

# 华安稳固收益债券型证券投资基金

## 2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

## § 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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

|     |                                     |    |
|-----|-------------------------------------|----|
| § 1 | 重要提示及目录                             | 1  |
| 1.1 | 重要提示                                | 1  |
| 2   | 基金简介                                | 4  |
| 2.1 | 基金基本情况                              | 4  |
| 2.2 | 基金产品说明                              | 4  |
| 2.3 | 基金管理人和基金托管人                         | 5  |
| 2.4 | 信息披露方式                              | 5  |
| 2.5 | 其他相关资料                              | 5  |
| 3   | 主要财务指标和基金净值表现                       | 5  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标                         | 5  |
| 3.2 | 基金净值表现                              | 6  |
| 4   | 管理人报告                               | 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遵规守信情况的说明              | 9  |
| 4.3 | 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 9  |
| 4.4 | 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明              | 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 | 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11 |
| 4.7 | 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13 |
| 5   | 托管人报告                               | 13 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明                  | 13 |
| 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 | 14 |
| 5.3 | 托管人对本半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   | 半年度财务会计报告（未经审计）                     | 14 |
| 6.1 | 资产负债表                               | 14 |
| 6.2 | 利润表                                 | 15 |
| 6.3 | 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17 |
| 6.4 | 报表附注                                | 17 |
| 7   | 投资组合报告                              | 35 |
| 7.1 | 期末基金资产组合情况                          | 35 |
| 7.2 | 期末按行业分类的股票投资组合                      | 36 |
| 7.3 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细       | 37 |
| 7.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 37 |
| 7.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 38 |
| 7.6 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细      | 39 |
| 7.7 | 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细   | 39 |
| 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      | 39 |
| 7.9 | 投资组合报告附注                            | 39 |
| 8   | 基金份额持有人信息                           | 40 |
| 8.1 | 期末基金份额持有人户数及持有人结构                   | 40 |
| 8.2 | 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况             | 40 |
| 9   | 开放式基金份额变动                           | 40 |
| 10  | 重大事件揭示                              | 41 |

|      |                                  |    |
|------|----------------------------------|----|
| 10.1 | 基金份额持有人大会决议.....                 | 41 |
| 10.2 | 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 41 |
| 10.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....      | 41 |
| 10.4 | 基金投资策略的改变.....                   | 41 |
| 10.5 | 报告期内改聘会计师事务所情况.....              | 41 |
| 10.6 | 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....    | 41 |
| 10.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....           | 42 |
| 10.8 | 其他重大事件.....                      | 46 |
| 11   | 备查文件目录.....                      | 47 |
| 11.1 | 备查文件目录.....                      | 47 |
| 11.2 | 存放地点.....                        | 47 |
| 11.3 | 查阅方式.....                        | 47 |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                   |
|------------|-------------------|
| 基金名称       | 华安稳固收益债券型证券投资基金   |
| 基金简称       | 华安稳固收益债券          |
| 基金主代码      | 040019            |
| 交易代码       | 040019            |
| 基金运作方式     | 契约型开放式            |
| 基金合同生效日    | 2010年12月21日       |
| 基金管理人      | 华安基金管理有限公司        |
| 基金托管人      | 中国工商银行股份有限公司      |
| 报告期末基金份额总额 | 1,422,982,550.29份 |
| 基金合同存续期    | 不定期               |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在追求本金长期安全的基础上，力争为基金份额持有人创造高于比较基准收益的当期收益。  |
| 投资策略   | 本基金建立逐期追求投资本金安全的风险控制目标和收益稳定递增的产品运作风格，以“3年运作周期滚动”的方式，实施开放式运作。在3年运作期内，本基金通过适当的投资策略和产品机制，增强对组合流动性的保护，以便于本基金达到避险目标，并力争超越业绩比较基准，优化基金组合的风险收益和流动性，从而力求满足投资人持续稳定地获得高于存款利率收益的需求。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准=3 年期银行定期存款收益率+1.68%  |
| 风险收益特征 | 本基金属于证券投资基金中较低风险的品种，其预期的风险水平和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。   |

### 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目      |      | 基金管理人                                     | 基金托管人                 |
|---------|------|---|-----------------------|
| 名称      |      | 华安基金管理有限公司                                | 中国工商银行股份有限公司          |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 冯颖  | 赵会军                   |
|         | 联系电话 | 021-38969999                              | 010-66105799          |
|         | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn                     | custody@icbc.com.cn   |
| 客户服务电话  |      | 4008850099                                | 95588                 |
| 传真      |      | 021-68863414                              | 010-66105798          |
| 注册地址    |      | 上海市浦东南路 360 号<br>新上海国际大厦 38 楼             | 北京市西城区复兴门内<br>大街 55 号 |
| 办公地址    |      | 上海市浦东南路 360 号<br>新上海国际大厦 2 楼、37<br>楼、38 楼 | 北京市西城区复兴门内<br>大街 55 号 |
| 邮政编码    |      | 200120                                    | 100140                |
| 法定代表人   |      | 李勃  | 姜建清                   |

### 2.4 信息披露方式

|                          |                           |
|--------------------------|---------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称           | 中国证券报、上海证券报、证券时报          |
| 登载基金半年度报告正文的<br>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     | 名称         | 办公地址                                   |
|--------|------------|--|
| 注册登记机构 | 华安基金管理有限公司 | 上海市浦东南路 360 号新上海<br>国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼 |

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益       | 46,387,088.10                        |

|                      |                         |
|----------------------|-------------------------|
| 本期利润                 | 44,837,655.14           |
| 加权平均基金份额本期利润         | 0.0232                  |
| 本期加权平均净值利润率          | 2.29%                   |
| 本期基金份额净值增长率          | 2.3%                    |
| <b>3.1.2 期末数据和指标</b> | <b>报告期末(2011年6月30日)</b> |
| 期末可供分配利润             | 33,801,435.08           |
| 期末可供分配基金份额利润         | 0.0238                  |
| 期末基金资产净值             | 1,456,783,985.37        |
| 期末基金份额净值             | 1.024                   |
| <b>3.1.3 累计期末指标</b>  | <b>报告期末(2011年6月30日)</b> |
| 基金份额累计净值增长率          | 2.40%                   |

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

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

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

4、本基金于 2010 年 12 月 21 日成立，截至本报告期末，本基金未满一个完整年度。

### 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   |
|----------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月    | 0.00%    | 0.08%       | 0.45%      | 0.01%         | -0.45% | 0.07% |
| 过去三个月    | 0.99%    | 0.08%       | 1.38%      | 0.01%         | -0.39% | 0.07% |
| 过去六个月    | 2.30%    | 0.07%       | 2.74%      | 0.02%         | -0.44% | 0.05% |
| 自基金成立起至今 | 2.40%    | 0.07%       | 2.91%      | 0.02%         | -0.51% | 0.05% |

注：本基金业绩比较基准为：3 年期银行定期存款收益率+1.68%

根据本基金合同的有关规定，本基金为债券型基金，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国债、金融债、企业（公司）债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、资产支持证券、央行票据、短期融资券、债券回购、银行

存款等固定收益证券品种；本基金还可投资于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。

本基金投资组合的资产配置范围为：债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的 80%，权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金权益类资产投资主要进行首次发行以及增发新股投资，并持有因在一级市场申购所形成的股票以及因可转债转股所形成的股票，不直接从二级市场买入股票、权证等权益类资产。本基金还可以持有股票所派发的权证和可分离债券产生的权证。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金的债券类资产的投资比例为基金资产净值的 126.85%，投资于股票等权益类资产的比例为基金资产净值的 0%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的 7.13%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

### 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

华安稳固收益债券型证券投资基金

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

(2010 年 12 月 21 日至 2011 年 6 月 30 日)



注：本基金于 2010 年 12 月 21 日成立，截至报告期末本基金成立未满一年。根据《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金应自基金合同生效日起 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）投资范围的有关规定。截至报告期末本基金基金合同生效已满 6 个月，基金的投资组合比例符合基金合同



的有关规定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、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、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、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、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安大中华升级股票等 22 只开放式基金，管理资产规模达到 755.14 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 |        |   |
| 郑可成 | 本基金的基金经理 | 2010-12-21      | -    | 10 年   | 硕士研究生，10 年证券投资基金从业经历。2001 年 7 月至 2004 年 12 月在闽发证券有限责任公司担任研究员，从事债券研究及投资，2005 年 1 月至 2005 年 9 月在福建儒林投资顾问有限公司任研究员， |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 2005 年 10 月至 2009 年 7 月在益民基金管理有限公司任基金经理, 2009 年 8 月至今任职于华安基金管理有限公司固定收益部。<br>2010 年 12 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。

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《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安稳固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”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，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》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察，分别于每季度和每年

度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

#### 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

按照本基金的基金合同规定，本基金的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说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年宏观经济增速逐渐回落，但内需保持强劲，通胀水平却大幅上升，宏观经济呈现小滞胀的局面。为稳定物价、使货币条件正常化，央行逐月提高法定存款准备金率，两次提高存贷款利率，并对信贷增速进行了严格限制。同时国务院再次出台房地产调控政策，严格限制地产炒作。

在此背景下，债券市场的资金面波动剧烈。一月份受到巨额信贷投放与央行回收货币的双重影响，资金面严重受压，银行间资金利率上涨至近三年来最高水平，债券收益率曲线迅速平坦化。春节后由于信贷投放减少并且央行公开市场注入货币，资金面重现宽松局面，资金利率回落。六月份在半年结算等季节性因素作用下，资金利率重新上升至年内高点。受此影响债券市场总体上呈现熊市特点，收益曲线较年初平坦化上移，信用产品受到信用事件冲击利率上升至历史高位。与此同时股票市场在一季度完成大小盘风格转化后，二季度受到货币政策和经济数据的影响，出现较大的调整。可转债市场受正股影响先涨后跌，总体收益为负。

本基金较好的预期央行政策的力度和节奏，以及银行间市场的资金利率波动。年初在资金利率高企的时期，一方面融出资金获得高额回报，一方面在债券收益率上行过程中逐渐建仓，较好的控制了利率风险，并在利率下行的时期获得了较好的收益。在一季度积极参与可转债市场操作，建仓于新发转债以及低估值的银行转债，获得了正收益。二季度在股票市场调整前较早的减持了权益类的仓位，避免了转债市场下跌带来的损失。同时本基金在债券方面也较早进行了减持，主动降低了杠杆率，

为资金紧张期提前储备了流动性。但由于 6 月底遭到较大赎回压力, 整体债券持仓比例仍有所上升。通过积极的主动性调整, 本基金在上半年基本保持了净值的稳定增长。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日, 本基金份额净值为 1.024 元, 本报告期净值增长率 2.30%, 同期业绩比较基准收益率为 2.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年, 通胀仍然处于高位但总体上呈现逐步回落的趋势。预期货币政策在总体上仍将保持紧缩的格局, 但力度将会减轻, 节奏将会放缓。加息和上调存款准备金进入尾声, 但不能断言已经结束。宏观经济层面难有亮点, 经济增速将温和下降, 总需求逐渐萎缩。在此背景下, 债券市场面临的宏观和政策面环境将优于二季度, 资金面将会较二季度末逐渐宽松, 市场将会出现结构性机会。股票市场预期将维持震荡局面, 权重板块难有作为, 但结构性机会仍然存在。本基金仍将从绝对收益的角度出发, 关注短期限高收益的品种, 并进一步调整持仓结构, 把握市场波动的机会。可转债市场三季度预期将恢复供给, 我们在转债方面重点将参与一级市场机会。另外我们对代表着经济转型方向的新兴产业的新股保持关注, 把握其中的低估值品种的机会。本基金将秉承稳健、专业的投资理念, 勤勉尽责地维护持有人的利益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 1、估值政策及重大变化

无。

##### 2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

### (1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、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：

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首席投资官。

李炳旺先生，研究生学历，24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在鹏华证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，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。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，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、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接的基金经理，金融工程部总经理。

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

本基金的基金经理未参与基金的估值。

## 5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

## 6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

# 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

2011 年上半年，本基金托管人在对华安稳固收益债券型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2011 年上半年，华安稳固收益债券型证券投资基金的管理人—华安基金管理有限公司在华安稳固收益债券型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，华安稳固收益债券型证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的华安稳固收益债券型证券投资基金 2011 年度半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

# 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：华安稳固收益债券型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产       | 附注号     | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2010 年 12 月 31 日 |
|----------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产：      |         |                        |                          |
| 银行存款     | 6.4.7.1 | 4,107,449.66           | 9,968,592.55             |
| 结算备付金    |         | 4,929,346.73           | -                        |
| 存出保证金    |         | 238,820.42             | -                        |
| 交易性金融资产  | 6.4.7.2 | 1,847,953,047.00       | 7,842,859.50             |
| 其中：股票投资  |         | 16,060.00              | 135,850.00               |
| 基金投资     |         | -                      | -                        |
| 债券投资     |         | 1,847,936,987.00       | 7,707,009.50             |
| 资产支持证券投资 |         | -                      | -                        |

|                 |            |                           |                             |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 衍生金融资产          |            | -                         | -                           |
| 买入返售金融资产        |            | -                         | 2,710,000,000.00            |
| 应收证券清算款         |            | 10,320,000.00             | 7,166,991.64                |
| 应收利息            | 6.4.7.3    | 32,912,933.44             | 2,513,621.99                |
| 应收股利            |            | -                         | -                           |
| 应收申购款           |            | 549,291.46                | -                           |
| 递延所得税资产         |            | -                         | -                           |
| 其他资产            |            | -                         | -                           |
| 资产总计            |            | 1,901,010,888.71          | 2,737,492,065.68            |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2011年6月30日</b> | <b>上年度末<br/>2010年12月31日</b> |
| 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       |            | 437,199,370.90            | -                           |
| 应付证券清算款         |            | -                         | -                           |
| 应付赎回款           |            | 4,792,309.41              | -                           |
| 应付管理人报酬         |            | 836,144.88                | 487,027.10                  |
| 应付托管费           |            | 231,547.81                | 134,869.03                  |
| 应付销售服务费         |            | 450,231.87                | 262,245.35                  |
| 应付交易费用          | 6.4.7.4    | 8,190.39                  | -                           |
| 应交税费            |            | 272,000.00                | -                           |
| 应付利息            |            | 267,636.58                | -                           |
| 应付利润            |            | -                         | -                           |
| 递延所得税负债         |            | -                         | -                           |
| 其他负债            | 6.4.7.5    | 169,471.50                | -                           |
| 负债合计            |            | 444,226,903.34            | 884,141.48                  |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                           |                             |
| 实收基金            | 6.4.7.6    | 1,422,982,550.29          | 2,733,751,055.10            |
| 未分配利润           | 6.4.7.7    | 33,801,435.08             | 2,856,869.10                |
| 所有者权益合计         |            | 1,456,783,985.37          | 2,736,607,924.20            |
| 负债和所有者权益总计      |            | 1,901,010,888.71          | 2,737,492,065.68            |

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额总额 1,422,982,550.29 份，份额净值 1.024 元

## 6.2 利润表

会计主体：华安稳固收益债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日



单位：人民币元

| 项目                         | 附注号        | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|------------|---------------------------------------|
| <b>一、收入</b>                |            | <b>60,924,990.54</b>                  |
| 1. 利息收入                    |            | 40,025,152.68                         |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.8    | 850,964.23                            |
| 债券利息收入                     |            | 26,213,524.32                         |
| 资产支持证券利息收入                 |            | -                                     |
| 买入返售金融资产收入                 |            | 12,960,664.13                         |
| 其他利息收入                     |            | -                                     |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）          |            | 9,112,923.28                          |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.9    | 51,331.50                             |
| 基金投资收益                     |            | -                                     |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.10   | 9,061,591.78                          |
| 资产支持证券投资                   |            | -                                     |
| 收益                         |            | -                                     |
| 衍生工具收益                     |            | -                                     |
| 股利收益                       |            | -                                     |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.11   | -1,549,432.96                         |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）         |            | -                                     |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）         | 6.4.7.12   | 13,336,347.54                         |
| <b>减：二、费用</b>              |            | <b>16,087,335.40</b>                  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 6,423,525.87                          |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 1,778,822.55                          |
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | 3,458,821.69                          |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.13   | 34,946.43                             |
| 5. 利息支出                    |            | 4,194,099.80                          |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | 4,194,099.80                          |
| 6. 其他费用                    | 6.4.7.14   | 197,119.06                            |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>44,837,655.14</b>                  |
| 减：所得税费用                    |            | -                                     |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>44,837,655.14</b>                  |

注：本基金 2010 年 12 月 21 日成立，因此无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安稳固收益债券型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |                |                   |
|--|---------------------------------------|----------------|-------------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润          | 所有者权益合计           |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 2,733,751,055.10                      | 2,856,869.10   | 2,736,607,924.20  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | 44,837,655.14  | 44,837,655.14     |
| 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）      | -1,310,768,504.81                     | -13,893,089.16 | -1,324,661,593.97 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 516,050,366.07                        | 9,036,677.45   | 525,087,043.52    |
| 2. 基金赎回款                               | -1,826,818,870.88                     | -22,929,766.61 | -1,849,748,637.49 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -                                     | -              | -                 |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 1,422,982,550.29                      | 33,801,435.08  | 1,456,783,985.37  |

注：本基金 2011 年 12 月 21 日成立，因此无上年度可比数据。

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：李炳旺，会计机构负责人：

陈林

### 6.4 报表附注

#### 6.4.1 基金基本情况

华安稳固收益债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）由华安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）依照有关法律法规及约定发起，并经中国证券监督

管理委员会（以下简称“中国证监会”）2010 年 10 月 8 日《关于核准华安稳固收益债券型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2010]1362 号）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《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,733,434,332.77 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(2010)第 327 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,733,751,055.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 316,722.33 份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金对债券等固定收益品种的投资比例不低于基金资产的 80%，权益类资产的投资比例不高于基金资产的 20%，现金和到期日不超过一年的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。本基金还可投资于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 2011 年 8 月 26 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》、《华安稳固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所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 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。

###### (2) 金融负债的分类

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

##### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 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。

(2) 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。

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬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。

#### 6.4.4.11 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参见本基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 重要会计估计及其关键假设

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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，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。

(b) 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。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21

号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券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责任公司独立提供。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 6.4.5.3 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》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收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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|



|      |              |
|------|--------------|
| 活期存款 | 4,107,449.66 |
| 定期存款 | -            |
| 其他存款 | -            |
| 合计   | 4,107,449.66 |

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目     |       | 本期末<br>2011年6月30日 |                  |               |
|--------|-------|-------------------|------------------|---------------|
|        |       | 成本                | 公允价值             | 公允价值变动        |
| 股票     |       | 12,865.00         | 16,060.00        | 3,195.00      |
| 债券     | 交易所市场 | 529,887,797.16    | 529,098,987.00   | -788,810.16   |
|        | 银行间市场 | 1,319,529,066.56  | 1,318,838,000.00 | -691,066.56   |
|        | 合计    | 1,849,416,863.72  | 1,847,936,987.00 | -1,479,876.72 |
| 资产支持证券 |       | -                 | -                | -             |
| 基金     |       | -                 | -                | -             |
| 其他     |       | -                 | -                | -             |
| 合计     |       | 1,849,429,728.72  | 1,847,953,047.00 | -1,476,681.72 |

#### 6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2011年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 9,141.18          |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 1,996.38          |
| 应收债券利息     | 32,894,665.55     |
| 应收买入返售证券利息 | -                 |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 其他         | 7,130.33          |
| 合计         | 32,912,933.44     |

#### 6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 447.53            |
| 银行间市场应付交易费用 | 7,742.86          |
| 合计          | 8,190.39          |

**6.4.7.5 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2011 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 1,365.94               |
| 应付后端申购费     | -                      |
| 债券利息税       | -                      |
| 预提费用        | 168,105.56             |
| 银行手续费       | -                      |
| 合计          | 169,471.50             |

**6.4.7.6 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |                   |
|---------------|---------------------------------------|-------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额              |
| 上年度末          | 2,733,751,055.10                      | 2,733,751,055.10  |
| 本期申购          | 516,050,366.07                        | 516,050,366.07    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,826,818,870.88                     | -1,826,818,870.88 |
| 本期末           | 1,422,982,550.29                      | 1,422,982,550.29  |

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

**6.4.7.7 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           | 2,784,117.86   | 72,751.24     | 2,856,869.10   |
| 本期利润           | 46,387,088.10  | -1,549,432.96 | 44,837,655.14  |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -13,197,095.77 | -695,993.39   | -13,893,089.16 |
| 其中：基金申购款       | 8,590,568.90   | 446,108.55    | 9,036,677.45   |
| 基金赎回款          | -21,787,664.67 | -1,142,101.94 | -22,929,766.61 |
| 本期已分配利润        | -              | -             | -              |
| 本期末            | 35,974,110.19  | -2,172,675.11 | 33,801,435.08  |

**6.4.7.8 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目       | 本期<br>2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日 |
|----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 757,632.97                            |

|           |            |
|-----------|------------|
| 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 | 77,373.49  |
| 其他        | 15,957.77  |
| 合计        | 850,964.23 |

#### 6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 卖出股票成交总额   | 2,299,071.50         |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,247,740.00         |
| 买卖股票差价收入   | 51,331.50            |

#### 6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

| 项目                     | 本期                   |
|------------------------|----------------------|
|                        | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额   | 1,169,599,939.06     |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,145,695,176.26     |
| 减：应收利息总额               | 14,843,171.02        |
| 债券投资收益                 | 9,061,591.78         |

#### 6.4.7.11 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -1,549,432.96        |
| ——股票投资     | 3,195.00             |
| ——债券投资     | -1,552,627.96        |
| ——资产支持证券投资 | -                    |
| ——基金投资     | -                    |
| 2. 衍生工具    | -                    |
| ——权证投资     | -                    |
| 3. 其他      | -                    |
| 合计         | -1,549,432.96        |

#### 6.4.7.12 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                   |
|---------|----------------------|
|         | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | 13,336,347.54        |

|    |               |
|----|---------------|
| 合计 | 13,336,347.54 |
|----|---------------|

注：1、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。

2、基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

#### 6.4.7.13 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 21,471.43                  |
| 银行间市场交易费用 | 13,475.00                  |
| 合计        | 34,946.43                  |

#### 6.4.7.14 其他费用

单位：人民币元

| 项目     | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |
|--------|----------------------------|
| 审计费用   | 49,092.63                  |
| 信息披露费  | 119,012.93                 |
| 银行汇划费用 | 23,613.50                  |
| 帐户维护费  | 4,500.00                   |
| 其他费用   | 900.00                     |
| 合计     | 197,119.06                 |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称                | 与本基金的关系               |
|----------------------|-----------------------|
| 华安基金管理有限公司（“华安基金”）   | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人、基金代销机构          |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                   |
|-----------------|----------------------|
|                 | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 6,423,525.87         |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,674,553.73         |

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 0.65% 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 × 0.65% / 当年天数。

本基金成立于 2010 年 12 月 21 日，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,778,822.55         |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.18% 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 × 0.18% / 当年天数。

本基金成立于 2010 年 12 月 21 日，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                   |
|----------------|----------------------|
|                | 2011年1月1日至2011年6月30日 |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费     |
| 华安基金管理有限公司     | 1,383,147.22         |

|              |              |
|--------------|--------------|
| 中国工商银行股份有限公司 | 921,996.44   |
| 合计           | 2,305,143.66 |

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的销售服务费按前一日基金资产净值 0.35% 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：

销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

本基金成立于 2010 年 12 月 21 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称        | 本期<br>2011年1月1日至2011年6月30日 |            |
|--------------|----------------------------|------------|
|              | 期末余额                       | 当期利息收入     |
| 中国工商银行股份有限公司 | 4,107,449.66               | 757,632.97 |

注：本基金成立于 2010 年 12 月 21 日，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 179,399,370.90 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<br>单价 | 数量（张）     | 期末估值<br>总额     |
|--------|-------------|------------|------------|-----------|----------------|
| 110214 | 11国开14      | 2011-07-04 | 98.68      | 500,000   | 49,340,000.00  |
| 098010 | 09淮南矿业<br>债 | 2011-07-05 | 99.69      | 1,000,000 | 99,690,000.00  |
| 110211 | 11国开11      | 2011-07-06 | 99.01      | 300,000   | 29,703,000.00  |
| 合计     |             |            |            | 1,800,000 | 178,733,000.00 |

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2011 年 6 月 30 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 257,800,000.00 元，分别于 2011 年 7 月 1 日、2011 年 7 月 5 日、2011 年 7 月 6 日、2011 年 7 月 7 日到期。该类交易要求本基金在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只债券型证券投资基金，属于较高流动性、低风险的品种。本基金投资的金融工具主要为债券投资。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2011年6月30日 | 上年末<br>2010年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| A-1    | 820,392,000.00    | -                  |
| A-1 以下 | -                 | -                  |
| 未评级    | 89,724,000.00     | -                  |
| 合计     | 910,116,000.00    | -                  |

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2011年6月30日 | 上年末<br>2010年12月31日 |
|--------|-------------------|--------------------|
| AAA    | 60,441,300.00     | 0.00               |
| AAA 以下 | 689,248,687.00    | 7,707,009.50       |
| 未评级    | 188,131,000.00    | -                  |
| 合计     | 937,820,987.00    | 7,707,009.50       |

注：未评级债券为国债、央票及政策性金融债。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎



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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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。

除卖出回购金融资产款到期日为一个半月以内且计息外，本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2011年6月30日 | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计           |
|-------------------|--------------|------|------|-----|--------------|
| 资产                |              |      |      |     |              |
| 银行存款              | 4,107,449.66 | -    | -    | -   | 4,107,449.66 |
| 结算备付金             | 4,929,346.73 | -    | -    | -   | 4,929,346.73 |
| 存出保证金             | 238,820.42   | -    | -    | -   | 238,820.42   |

|                 |                  |                |                |               |                  |
|-----------------|------------------|----------------|----------------|---------------|------------------|
| 交易性金融资产         | 910,116,000.00   | 556,166,987.00 | 381,654,000.00 | 16,060.00     | 1,847,953,047.00 |
| 应收证券清算款         | -                | -              | -              | 10,320,000.00 | 10,320,000.00    |
| 应收利息            | -                | -              | -              | 32,912,933.44 | 32,912,933.44    |
| 应收申购款           | -                | -              | -              | 549,291.46    | 549,291.46       |
| 资产总计            | 919,391,616.81   | 556,166,987.00 | 381,654,000.00 | 43,798,284.90 | 1,901,010,888.71 |
| 负债              |                  |                |                |               |                  |
| 卖出回购金融资产款       | 437,199,370.90   | -              | -              | -             | 437,199,370.90   |
| 应付赎回款           | -                | -              | -              | 4,792,309.41  | 4,792,309.41     |
| 应付管理人报酬         | -                | -              | -              | 836,144.88    | 836,144.88       |
| 应付托管费           | -                | -              | -              | 231,547.81    | 231,547.81       |
| 应付销售服务费         | -                | -              | -              | 450,231.87    | 450,231.87       |
| 应付交易费用          | -                | -              | -              | 8,190.39      | 8,190.39         |
| 应交税费            | -                | -              | -              | 272,000.00    | 272,000.00       |
| 其他负债            | -                | -              | -              | 169,471.50    | 169,471.50       |
| 应付证券清算款         | -                | -              | -              | -             | -                |
| 应付利息            | -                | -              | -              | 267,636.58    | 267,636.58       |
| 负债总计            | -                | -              | -              | 7,027,532.44  | 7,027,532.44     |
| 利率敏感度缺口         | 919,391,616.81   | 556,166,987.00 | 381,654,000.00 | 36,770,752.46 | 1,893,983,356.27 |
| 上年度末2010年12月31日 | 1年以内             | 1-5年           | 5年以上           | 不计息           | 合计               |
| 资产              |                  |                |                |               |                  |
| 银行存款            | 9,968,592.55     | -              | -              | -             | 9,968,592.55     |
| 交易性金融资产         | -                | 7,705,920.00   | 1,089.50       | 135,850.00    | 7,842,859.50     |
| 应收证券清算款         | -                | -              | -              | 7,166,991.64  | 7,166,991.64     |
| 应收利息            | -                | -              | -              | 2,513,621.99  | 2,513,621.99     |
| 买入返售金融资产        | 2,710,000,000.00 | -              | -              | -             | 2,710,000,000.00 |
| 资产总计            | 2,719,968,592.55 | 7,705,920.00   | 1,089.50       | 9,816,463.63  | 2,737,492,065.68 |
| 负债              |                  |                |                |               |                  |
| 应付管理人报酬         | -                | -              | -              | 487,027.10    | 487,027.10       |
| 应付托管费           | -                | -              | -              | 134,869.03    | 134,869.03       |
| 应付销售服务费         | -                | -              | -              | 262,245.35    | 262,245.35       |
| 应付交易费用          | -                | -              | -              | -             | -                |

|         |                  |              |          |              |                  |
|---------|------------------|--------------|----------|--------------|------------------|
| 应交税费    | -                | -            | -        | -            | -                |
| 其他负债    | -                | -            | -        | -            | -                |
| 应付证券清算款 | -                | -            | -        | -            | -                |
| 应付利息    | -                | -            | -        | -            | -                |
| 负债总计    | -                | -            | -        | 884,141.48   | 884,141.48       |
| 利率敏感度缺口 | 2,719,968,592.55 | 7,705,920.00 | 1,089.50 | 8,932,322.15 | 2,736,607,924.20 |

注：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予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 |                            |                     |
|----|--------------------|----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动          | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币） |                     |
|    |                    | 本期末<br>2011年6月30日          | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|    | 市场利率上升25个基点        | 增加约1,394万元                 | -                   |
|    | 市场利率下降25个基点        | 减少约1,387万元                 | -                   |

注：于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.28%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中债券类资产的投资比例不低于基金资产的 80%。持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2011年6月30日 |               | 上年度末<br>2010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 | 16,060.00         | 0.00          | 135,850.00          | 0.00          |
| 衍生金融资产-权证投资  | -                 | -             | -                   | -             |
| 其他           | -                 | -             | -                   | -             |
| 合计           | 16,060.00         | 0.00          | 135,850.00          | 0.00          |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 |                             |                     |
|----|----------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币) |                     |
|    |                      | 本期末<br>2011年6月30日           | 上年度末<br>2010年12月31日 |
|    | 业绩比较基准上升5%           | 增加约393万元                    | -                   |
|    | 业绩比较基准下降5%           | 减少约393万元                    | -                   |

注：于 2010 年 12 月 31 日，本基金成立尚未满一年，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金资产净值的影响。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 16,060.00        | 0.00          |
|    | 其中：股票             | 16,060.00        | 0.00          |
| 2  | 固定收益投资            | 1,847,936,987.00 | 97.21         |
|    | 其中：债券             | 1,847,936,987.00 | 97.21         |
|    | 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      | 9,036,796.39     | 0.48          |
| 6  | 其他各项资产            | 44,021,045.32    | 2.32          |
| 7  | 合计                | 1,901,010,888.71 | 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       | -         | -             |
| B   | 采掘业            | -         | -             |
| C   | 制造业            | 16,060.00 | 0.00          |
| C0  | 食品、饮料          | -         | -             |
| C1  | 纺织、服装、皮毛       | -         | -             |
| C2  | 木材、家具          | -         | -             |
| C3  | 造纸、印刷          | -         | -             |
| C4  | 石油、化学、塑胶、塑料    | 16,060.00 | 0.00          |
| C5  | 电子             | -         | -             |
| C6  | 金属、非金属         | -         | -             |
| C7  | 机械、设备、仪表       | -         | -             |
| C8  | 医药、生物制品        | -         | -             |
| C99 | 其他制造业          | -         | -             |
| D   | 电力、煤气及水的生产和供应业 | -         | -             |
| E   | 建筑业            | -         | -             |
| F   | 交通运输、仓储业       | -         | -             |
| G   | 信息技术业          | -         | -             |
| H   | 批发和零售贸易        | -         | -             |
| I   | 金融、保险业         | -         | -             |

|   |         |           |      |
|---|---------|-----------|------|
| J | 房地产业    | -         | -    |
| K | 社会服务业   | -         | -    |
| L | 传播与文化产业 | -         | -    |
| M | 综合类     | -         | -    |
|   | 合计      | 16,060.00 | 0.00 |

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 300237 | 美晨科技 | 500   | 16,060.00 | 0.00         |

### 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  | 601558 | 华锐风电 | 270,000.00 | 0.01           |
| 2  | 601216 | 内蒙君正 | 175,000.00 | 0.01           |
| 3  | 300171 | 东富龙  | 172,000.00 | 0.01           |
| 4  | 002545 | 东方铁塔 | 138,215.00 | 0.01           |
| 5  | 601208 | 东材科技 | 120,000.00 | 0.00           |
| 6  | 002563 | 森马服饰 | 100,500.00 | 0.00           |
| 7  | 002572 | 宁基股份 | 86,000.00  | 0.00           |
| 8  | 601616 | 广电电气 | 57,000.00  | 0.00           |
| 9  | 300185 | 通裕重工 | 50,000.00  | 0.00           |
| 10 | 002582 | 好想你  | 46,000.00  | 0.00           |
| 11 | 002573 | 国电清新 | 45,000.00  | 0.00           |
| 12 | 601799 | 星宇股份 | 42,480.00  | 0.00           |
| 13 | 300183 | 东软载波 | 41,450.00  | 0.00           |
| 14 | 002577 | 雷柏科技 | 38,000.00  | 0.00           |
| 15 | 601700 | 风范股份 | 35,000.00  | 0.00           |
| 16 | 300160 | 秀强股份 | 35,000.00  | 0.00           |
| 17 | 002539 | 新都化工 | 33,880.00  | 0.00           |
| 18 | 002546 | 新联电子 | 33,800.00  | 0.00           |
| 19 | 002574 | 明牌珠宝 | 32,000.00  | 0.00           |
| 20 | 002550 | 千红制药 | 32,000.00  | 0.00           |

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  | 601558 | 华锐风电 | 230,624.00 | 0.01           |
| 2  | 601216 | 内蒙君正 | 183,097.00 | 0.01           |
| 3  | 300171 | 东富龙  | 183,011.00 | 0.01           |
| 4  | 002545 | 东方铁塔 | 143,105.00 | 0.01           |
| 5  | 601208 | 东材科技 | 127,200.00 | 0.00           |
| 6  | 002563 | 森马服饰 | 91,500.00  | 0.00           |
| 7  | 002572 | 宁基股份 | 78,310.00  | 0.00           |
| 8  | 601616 | 广电电气 | 55,290.00  | 0.00           |
| 9  | 002582 | 好想你  | 52,550.00  | 0.00           |
| 10 | 300185 | 通裕重工 | 50,200.00  | 0.00           |
| 11 | 300159 | 新研股份 | 45,150.00  | 0.00           |
| 12 | 300183 | 东软载波 | 44,700.00  | 0.00           |
| 13 | 601799 | 星宇股份 | 44,005.00  | 0.00           |
| 14 | 002546 | 新联电子 | 43,010.00  | 0.00           |
| 15 | 601118 | 海南橡胶 | 40,180.00  | 0.00           |
| 16 | 002550 | 千红制药 | 37,150.00  | 0.00           |
| 17 | 002573 | 国电清新 | 37,040.00  | 0.00           |
| 18 | 300156 | 天立环保 | 33,650.00  | 0.00           |
| 19 | 300157 | 恒泰艾普 | 32,560.00  | 0.00           |
| 20 | 300175 | 朗源股份 | 31,980.00  | 0.00           |

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 | 2,124,755.00 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 2,299,071.50 |

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      | 19,781,000.00    | 1.36   |
| 2 | 央行票据      | 39,700,000.00    | 2.73   |
| 3 | 金融债券      | 198,374,000.00   | 13.62  |
|   | 其中：政策性金融债 | 198,374,000.00   | 13.62  |
| 4 | 企业债券      | 769,689,987.00   | 52.83  |
| 5 | 企业短期融资券   | 820,392,000.00   | 56.32  |
| 6 | 中期票据      | -                | -      |
| 7 | 可转债       | -                | -      |
| 8 | 其他        | -                | -      |
| 9 | 合计        | 1,847,936,987.00 | 126.85 |

### 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  | 098010  | 09 淮南矿业债    | 1,400,000 | 139,566,000.00 | 9.58         |
| 2  | 1081345 | 10 包钢集 CP01 | 1,000,000 | 100,010,000.00 | 6.87         |
| 3  | 110211  | 11 国开 11    | 1,000,000 | 99,010,000.00  | 6.80         |
| 4  | 122033  | 09 富力债      | 900,000   | 93,906,000.00  | 6.45         |
| 5  | 122821  | 11 吉城建      | 800,000   | 81,920,000.00  | 5.62         |

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

无。

### 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

无。

### 7.9 投资组合报告附注

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

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



### 7.9.3 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   | 238,820.42    |
| 2  | 应收证券清算款 | 10,320,000.00 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 32,912,933.44 |
| 5  | 应收申购款   | 549,291.46    |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 44,021,045.32 |

### 7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转债。

### 7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限。

## 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>比例 | 持有份额           | 占总份额<br>比例 |
| 14,846       | 95,849.56     | 540,405,016.50 | 37.98%     | 882,577,533.79 | 62.02%     |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

| 项目                   | 持有份额总数（份）  | 占基金总份额比例 |
|----------------------|------------|----------|
| 基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金 | 662,967.88 | 0.047%   |

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                       |                  |
|-----------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2010年12月21日）基 | 2,733,751,055.10 |
|-----------------------|------------------|

|               |                  |
|---------------|------------------|
| 基金份额总额        |                  |
| 本报告期期初基金份额总额  | 2,733,751,055.10 |
| 本报告期基金总申购份额   | 516,050,366.07   |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,826,818,870.88 |
| 本报告期基金拆分变动份额  | -                |
| 本报告期期末基金份额总额  | 1,422,982,550.29 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内无基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 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 |    |
| 中天证券有限责任公司     | 1      | 700,198.50 | 30.46%       | 568.90    | 30.01%     | -  |
| 兴业证券股份有限公司     | 1      | 406,075.00 | 17.66%       | 345.17    | 18.21%     | -  |
| 招商证券股份有限公司     | 1      | 367,325.00 | 15.98%       | 298.45    | 15.74%     | -  |
| 中国建银投资证券有限责任公司 | 2      | 303,236.00 | 13.19%       | 246.37    | 13.00%     | -  |
| 安信证券股份有限公司     | 1      | 192,320.00 | 8.37%        | 156.27    | 8.24%      | -  |
| 国金证券有限责任公司     | 1      | 183,097.00 | 7.96%        | 155.64    | 8.21%      | -  |
| 东北证券股份有限公司     | 1      | 127,200.00 | 5.53%        | 108.12    | 5.70%      | -  |
| 长城证券有限责任公司     | 1      | 19,620.00  | 0.85%        | 16.68     | 0.88%      | -  |
| 信达证券有限责任公司     | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 恒泰证券有限责任公司     | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 东兴证券有限责任公司     | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 华融证券股份有限公司     | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 齐鲁证券有限公司       | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司   | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 北京高华证券有限责任公司   | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |
| 华泰联合证          | 1      | -          | -            | -         | -          | -  |

|              |   |   |   |   |   |   |
|--------------|---|---|---|---|---|---|
| 券有限责任公司      |   |   |   |   |   |   |
| 华创证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 上海证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 民生证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发华福有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 世纪证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 国都证券有限责任公司   | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司   | 1 | - | - | - | - | - |

### 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 |
| 中天证券有限责任公司     | 3,962,766.50   | 0.26%        | -                | -            | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司     | 218,929,683.50 | 14.46%       | 5,372,700,000.00 | 47.88%       | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司     | 2,506,632.75   | 0.17%        | -                | -            | -    | -            |
| 中国建银投资证券有限责任公司 | 75,011,954.03  | 4.95%        | -                | -            | -    | -            |

|                  |                |        |                  |        |   |   |
|------------------|----------------|--------|------------------|--------|---|---|
| 安信证券股份<br>有限公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 国金证券有限<br>责任公司   | 359,049,925.19 | 23.71% | 329,900,000.00   | 2.94%  | - | - |
| 东北证券股份<br>有限公司   | 350,219,053.48 | 23.13% | 2,247,300,000.00 | 20.03% | - | - |
| 长城证券有限<br>责任公司   | 46,564,122.50  | 3.08%  | 2,719,900,000.00 | 24.24% | - | - |
| 信达证券有限<br>责任公司   | 457,797,166.35 | 30.24% | 550,900,000.00   | 4.91%  | - | - |
| 恒泰证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 东兴证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 华融证券股份<br>有限公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 齐鲁证券有限<br>公司     | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 国泰君安证券<br>股份有限公司 | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 北京高华证券<br>有限责任公司 | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 华泰联合证券<br>有限责任公司 | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 华创证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 中国银河证券<br>股份有限公司 | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 中信证券股份<br>有限公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 中银国际证券<br>有限责任公司 | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 上海证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 民生证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 国信证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 广发华福有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 世纪证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |
| 国都证券有限<br>责任公司   | -              | -      | -                | -      | - | - |

|                |   |   |   |   |   |   |
|----------------|---|---|---|---|---|---|
| 中国国际金融<br>有限公司 | - | - | - | - | - | - |
|----------------|---|---|---|---|---|---|

注：

1. 本报告期内，本基金新租用安信证券股份有限公司席位 1 个，华创证券有限责任公司席位 1 个。

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

由研究发展部或基金投资部/市场部分别牵头并组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部或基金投资部/市场部汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或基金投资部/市场部提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

**10.8 其他重大事件**

| 序号 | 公告事项                                   | 法定披露方式                      | 法定披露日期     |
|----|--|-----------------------------|------------|
| 1  | 华安稳固收益债券型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告 | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-01-26 |
| 2  | 关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定投业务的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-03-10 |
| 3  | 关于新增哈尔滨银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-03-21 |
| 4  | 关于新增民生证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-04-11 |
| 5  | 关于新增浙江稠州商业银行股份有限公司为基金代销机构的公告           | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-04-18 |
| 6  | 关于新增烟台银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-04-23 |
| 7  | 关于华安稳固收益债券型证券投资基金增加代销机构的公告             | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-05-23 |
| 8  | 关于新增大连银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告            | 《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 | 2011-06-30 |

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、《华安稳固收益债券型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安稳固收益债券型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安稳固收益债券型证券投资基金托管协议》

### 11.2 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>。

### 11.3 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  
二〇一一年八月二十九日