

**华安稳固收益债券型证券投资基金**  
**2012 年半年度报告**  
**2012 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：二〇一二年八月二十七日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 8 月 17 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 2012 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.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
3	主要财务指标和基金净值表现.....	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.....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
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.....	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
5	托管人报告.....	14
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见.....	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	15
6.1	资产负债表.....	15
6.2	利润表.....	16
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4	报表附注.....	18
7	投资组合报告.....	34
7.1	期末基金资产组合情况.....	34
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	38
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.....	38
7.9	投资组合报告附注.....	38
8	基金份额持有人信息.....	39
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	39
9	开放式基金份额变动.....	39

10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	40
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4	基金投资策略的改变.....	40
10.5	报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
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.....	40
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	44
11	备查文件目录.....	46
11.1	备查文件目录.....	46
11.2	存放地点.....	46
11.3	查阅方式.....	46

## 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	1,360,512,593.27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	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	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
办公地址	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号	
邮政编码	200120	100140	
法定代表人	李劼	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 管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

## 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	上海市世纪大道 8 号上海国金中心二期 31、32 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	38,095,256.69
本期利润	67,400,281.92
加权平均基金份额本期利润	0.0593
本期加权平均净值利润率	5.62%

本期基金份额净值增长率	5.66%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
期末可供分配利润	68,437,626.34
期末可供分配基金份额利润	0.0503
期末基金资产净值	1,460,266,477.92
期末基金份额净值	1.073
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2012年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	10.41%

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）。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去1个月	0.94%	0.15%	0.45%	0.01%	0.49%	0.14%
过去3个月	3.77%	0.11%	1.37%	0.01%	2.40%	0.10%
过去6个月	5.66%	0.10%	2.75%	0.02%	2.91%	0.08%
过去1年	7.83%	0.18%	5.54%	0.02%	2.29%	0.16%
自基金成立起至今	10.41%	0.15%	8.45%	0.02%	1.96%	0.13%

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，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。

投资组合比例范围为：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%。

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的债券类资产的比例为基金资产净值的 123.17%，未投资于股票等权益类资产，持有现金或到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 4.83%。上述各项投资比例中，除持有现金或到期日在一年

以内的政府债券低于基金资产净值的 5%外，其他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 2012 年 6 月 30 日)



## 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 2012 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、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选



股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证 180ETF、华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头企业 ETF、龙头 ETF 联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证 300 指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安沪深 300 指数分级等 29 只开放式基金，管理资产规模达到 854.82 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。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，即以公告日为准。

2. 证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安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，除因 6 月 28 日出现大额申购导致 6 月 29 日基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券低于 5% 以外，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价

的控制原则。通过内部共同的 MSN 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内，除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况共出现了 2 次。原因：各投资组合分别按照其交易策略交易时，虽相关投资组合买卖数量极少，但由于个股流动性较差，交易量稀少，致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的 5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看，也未发现有异常。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，我国宏观经济增速开始回落，物价指数进入下行通道。国外欧债危

机持续发酵，虽然在希腊大选后暂时告一段落，但在此过程中欧元下跌明显，美元强劲反弹，风险资产价格大多下降，大宗商品价格暴跌。与此同时，我国外汇占款增速快速下降，基础货币投放能力明显减弱。为稳定经济形势，我国宏观经济政策开始微调，稳增长被放在政策目标的首位。央行主动放松银根，下调了两次存款准备金，并在时隔三年半后首次降息，公开市场操作也以净投放为主。

在此背景下，上半年债券市场的资金面逐渐转向宽松，资金利率回落，无论是利率产品还是信用产品都在资金面的支持下表现良好。利率产品收益率波动中枢下移，但仍未体现出持续的趋势性行情。在海龙短融风险事件平安渡过后，低评级信用产品相对取得了更好的投资回报。股市出现较大幅度波动，整体上冲高回落，新股上市表现也差强人意。可转债一季度在正股推动下表现较好。在股市调整时，质押融资条款的通过，也提升了转债市场的整体估值水平，在股市偏弱的背景下基本维持了震荡格局。

华安稳固收益债券基金在上半年大多数时间里保持了较高的杠杆比率，并在配置上向中低评级信用产品倾斜。年初资金成本较高时压力较大，但随着资金面的宽松，投资回报逐渐改善。对利率产品采用波段操作策略，取得了较好的回报。在新股申购方面较为谨慎，并未取得预期回报。在可转债投资上采用自下而上的波段操作策略，取得了正回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.073 元，本报告期份额净值增长率为 5.66%，同期业绩比较基准增长率为 2.75%。

#### 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，预期宏观经济增速保持低位，通胀水平将继续下降。跨境资本流动将继续考验我国的基础货币投放能力，预期央行将继续保持公开市场的净投放，或者下调存款准备金率。稳增长仍将成为下季度的政策主题，实体经济去库存过程中的负面影响将会受到控制。在此背景下，我们对债券市场仍然持乐观态

度，但预期收益将较上半年有所下降。中短期信用品种在绝对收益方面将有较好表现，利率产品存在波段性机会，波动中枢将继续下移。股票市场整体受制于资金面和基本面的双重压力，但仍存在结构性机会，同时可转债市场也存在个券机会。我们仍将坚持票息为主的债券配置策略，关注可转债和利率产品的波段性机会。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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、基金运营部总经理及相关负责人员。

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

###### 相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

杨明，投资研究部总监，研究生学历，12 年金融、证券、基金从业经验，

曾在上海银行工作。2004 年 10 月进入华安基金管理有限公司，担任研究发展部宏观研究员，现任投资研究部总监。

宋磊，投资研究部联席总监，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、投资研究部联席总监。

黄勤，固定收益部总监，经济学硕士。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

许之彦，指数投资部总监，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，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，华安深证 300 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理, 指数投资部总监。

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

## (2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

## (3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

## 4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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

本报告期内实施 2012 年度的第一次分红，本次分红方案为：0.30 元/10 份基金份额。权益登记日及除息日：2012 年 3 月 29 日；现金红利发放日：2012 年 3 月 30 日。

## 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

2012 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2012 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对基金份额持有人进行了一次利润分配，分配金额为 33,229,964.78 元。

### 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2012年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：2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	94,431,651.73	1,554,313.81
结算备付金		7,288,530.41	9,671,589.51
存出保证金		119,193.74	125,278.65
交易性金融资产	6.4.7.2	1,798,589,813.40	1,631,563,441.98
其中：股票投资		4,440.00	8,319,025.98
基金投资		-	-
债券投资		1,798,585,373.40	1,623,244,416.00
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		-	80,792,611.09
应收利息	6.4.7.3	32,445,796.25	43,773,775.27
应收股利		-	-
应收申购款		991,150.20	20,347,575.19
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,933,866,135.73	1,787,828,585.50
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 6 月 30 日	上年度末 2011 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		334,999,650.00	665,998,854.00
应付证券清算款		83,838,364.64	-
应付赎回款		52,676,503.44	5,948,435.44
应付管理人报酬		744,347.75	634,676.97
应付托管费		206,127.06	175,756.69
应付销售服务费		400,802.62	341,749.11
应付交易费用	6.4.7.4	18,698.70	67,996.94
应交税费		372,073.00	372,000.00
应付利息		177,989.32	350,473.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	165,101.28	332,008.65
负债合计		473,599,657.81	674,221,951.23
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.6	1,360,512,593.27	1,065,626,990.66
未分配利润	6.4.7.7	99,753,884.65	47,979,643.61
所有者权益合计		1,460,266,477.92	1,113,606,634.27
负债和所有者权益总计		1,933,866,135.73	1,787,828,585.50

注：报告截止日 2012 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.073 元，基金份额总额 1,360,512,593.27 份。

## 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>78,073,296.20</b>	<b>60,924,990.54</b>
1. 利息收入		36,768,702.75	40,025,152.68
其中：存款利息收入	6.4.7.8	343,698.28	850,964.23
债券利息收入		36,424,512.47	26,213,524.32
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		492.00	12,960,664.13
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,106,620.34	9,112,923.28
其中：股票投资收益	6.4.7.9	1,354,330.37	51,331.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	8,752,289.97	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	29,305,025.23	-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	1,892,947.88	13,336,347.54
<b>减：二、费用</b>		<b>10,673,014.28</b>	<b>16,087,335.40</b>
1. 管理人报酬		3,861,282.43	6,423,525.87
2. 托管费		1,069,278.18	1,778,822.55
3. 销售服务费		2,079,152.07	3,458,821.69
4. 交易费用	6.4.7.13	60,333.30	34,946.43
5. 利息支出		3,403,745.28	4,194,099.80
其中：卖出回购金融资产支出		3,403,745.28	4,194,099.80
6. 其他费用	6.4.7.14	199,223.02	197,119.06
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>67,400,281.92</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>67,400,281.92</b>	<b>44,837,655.14</b>

### 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：2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,065,626,990.66	47,979,643.61	1,113,606,634.27
二、本期经营活动产生的	-	67,400,281.92	67,400,281.92

基金净值变动数（本期利润）			
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）	294,885,602.61	17,603,923.90	312,489,526.51
其中：1. 基金申购款	616,239,065.63	35,589,639.57	651,828,705.20
2. 基金赎回款	-321,353,463.02	-17,985,715.67	-339,339,178.69
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）	-	-33,229,964.78	-33,229,964.78
五、期末所有者权益（基金净值）	1,360,512,593.27	99,753,884.65	1,460,266,477.92
项目	上年度可比期间 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：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：李勍，主管会计工作负责人：赵敏，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”)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[2010]第 1362 号《关于核准华安稳固收益债券型证券投资基金募集的批复》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基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 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(以下简称“中国工商银行”)。本基金每三年为一个运作期,前后两个运作期期间安排不少于 5 个工作日的间隔期,便于本基金在前后两个运作期期间调整组合配置,并且投资者在过渡期内办理本基金的申购和赎回业务时不收取申购、赎回费用。

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。本基金的业绩比较基准为:3 年期银行定期存款收益率+1.68%。

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 2012 年 8 月 24

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》和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日止期间的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 2012 年 6 月 30 日的财务状况以及 2012 年 1 月 1 日至 2012 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 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。

#### 6.4.5 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

#### 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 2012 年 6 月 30 日
活期存款	94,431,651.73
定期存款	-
其他存款	-
合计	94,431,651.73

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2012年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,995.00	4,440.00	-555.00	
债券	交易所市场	573,284,922.17	579,997,373.40	6,712,451.23
	银行间市场	1,197,864,046.07	1,218,588,000.00	20,723,953.93
	合计	1,771,148,968.24	1,798,585,373.40	27,436,405.16
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	1,771,153,963.24	1,798,589,813.40	27,435,850.16	

### 6.4.7.3 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	12,253.57
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	2,951.91
应收债券利息	32,427,238.77
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	3,352.00
其他	-
合计	32,445,796.25

### 6.4.7.4 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	7,264.15
银行间市场应付交易费用	11,434.55
合计	18,698.70

### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	7.26
应付后端申购费	-
债券利息税	-
预提费用	165,094.02
银行手续费	-
合计	165,101.28

### 6.4.7.6 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 1 月 1 日至 2012 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,065,626,990.66	1,065,626,990.66
本期申购	616,239,065.63	616,239,065.63
本期赎回（以“-”号填	-321,353,463.02	-321,353,463.02

列)		
本期末	1,360,512,593.27	1,360,512,593.27

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	48,729,140.36	-749,496.75	47,979,643.61
本期利润	38,095,256.69	29,305,025.23	67,400,281.92
本期基金份额交易产生的变动数	14,843,194.07	2,760,729.83	17,603,923.90
其中：基金申购款	30,984,828.61	4,604,810.96	35,589,639.57
基金赎回款	-16,141,634.54	-1,844,081.13	-17,985,715.67
本期已分配利润	-33,229,964.78	-	-33,229,964.78
本期末	68,437,626.34	31,316,258.31	99,753,884.65

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
活期存款利息收入	273,141.53
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	59,214.38
其他	11,342.37
合计	343,698.28

#### 6.4.7.9 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出股票成交总额	18,851,539.29
减：卖出股票成本总额	17,497,208.92
买卖股票差价收入	1,354,330.37

#### 6.4.7.10 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,098,977,941.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,064,189,773.19
减：应收利息总额	26,035,878.57



债券投资收益	8,752,289.97
--------	--------------

**6.4.7.11 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
1. 交易性金融资产	29,305,025.23
——股票投资	-89,189.98
——债券投资	29,394,215.21
——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	29,305,025.23

**6.4.7.12 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
基金赎回费收入	1,892,947.88
合计	1,892,947.88

注：1. 本基金在过渡期内的赎回费率为零；运作期内的赎回费率按该运作期间持有期间递减，赎回费全部归入基金资产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费全部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 2012年1月1日至2012年6月30日
交易所市场交易费用	43,183.30
银行间市场交易费用	17,150.00
合计	60,333.30

**6.4.7.14 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日
审计费用	45,749.34
信息披露费	119,344.68

帐户维护费	10,900.00
银行汇划费用	23,229.00
合计	199,223.02

**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 2012年1月1日至2012年6 月30日	上年度可比期间 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	3,861,282.43	6,423,525.87
其中：支付销售机构的客户维护费	510,533.99	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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 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	1,069,278.18	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。

#### 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 2012年1月1日至2012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	1,456,453.43
中国工商银行股份有限公司	312,142.40
合计	1,768,595.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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：支付基金销售机构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，按月支付给 华安基金公司，再由 华安基金公司 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 = 前一日基金资产净值 × 0.35% / 当年天数。

#### 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	94,431,651.73	273,141.53	4,107,449.66	757,632.97

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2012-03-29	2012-03-29	0.300	29,093,509.51	4,136,455.27	33,229,964.78	-
合计	-	-	0.300	29,093,509.51	4,136,455.27	33,229,964.78	-

6.4.12 期末（2012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 2012 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 99,999,650.00 元，是以如下债券作为抵押：

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
1182343	11柳控MTN1	2012-07-03	106.44	300,000	31,932,000.00
1182361	11凤传媒MTN1	2012-07-03	104.35	300,000	31,305,000.00
1182370	11中环MTN1	2012-07-03	104.95	200,000	20,990,000.00
1182401	11梅花MTN1	2012-07-03	105.03	200,000	21,006,000.00
合计		-	-	1,000,000	105,233,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2012 年 6 月 30 日止，本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 235,000,000.00 元，于 2012 年 7 月 2 日、2012 年 7 月 5 日、2012 年 7 月 6 日前先后到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，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，在有效控制流动性和风险的前提下，构建固定收益类资产的投资组合，并适当参与股票首次发行或增发新股等较低风险投资品种，力求持续稳妥地保值增值。

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

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

### 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 2012 年 6 月 30 日	上年末 2011 年 12 月 31 日
A-1	456,133,000.00	362,058,000.00
A-1 以下	-	-
未评级	60,071,000.00	50,167,000.00
合计	516,204,000.00	412,225,000.00

#### 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 2012 年 6 月 30 日	上年末 2011 年 12 月 31 日
AAA	250,975,292.60	178,038,000.00
AAA 以下	827,886,080.80	550,165,416.00
未评级	203,520,000.00	482,816,000.00
合计	1,282,381,373.40	1,211,019,416.00

注：未评级债券为国债、央行票据及政策性金融债。

### 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银行间同业市场交易,其余亦可在证券交易所市场交易,因此除附注中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外,其余均能以合理价格适时变现。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余额中有 334,999,650.00 元将在一个月内到期且计息外,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 2012年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
-------------------	------	------	------	-----	----

资产					
资产	-	-	-	-	-
银行存款	94,431,651.73	-	-	-	94,431,651.73
结算备付金	7,288,530.41	-	-	-	7,288,530.41
存出保证金	-	-	-	119,193.74	119,193.74
交易性金融资产	668,074,267.80	823,149,986.80	307,361,118.80	4,440.00	1,798,589,813.40
应收利息	-	-	-	32,445,796.25	32,445,796.25
应收申购款	661,974.61	-	-	329,175.59	991,150.20
应收证券清算款	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	770,456,424.55	823,149,986.80	307,361,118.80	32,898,605.58	1,933,866,135.73
负债					
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	334,999,650.00	-	-	-	334,999,650.00
应付证券清算款	-	-	-	83,838,364.64	83,838,364.64
应付赎回款	-	-	-	52,676,503.44	52,676,503.44
应付管理人报酬	-	-	-	744,347.75	744,347.75
应付托管费	-	-	-	206,127.06	206,127.06
应付销售服务费	-	-	-	400,802.62	400,802.62
应付交易费用	-	-	-	18,698.70	18,698.70
应交税费	-	-	-	372,073.00	372,073.00
应付利息	-	-	-	177,989.32	177,989.32
其他负债	-	-	-	165,101.28	165,101.28
负债总计	334,999,650.00	-	-	138,600,007.81	473,599,657.81
利率敏感度缺口	435,456,774.55	823,149,986.80	307,361,118.80	-105,701,402.23	1,460,266,477.92
上年度末2011年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
资产	-	-	-	-	-
银行存款	1,554,313.81	-	-	-	1,554,313.81
结算备付金	9,671,589.51	-	-	-	9,671,589.51
存出保证金	-	-	-	125,278.65	125,278.65
交易性金融资产	422,197,000.00	605,363,416.00	595,684,000.00	8,319,025.98	1,631,563,441.98



应收利息	-	-	-	43,773,775.27	43,773,775.27
应收申购款	20,004,100.00	-	-	343,475.19	20,347,575.19
应收证券清算款	-	-	-	80,792,611.09	80,792,611.09
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
资产总计	453,427,003.32	605,363,416.00	595,684,000.00	133,354,166.18	1,787,828,585.50
负债					
负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	665,998,854.00	-	-	-	665,998,854.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	5,948,435.44	5,948,435.44
应付管理人报酬	-	-	-	634,676.97	634,676.97
应付托管费	-	-	-	175,756.69	175,756.69
应付销售服务费	-	-	-	341,749.11	341,749.11
应付交易费用	-	-	-	67,996.94	67,996.94
应交税费	-	-	-	372,000.00	372,000.00
应付利息	-	-	-	350,473.43	350,473.43
其他负债	-	-	-	332,008.65	332,008.65
负债总计	665,998,854.00	-	-	8,223,097.23	674,221,951.23
利率敏感度缺口	-212,571,850.68	605,363,416.00	595,684,000.00	125,131,068.95	1,113,606,634.27

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 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
	市场利率下降25个基点	增加约681.00万元	增加约861.00万元
	市场利率上升25个基点	减少约641.00万元	减少约834.00万元

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，将可投资对象分为基础资产和风险资产。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多因子模型等数量工具，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，以确定风险资产在非信用类固定收益品种、信用类固定收益品种、新股申购之间的配置比例。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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%。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 2012 年 6 月 30 日		上年度末 2011 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	4,440.00	0.00	8,319,025.98	0.75
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	4,440.00	0.00	8,319,025.98	0.75

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于 2012 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.00%(2011 年 12 月 31 日：0.75%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2011 年 12 月 31 日：同)。

#### 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	4,440.00	0.00
	其中：股票	4,440.00	0.00
2	固定收益投资	1,798,585,373.40	93.00
	其中：债券	1,798,585,373.40	93.00
	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	101,720,182.14	5.26
6	其他各项资产	33,556,140.19	1.74
7	合计	1,933,866,135.73	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	4,440.00	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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	4,440.00	0.00
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	4,440.00	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	002685	华东重机	500	4,440.00	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	601555	东吴证券	8,230,391.00	0.74
2	601339	百隆东方	7,896,772.00	0.71

3	603128	华贸物流	621,790.92	0.06
4	603001	奥康国际	255,000.00	0.02
5	300316	晶盛机电	99,000.00	0.01
6	603000	人民网	40,000.00	0.00
7	300307	慈星股份	35,000.00	0.00
8	601929	吉视传媒	35,000.00	0.00
9	601800	中国交建	32,400.00	0.00
10	601388	怡球资源	26,000.00	0.00
11	002673	西部证券	21,750.00	0.00
12	603366	日出东方	21,500.00	0.00
13	601012	隆基股份	21,000.00	0.00
14	002663	普邦园林	15,000.00	0.00
15	300298	三诺生物	14,500.00	0.00
16	601515	东风股份	13,200.00	0.00
17	300304	云意电气	11,000.00	0.00
18	002655	共达电声	11,000.00	0.00
19	002661	克明面业	10,500.00	0.00
20	002658	雪迪龙	10,255.00	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	601555	东吴证券	10,198,252.00	0.92
2	601339	百隆东方	7,063,736.97	0.63
3	603128	华贸物流	729,197.77	0.07
4	603001	奥康国际	245,000.00	0.02
5	300316	晶盛机电	103,200.00	0.01
6	603000	人民网	65,100.00	0.01
7	601929	吉视传媒	58,500.00	0.01
8	601800	中国交建	41,100.00	0.00
9	002673	西部证券	37,375.00	0.00
10	300307	慈星股份	30,698.82	0.00
11	601388	怡球资源	30,000.00	0.00
12	002663	普邦园林	21,850.00	0.00
13	603366	日出东方	21,575.00	0.00
14	601012	隆基股份	19,817.00	0.00
15	300298	三诺生物	17,950.00	0.00
16	601515	东风股份	15,510.00	0.00
17	002655	共达电声	15,500.00	0.00

18	300297	蓝盾股份	14,750.00	0.00
19	300314	戴维医疗	14,410.00	0.00
20	002661	克明面业	12,990.00	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	9,271,812.92
卖出股票的收入（成交）总额	18,851,539.29

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	40,119,000.00	2.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	223,472,000.00	15.30
	其中：政策性金融债	223,472,000.00	15.30
4	企业债券	694,014,105.60	47.53
5	企业短期融资券	456,133,000.00	31.24
6	中期票据	324,930,000.00	22.25
7	可转债	59,917,267.80	4.10
8	其他	-	-
9	合计	1,798,585,373.40	123.17

#### 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	122033	09 富力债	900,000	94,050,000.00	6.44
2	098010	09 淮南矿业债	900,000	91,953,000.00	6.30
3	122821	11 吉城建	800,000	82,680,000.00	5.66
4	122918	10 阜阳债	600,110	61,031,187.00	4.18
5	110018	国电转债	532,740	59,917,267.80	4.10

### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 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	119,193.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	32,445,796.25
5	应收申购款	991,150.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	33,556,140.19

#### 7.9.4 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	110018	国电转债	59,917,267.80	4.10

#### 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的情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
9,886	137,620.13	1,005,127,185.74	73.88%	355,385,407.53	26.12%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本基金	438,022.80	0.0322%

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 12 月 21 日）基金份额总额	2,733,751,055.10
本报告期期初基金份额总额	1,065,626,990.66
本报告期基金总申购份额	616,239,065.63
减：本报告期基金总赎回份额	321,353,463.02
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,360,512,593.27

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。



## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

2012 年 2 月 3 日，本基金管理人发布关于基金行业高级管理人员变更公告，尚志民先生任华安基金管理有限公司副总经理。尚志民先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。本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

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	

安信证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
长城证券有限 责任公司	1	19,817.00	0.11%	16.85	0.10%	-
东北证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
北京高华证券 有限责任公司	1	91,523.82	0.49%	74.35	0.46%	-
广发华福有限 责任公司	1	602,772.77	3.20%	512.35	3.17%	-
国都证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国金证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
恒泰证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份 有限公司	1	2,390,750.00	12.68%	2,087.10	12.90%	新增
华创证券有限 责任公司	1	4,820,986.97	25.57%	4,208.80	26.02%	-
华融证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰联合证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	2	268,390.00	1.42%	221.64	1.37%	-
开源证券有限 责任公司	1	27,411.73	0.15%	23.31	0.14%	-
民生证券有限 责任公司	1	10,239,352.00	54.32%	8,703.72	53.80%	-
齐鲁证券有限 责任公司	2	52,790.00	0.28%	42.88	0.27%	-
上海证券有限 责任公司	1	255,770.00	1.36%	217.41	1.34%	-
世纪证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
信达证券有限 责任公司	1	58,500.00	0.31%	49.72	0.31%	-

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	23,475.00	0.12%	19.07	0.12%	-
中国国际金融 有限公司	1	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券有限 责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 券商专用交易单元选择标准：

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

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

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

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

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2. 券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券

商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

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
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	21,024,373.32	4.98%	580,000,000.00	7.53%	-	-
东北证券股份有限公司	54,816,462.52	12.99%	355,000,000.00	4.61%	-	-
东兴证券有限责任公司	20,163,874.34	4.78%	496,500,000.00	6.45%	-	-
北京高华证券有限责任公司	3,213,905.71	0.76%	10,500,000.00	0.14%	-	-
广发华福有限责任公司	52,997,640.06	12.56%	1,175,600,000.00	15.26%	-	-
国都证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
国金证券有限责任公司	5,002,500.00	1.19%	573,000,000.00	7.44%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	35,824,091.62	8.49%	210,000,000.00	2.73%	-	-
恒泰证券有限责任公司	-	-	290,000,000.00	3.76%	-	-
宏源证券股份有限公司	58,540,387.72	13.87%	927,800,000.00	12.04%	-	-
华创证券有限责任公司	114,375,256.29	27.11%	768,800,000.00	9.98%	-	-
华融证券股份	-	-	318,000,000.00	4.13%	-	-

有限公司						
华泰联合证券 有限责任公司	97,012.05	0.02%	-	-	-	-
中国中投证券 有限责任公司	15,433,411.48	3.66%	617,606,000.00	8.02%	-	-
开源证券有限 责任公司	14,877,940.11	3.53%	144,000,000.00	1.87%	-	-
民生证券有限 责任公司	5,317,506.85	1.26%	268,000,000.00	3.48%	-	-
齐鲁证券有限 责任公司	-	-	255,000,000.00	3.31%	-	-
上海证券有限 责任公司	3,069,511.78	0.73%	305,000,000.00	3.96%	-	-
世纪证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
信达证券有限 责任公司	-	-	308,000,000.00	4.00%	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国银河证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份 有限公司	17,186,249.01	4.07%	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-	-	-
中天证券有限 责任公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信证券有限 责任公司	-	-	100,100,000.00	1.30%	-	-

### 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	华安基金管理有限公司关于新增财富里昂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	2012-01-16
2	华安基金管理有限公司关于新增财通证券有限责任公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-01-16
3	华安基金管理有限公司关于新增广州银行股份有限公司为开放式基金代销	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证	2012-02-20

	机构的公告	券报》和公司网站	
4	关于旗下基金参加广州银行股份有限公司网上申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-02-28
5	关于新增中信(浙江)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	2012-03-13
6	华安稳固收益债券型证券投资基金分红公告,华安稳固收益债券型证券投资基金向基金持有人按每10份基金份额派发现金红利0.30元	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-27
7	关于住所变更公告,住所变更为上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31、32层	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-03-30
8	关于电子直销平台开通“直销转托管”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-04-16
9	关于基金电子交易平台开展工商银行直联结算方式费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2012-05-02
10	关于新增兴业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	2012-06-04

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

## 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》
- 4、中国证监会批准华安稳固收益债券型证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

### 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  
二〇一二年八月二十七日