大证券	3,347,756.96	0.11
12	300026	红日药业	1,447,080.00	0.05
13	002321	华英农业	1,394,890.02	0.05
14	300024	机器人	1,001,965.00	0.03
15	002290	禾盛新材	884,206.80	0.03
16	601888	中国国旅	877,209.48	0.03
17	300029	天龙光电	872,494.56	0.03
18	300039	上海凯宝	862,752.00	0.03
19	002277	家润多	801,801.00	0.03
20	002332	仙琚制药	800,352.80	0.03

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	600219	南山铝业	93,762,834.06	3.04
2	000528	柳 工	27,486,042.48	0.89
3	600267	海正药业	8,647,549.77	0.28
4	600227	赤天化	8,136,005.15	0.26
5	600598	北大荒	7,990,546.50	0.26
6	600368	五洲交通	7,434,999.22	0.24
7	600971	恒源煤电	5,981,353.50	0.19
8	601788	光大证券	3,788,434.79	0.12
9	002290	禾盛新材	1,548,037.20	0.05
10	002285	世联地产	1,439,278.60	0.05
11	601107	四川成渝	1,411,224.40	0.05
12	002276	万马电缆	1,369,157.10	0.04
13	002277	家润多	1,188,976.18	0.04
14	002283	天润曲轴	1,071,569.90	0.03
15	002278	神开股份	1,036,258.52	0.03
16	002292	奥飞动漫	984,251.52	0.03
17	002284	亚太股份	861,677.62	0.03
18	000778	新兴铸管	784,635.40	0.03
19	002281	光迅科技	779,650.30	0.03
20	002279	久其软件	614,297.14	0.02

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：	209,078,452.32
卖出股票的收入（成交）总额：	179,229,458.26

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	68,168,298.20	12.33
2	央行票据	122,028,000.00	22.08
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	281,878,670.10	51.00
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	44,414,948.45	8.04
7	其他	-	-
8	合计	516,489,916.75	93.45

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0801023	08央票23	800,000	82,160,000.00	14.86
2	112012	09名流债	395,040	40,491,600.00	7.33
3	0901067	09央票67	400,000	39,868,000.00	7.21
4	122980	09津投3	405,290	37,691,970.00	6.82
5	110598	大荒转债	228,550	37,239,937.00	6.74

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

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

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,410.83
2	应收证券清算款	6,777,798.72
3	应收股利	-
4	应收利息	9,529,743.84
5	应收申购款	2,175,574.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,496,528.29

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110598	大荒转债	37,239,937.00	6.74
2	125960	锡业转债	3,430,691.55	0.62

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600999	招商证券	4,414,760.07	0.80	网下新股申购
2	300026	红日药业	2,199,561.60	0.40	网下新股申购
3	002321	华英农业	2,185,984.89	0.40	网下新股申购
4	300024	机器人	1,819,649.00	0.33	网下新股申购
5	601888	中国国旅	1,559,318.04	0.28	网下新股申购
6	300029	天龙光电	1,396,567.20	0.25	网下新股申购
7	300014	亿纬锂能	1,292,731.30	0.23	网下新股申购
8	002304	洋河股份	1,100,117.49	0.20	网下新股申购

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户	户均持有的基	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	数 (户)	金份额	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
华安稳定收 益债券 A	7,264	51,066.68	225,053,754.72	60.67%	145,894,597.16	39.33%
华安稳定收 益债券 B	4,669	27,843.68	9,354,875.10	7.20%	120,647,271.29	92.80%
合计	11,933	41,980.26	234,408,629.82	46.79%	266,541,868.45	53.21%

注：分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有 从业人员持有本开 放式基金	华安稳定收益债券 A	1,022.81	0.0003%
	华安稳定收益债券 B	123,212.13	0.0948%
	合计	124,234.94	0.0248%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	华安稳定收益债券 A	华安稳定收益债券 B
基金合同生效日（2008年4月30日） 基金份额总额	2,398,033,991.27	732,727,935.40
本报告期期初基金份额总额	1,802,587,817.99	1,015,447,503.78
本报告期基金总申购份额	992,674,254.43	313,547,107.20
减：本报告期基金总赎回份额	2,424,313,720.54	1,198,992,464.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	370,948,351.88	130,002,146.39

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1). 2009年1月12日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(2). 2009年2月19日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

(3). 2009 年 11 月 17 日, 本基金管理人发布关于董事长变更的公告, 经本公司董事会会议审议通过, 同意徐建国同志辞去本公司董事长职务, 并选举俞妙根同志任本公司董事长。俞妙根同志的董事长任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1144 号文核准。在公司总经理招聘工作尚未完成之前, 俞妙根同志将兼任公司总经理职务。。

(4). 2010 年 1 月 16 日, 本基金管理人发布关于关于董事变更的公告, 经本公司股东会审议通过, 选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事, 徐建国先生不再担任本公司董事。

2、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

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 85,000.00 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

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况:

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际有限责任公司	1	30,437,419.10	16.98%	25,871.53	17.16%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	499,658.88	0.28%	424.70	0.28%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	27,958,091.48	15.60%	22,715.95	15.07%	-
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	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	90,588,976.64	50.54%	76,999.18	51.07%	-
中信证券股份有限公司	1	791,283.04	0.44%	672.61	0.45%	-
长江证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	3,857,717.88	2.15%	3,134.43	2.08%	-
华泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	9,761,042.63	5.45%	7,931.00	5.26%	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	15,335,268.61	8.56%	13,034.68	8.64%	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
中银国际有限责任公司	1	91,350,348.39	6.12%	607,000,000.00	9.14%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	10,870,894.79	0.73%	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	4,517,962.19	0.30%	218,400,000.00	3.29%	-	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	38,713,741.78	2.59%	494,900,000.00	7.45%	-	-
上海证券有限责任公司	1	6,445,202.08	0.43%	150,000,000.00	2.26%	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	106,423,698.64	7.12%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	22,917,613.19	1.53%	40,000,000.00	0.60%	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	11,731,467.49	0.79%	197,400,000.00	2.97%	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-

中国国际金融有限公司	1	678,185,174.08	45.40%	4,933,200,000.00	74.29%	1,541,118.72	100.00%
中信证券股份有限公司	1	8,626,710.00	0.58%	-	-	-	-
长江证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	230,042,246.41	15.40%	-	-	-	-
华泰证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	36,199,337.74	2.42%	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	35,309,526.50	2.36%	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	212,391,714.40	14.22%	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-

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

2、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

新增交易单元：

- (1) 新增宏源证券股份有限公司深圳交易单元1个；
- (2) 新增中山证券有限责任公司深圳交易单元1个；
- (3) 新增上海证券有限责任公司上海交易单元1个；
- (4) 新增国信证券股份有限公司上海交易单元1个；
- (5) 新增中国银河证券股份有限公司上海交易单元1个。

退租交易单元：无。

3、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

3、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部/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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

- 1、2009 年 1 月 16 日，本托管人公告本行聘请胡哲一先生担任本行副行长；
- 2、2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 3、2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 4、2009 年 5 月 26 日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 5、2009 年 8 月 2 日，本托管人公告，自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任本行执行董事。
- 6、2009 年 9 月 27 日，本托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。
- 7、2009 年 10 月 11 日，本托管人发布关于控股股东增持本行股份的公告。

华安基金管理有限公司
2010 年 3 月 29 日