华安稳定收益债券型证券投资基金 2008年年度报告摘要

2008年12月31日

基金管理人：华安基金管理有限公司 基金托管人：中国建设银行股份有限公司 送出日期：2009年3月26日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年3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。

本报告中财务资料已经审计。

本报告期自2008年4月30日（基金合同生效日）起至2008年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安收益	
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	
报告期末基金份额总额	2,818,035,321.77份	
下属两级基金的基金简称	华安收益A类	华安收益B类
下属两级基金的交易代码	040009(前端) 041009(后端)	040010
报告期末下属两级基金的份额总额	1,802,587,817.99份	1,015,447,503.78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	本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，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	中国建设银行股份有限公司
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	2008年4月30日－2008年12月31日	
	华安收益A类	华安收益B类
本期已实现收益	80,928,227.45	26,578,400.28
本期利润	189,141,645.94	60,294,898.48
加权平均基金份额本期利润	0.0874	0.0916
本期基金份额净值增长率	9.53%	9.21%
3.1.2 期末数据和指标	2008年4月30日－2008年12月31日	
	华安收益A类	华安收益B类
期末可供分配利润	72,700,942.83	37,858,439.67
期末基金资产净值	1,974,333,107.35	1,108,989,906.10
期末基金份额净值	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：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。截止本报告期末，本基金成立不足一年。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安收益A类

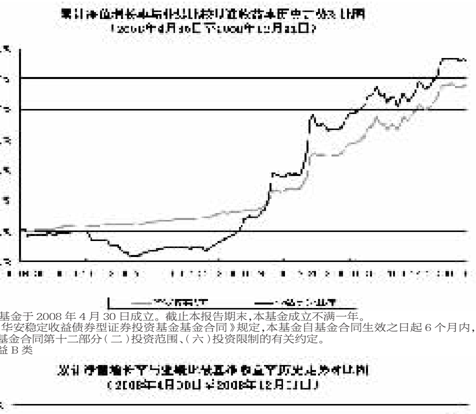
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.54%	0.22%	7.28%	0.33%	-0.74%	-0.11%
过去六个月	9.04%	0.17%	12.83%	0.26%	-3.79%	-0.09%
自基金合同生效起至今	9.53%	0.15%	11.25%	0.24%	-1.72%	-0.09%

华安收益B类

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	6.41%	0.22%	7.28%	0.33%	-0.87%	-0.11%
过去六个月	8.80%	0.17%	12.83%	0.26%	-4.03%	-0.09%
自基金合同生效起至今	9.21%	0.15%	11.25%	0.24%	-2.04%	-0.09%

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

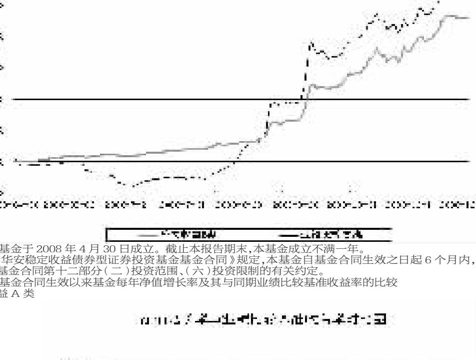
华安收益A类



注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2.根据《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内，基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分（二）投资范围、（六）投资限制的有关约定。

华安收益B类

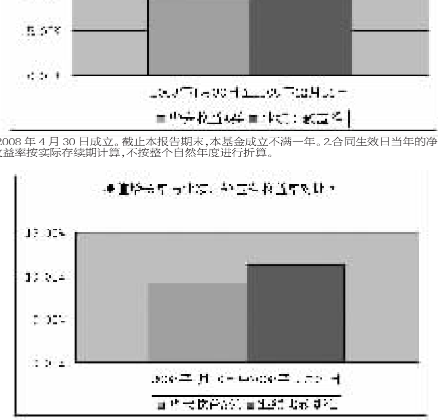


注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。

2.根据《华安稳定收益债券型证券投资基金基金合同》规定，本基金自基金合同生效之日起6个月内，基金的投资组合比例已符合基金合同第十二部分（二）投资范围、（六）投资限制的有关约定。

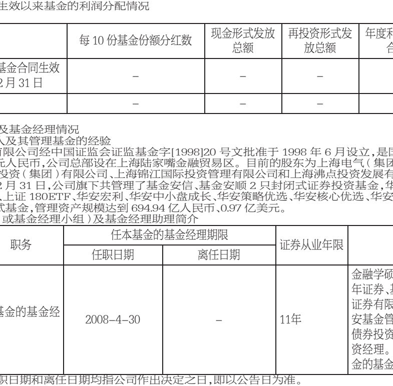
3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安收益A类



注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。2.合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

华安收益B类



注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。2.合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2008年4月30日（基金合同生效日）至2008年12月31日	–	–	–	–	–
合计	–	–	–	–	–

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2008年12月31日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺2只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国A股、华安富利、华安宝利、上证180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等11只开放式基金，管理资产规模达到694.94亿人民币、0.97亿美元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
贺涛	本基金的基金经理	2008-4-30	–	11年	金融学硕士（金融工程方向），11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：1. 此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端基金间公平交易管理办法－交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端基金间公平交易管理办法－银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

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

2008年债券市场先抑后扬全年涨幅较大。上半年经济增长较快、CPI高位运行，为防止经济过热以及全面通胀，央行执行了从紧的货币政策：严格信贷额度管理、累计5次上调存款准备金率、人民币小幅升值。市场流动性趋紧、加息预期渐起，债市冲高回落，中长期债券收益率大幅上扬。下半年美国次贷危机恶化外需急剧萎缩，国内房地产市场低迷固定资产投资增速下滑，工业企业订单减少库存增加，经济调整压力增大。为保障平稳增长，宏观调控全面放松，开始实行积极的财政政策和适度宽松的货币政策。半年内，央行大幅降息189BP，下调不同类型商业银行存款准备金率2至4个百分点。市场预期发生改变，债券市场受资金推动大幅上涨，市场收益率快速下滑。其中，中短期债券收益率下降幅度超过中长期债券，收益率曲线陡峭化；政策性金融债涨幅大于国债，两者利差缩小。

华安稳定收益债券基金自4月30日成立以来谨慎操作，严格控制组合流动性和信用风险，在深入研究的基础上动态调整久期、不断优化组合结构，通过积极主动的管理以获取相对稳健的收益。截至2008年12月31日，华安稳定收益A实现9.53%的业绩增长，华安稳定收益B实现9.21%的业绩增长。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金对下阶段市场保持谨慎乐观。宏观基本面决定债市长期运行方向。短期看，随着信贷增长的加快、工业企业“去库存”的结束、2009年1季度GDP触底反弹的概率较大。然而外需仍在恶化，基建投资和消费的增长能否弥补房地产投资和出口的下降，这个问题有待进一步观察，未来经济增长不确定性依然较大。中长期看，由于总需求减弱过剩产能的消化时间可能更长。未来宏观经济将在较低增速上重建平衡，由此，物价和利率也将保持相对低位水平。从资金供给来看2009年债市供需大体平衡，资金面略微宽裕，商业银行将是债券的主要需求方。由于不确定性增强未来市场波动将加大，我们将关注：首先目前多空分歧较大，市场参与者将根据新的经济数据不断修正和调整自己的预期，由此引发的市场波动将为投资人带来结构性或阶段性投资机会。其次，低利率环境下企业债收益率较高吸引力上升，信用类产品将成为市场投资的热点。最后，随着资本市场逐步转暖可转债投资和新股申购将增强债券基金的收益。下阶段我们将保持组合流动性，密切关注国内外经济形势变化，动态调整组合久期，深入挖掘信用类产品价值，择机增持可转债。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：

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

（1）估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值。

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

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

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响：

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

（1）公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、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，现任研究发展部总经理。

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

许之彦，金融工程部负责人，理学博士，曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国A股基金经理，金融工程部负责人。

朱永红，基金运营部总经理，经济学学士，ACCA英国特许公认会计师公会会员，CPA中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000年10月加入华安基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。

（2）托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算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

本基金每次收益分配比例应不低于可分配收益的60%，对本报告期应分配但尚未实施的利润，本基金已在2009年1月19日进行了相关收益分配。

§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、利润分配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损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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，注册会计师薛竞、金毅签字出具了普华永道中天审字(2009)第20111号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§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：2008年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2008年12月31日
资产：	
银行存款	197,609,385.80
结算备付金	301,544.61
存出保证金	330.11
交易性金融资产	2,818,986,302.26
其中：股票投资	–
基金投资	–
债券投资	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	5,308,135.32
应收利息	44,681,445.04
应收股利	–
应收申购款	22,390,476.02
递延所得税资产	–
其他资产	–
资产总计	3,089,277,619.16
负债和所有者权益	本期末 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	–
应付证券清算款	1,088,037.13
应付赎回款	2,500,598.76
应付管理人报酬	1,455,752.91
应付托管费	485,250.96
应付销售服务费	306,342.61
应付交易费用	23,369.65
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	95,253.69
负债合计	5,954,605.71
所有者权益：	
实收基金	2,818,035,321.77
未分配利润	265,287,691.68
所有者权益合计	3,083,323,013.45
负债和所有者权益总计	3,089,277,619.16

注：1.报告截止日2008年12月31日，基金份额总额2,818,035,321.77份，其中华安收益A类份额总额1,802,587,817.99份，华安收益B类份额总额1,015,447,503.78份。华安收益A类份额净值1.0953元，华安收益B类份额净值1.0921元。

2.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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

7.2 利润表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2008年4月30日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年4月30日至2008年12月31日
一、收入	268,184,187.53
1.利息收入	73,579,102.00
其中：存款利息收入	1,882,083.34
债券利息收入	69,179,014.90
资产支持证券利息收入	–
买入返售金融资产收入	2,518,003.76
其他利息收入	–
2.投资收益（损失以“-”填列）	52,083,297.41
其中：股票投资收益	10,380,734.83
基金投资收益	–
债券投资收益	41,045,599.51
资产支持证券投资收益	–
衍生工具收益	656,963.07
股利收益	–
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	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）	591,871.43
二、费用（以“-”号填列）	-18,747,643.11
1. 管理人报酬	-11,645,328.93
2. 托管费	-3,881,776.31
3. 销售服务费	-1,814,643.90
4. 交易费用	-127,576.77
5. 利息支出	-1,132,987.40
其中：卖出回购金融资产支出	-1,132,987.40
6. 其他费用	-145,329.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	249,436,544.42
所得税费用（以“-”号填列）	–
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	249,436,544.42

注：本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安稳定收益债券型证券投资基金

本报告期：2008年4月30日至2008年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2008年4月30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（以“-”号填列）	-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：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

2.本表中“期初所有者权益(基金净值)”为基金合同生效日即2008年4月30日的数据。

后附7.4报表附注为本财务报表的组成部分。

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安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(以下简称“中国建设银行”)。

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2009年3月25日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安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2008年4月30日(基金合同生效日)至2008年12月31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2008年12月31日的财务状况以及2008年4月30日(基金合同生效日)至2008年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2008年4月30日(基金合同生效日)至2008年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(i)金融资产的分类

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

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

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

(ii)金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

(ii)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请投资者参见基金合同中基金收益分配章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

计量属性

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

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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

(d)基金买卖股票于2008年9月18日之前按0.1%的税率缴纳股票交易印花税。自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 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（“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
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 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

本基金本报告期内（2008年4月30日至2008年12月31日）没有通过关联方交易单元进行的股票交易。

本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内（2008年4月30日至2008年12月31日）没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内（2008年4月30日至2008年12月31日）没有应支付关联方的佣金。

本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

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（2008年4月30日至2008年12月31日）
当期应支付的管理费	11,645,328.93
其中：当期已支付	10,189,576.02
期末未支付	1,455,752.91

注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

2. 支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.6%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（2008年4月30日至2008年12月31日）
当期应支付的托管费	3,881,776.31
其中：当期已支付	3,396,525.35
期末未支付	485,250.96

注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

2. 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（2008年4月30日至2008年12月31日）			
	当期应支付的销售服务费			
	当期已支付	期末未支付	合计	
			华安收益A	华安收益B
华安基金管理有限公司	198,194.99	107,312.47	–	305,507.46
中国建设银行股份有限公司	497,095.64	58,605.94	–	555,701.58
合计	695,290.63	165,918.41	–	861,209.04

注：1.本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

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

日销售服务费＝前一日B类基金份额的基金资产净值×0.4%／当年天数。

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期（2008年4月30日至2008年12月31日）					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行股份有限公司	707,828,925.84	–	–	–	–	–

注：本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

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

报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

注：本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

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

报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

注：本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

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（2008年4月30日至2008年12月31日）	
	期末存款余额	当期存款利息收入
中国建设银行股份有限公司	197,609,385.80	1,785,690.45

注：本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

注：本基金于2008年4月30日成立。截止本报告期末，本基金成立不满一年。无上年可比数据。

7.4.9 期末（2008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

本基金未持有因认购新发／增发证券而于期末流通受限的证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金未持有期末暂时停牌的股票。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无正回购余额，因此没有债券作为抵押。

§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	–	–
	其中：股票	–	–
2	固定收益投资	2,818,986,302.26	91.25
	其中：债券	2,818,986,302.26	91.25
	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	197,910,930.41	6.41
6	其他资产	72,380,386.49	2.34
7	合计	3,089,277,619.16	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	–	–
B	采掘业	–	–
C	制造业	–	–
C0	食品、饮料	–	–
C1	纺织、服装、皮毛	–	–
C2	木材、家具	–	–
C3	造纸、印刷	–	–
C4	石油、化学、塑胶、塑料	–	–
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	–	–
C7	机械、设备、仪表	–	–
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	–	–

注：本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601766	中国南车	6,214,794.14	0.20
2	002251	步步高	1,229,463.36	0.04
3	002241	歌尔声学	807,540.00	0.03
4	002240	威华股份	722,200.00	0.02
5	002233	塔牌集团	697,085.00	0.02
6	002236	大华股份	581,760.00	0.02
7	002242	九阳股份	529,690.00	0.02
8	002237	恒邦股份	428,670.00	0.01
9	002259	升达林业	383,883.60	0.01
10	002267	陕天然气	381,240.00	0.01
11	002250	联化科技	273,530.52	0.01
12	002235	安妮股份	261,840.00	0.01
13	002261	拓维信息	259,922.07	0.01
14	002268	卫士通	226,389.48	0.01
15	002243	通产丽星	221,730.00	0.01
16	002238	天威视讯	174,500.00	0.01
17	002253	川大智胜	162,250.00	0.01
18	002239	金飞达	121,290.00	0.00
19	002247	帝龙新材	120,375.00	0.00
20	002234	民和股份	116,710.00	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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	601766	中国南车	11,261,185.07	0.37
2	002251	步步高	2,231,745.00	0.07
3	002241	歌尔声学	1,329,230.00	0.04
4	002233	塔牌集团	1,171,150.00	0.04
5	002236	大华股份	1,152,600.00	0.04
6	002242	九阳股份	1,113,900.00	0.04
7	002240	威华股份	979,858.48	0.03
8	002237	恒邦股份	844,312.00	0.03
9	002267	陕天然气	511,322.00	0.02
10	002235	安妮股份	431,947.70	0.01
11	002238	天威视讯	425,000.00	0.01
12	002268	卫士通	367,061.64	0.01
13	002234	民和股份	346,610.00	0.01
14	002243	通产丽星	342,000.00	0.01
15	002259	升达林业	320,253.30	0.01
16	002261	拓维信息	281,568.15	0.01
17	002250	联化科技	259,489.98	0.01
18	002253	川大智胜	211,088.00	0.01
19	002239	金飞达	195,650.00	0.01
20	002255	海陆重工	179,010.00	0.01

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

买入股票成本（成交）总额	14,522,968.17
卖出股票收入（成交）总额	24,903,703.00

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	648,491,076.40	21.03
2	央行票据	1,105,455,000.00	35.85
3	金融债券	607,324,000.00	19.70
	其中：政策性金融债	607,324,000.00	19.70
4	企业债券	427,620,225.86	13.87
5	企业短期融资券	30,096,000.00	0.98
6	可转债	–	–
7	其他	–	–
8	合计	2,818,986,302.26	91.43

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	0801053	08央票53	4,000,000	428,040,000.00	13.88
2	0801047	08央票47	3,500,000	374,150,000.00	12.13
3	080007	08国债07	2,300,000	256,496,000.00	8.32
4	0801101	08央票101	2,100,000	205,800,000.00	6.67
5	088063	08铁道07	2,000,000	203,980,000.00	6.62

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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	330.11
2	应收证券清算款	5,308,135.32
3	应收股利	–
4	应收利息	44,681,445.04
5	应收申购款	22,390,476.02
6	其他应收款	–
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	72,380,386.49

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
华安收益A	11,811	152,619.41	1,292,457,609.21	71.70%	510,130,208.78	28.30%
华安收益B	9,047	112,241.35	351,651,438.83	34.63%	663,796,064.95	65.37%
合计	20,858	135,105.73	1,644,109,048.04	58.34%	1,173,926,273.73	41.66%

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	华安收益A	185,635.31	0.01%
	华安收益B	633,170.97	0.06%
	合计	818,806.28	0.03%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	华安收益A	华安收益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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,197,197,499.08	901,155,234.19
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,792,643,672.36	618,435,665.81
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	–	–
报告期期末基金份额总额	1,802,587,817.99	1,015,447,503.78

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

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

(2).2009年1月12日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(3).2009年2月19日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

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：

2008年6月13日，中国证券监督管理委员会核准中国建设银行投资托管服务部副总经理纪伟的高级管理人员任职资格。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

报告期内应支付给会计师事务所的报酬情况：90,000.00元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财富证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
德邦证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	1	10,682,626.86	42.90%	8,679.79	42.02%	–
海通证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	1	158,536.64	0.64%	128.80	0.62%	–
申银万国证券股份有限公司	1	2,801,354.43	11.25%	2,276.15	11.02%	–
湘财证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
招商证券股份有限公司	1	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	1	–	–	–	–	–
中信建投证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	1	11,261,185.07	45.22%	9,571.94	46.34%	–
中银国际证券有限责任公司	1	–	–	–	–	–

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		备注
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	–
财富证券有限责任公司	32,998,466.47	4.89%	–	–	–	–	–
长江证券股份有限公司	761,877.40	0.11%	1,113,300,000.00	16.57%	525,712.73	26.55%	–
德邦证券有限责任公司	5,656,160.54	0.84%	–	–	–	–	–
广发证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–	–
国泰君安证券股份有限公司	2,106,952.09	0.31%	–	–	–	–	–
海通证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–	–
华泰证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–	–
齐鲁证券有限公司	60,453,571.56	8.96%	–	–	–	–	–
申银万国证券股份有限公司	130,410,862.47	19.33%	–	–	–	–	–
湘财证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–	–
兴业证券股份有限公司	51,199,119.70	7.59%	5,213,400,000.00	77.60%	1,454,136.00	73.45%	–
招商证券股份有限公司	–	–	–	–	–	–	–
中国国际金融有限公司	–	–	–	–	–	–	–
中信建投证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–	–
中信证券股份有限公司	390,929,939.40	57.96%	392,000,000.00	5.83%	–	–	–
中银国际证券有限责任公司	–	–	–	–	–	–	–

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，本基金和华安宏利、华安核心共同变更交易单元如下：

新增交易单元：

新增齐鲁证券有限责任公司深圳交易单元1个；

新增中国国际金融有限公司上海交易单元1个；

新增华泰证券股份有限公司上海交易单元1个；

新增德邦证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增财富证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增广发证券股份有限公司上海交易单元1个；

新增中银国际证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增海通证券股份有限公司上海交易单元1个；

新增湘财证券有限责任公司深圳交易单元1个。

退租交易单元：无。

3、券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4)其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

4、券商专用交易单元选择程序：

(1)对交易单元候选券商的综合服务进行评估

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

(2)填写《新增交易单元申请审核表》

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

(3)候选交易单元名单提交分管副总经理审批

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

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元使用协议》，并通知基金托管人。

§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、2008年5月27日，中国建设银行发布关于美国银行公司行使认购期权的公告，美国银行公司将根据与中央汇金投资有限责任公司于2005年6月17日签订的《股份及期权认购协议》行使认购期权；

2、2008年9月23日，中国建设银行公告关于控股股东中央汇金投资有限责任公司增持中国建设银行股份的公告；

3、2008年11月17日，中国建设银行公告美国银行公司行使认购期权的事宜；

4、2008年12月2日，中央汇金投资有限责任公司与美国银行公司公布简式权益变动报告书。

华安基金管理有限公司

2009年3月26日