

## 华安策略优选股票型证券投资基金

## [2012] 第四季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司  
基金托管人:交通银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一三年一月二十一日

## § 1 重要提示

基金管理人和基金份额持有人应当在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据基金合同规定,于2013年1月11日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告内容,保证本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:华安策略优选股票

基金主代码:040008

前端交易代码:040008

后端交易代码:041008

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2007年8月8日

报告期末基金份额总额:13,620,535,295.09份

投资目标:以选股为主,配合多种投资策略,在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的收益,实现基金资产的长期稳定增值。

§ 3 投资组合报告

§ 4 投资策略

① 资本配置策略

本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的分析和预测,并利用公司研究开发的数据模型工具,分析和比较不同证券市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。

② 股票投资策略

本基金的股票投资策略将采用“自下而上”和“自上而下”相结合的方法,通过综合运用多种投资策略优中选优投资价值较高的公司的股票。在构建投资组合时主要以“自下而上”的优选成长策略为主,辅以“自上而下”的主题优选策略,逆势操作策略,优选具有良好投资潜力的个股,力求基金资产的中长期稳定增值。

③ 债券投资策略

本基金主要投资于国债、金融债、企业债和转换债券等债券品种,基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和违约率等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合的投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券券组合。

④ 权证、资产支持证券及其他衍生工具投资策略。

本基金将根据对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的分析和预测,并利用公司研究开发的数据模型工具,分析和比较不同证券市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。

⑤ 债券投资策略

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分析和预测,并利用公司研究开发的数据模型工具,分析和比较不同证券市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。

⑥ 其他投资策略

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分析和预测,并利用公司研究开发的数据模型工具,分析和比较不同证券市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。

⑦ 风险收益特征

本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

基金管理人:华安基金管理有限公司

基金托管人:交通银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 -245,128,878.74

2.本期利润 188,105,287.03

3.加权平均基金份额本期利润 0.0137

4.期末基金资产净值 7,998,201,819.83

5.期末基金份额 5,087.2

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

2. 本期已实现收益指基金本期收入扣减交易费用后的金额,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。

3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.1 报告期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

3.2.2 基金合同生效以来基金净值增长率历史变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安策略优选股票型证券投资基金

累计基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比如图 2007年8月2日至2012年12月31日)

图 2007年8月2日至2012年12月31日)

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理助理简介

证券从业年限 限 说明

姓名 职务 任职日期 离任日期

殷鸣 本基金的基金经理 2010-9-20 - 6年 经济学硕士,拥有基金从业人员资格证,2010年证券基金从业资格,在大亚证券研究所担任研究员。2008年8月进入华安基金管理有限公司后,曾担任研究员发展部研究员,2010年9月担任本基金基金经理。

注:本基金的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日起,即以公告为准。

2.证券从业的含义从行业从业、从业人员资格管理办法的相关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作情况的说明

报告期内,本基金严格遵守有关法律法规及《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》、《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法操纵市场、内幕交易、利益输送等违法违规行为。

4.3 公平交易制度的执行情况

4.3.1 公平交易制度的执行情况

4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.3.3 公平交易制度的执行情况

4.3.4 公平交易制度的执行情况

4.3.5 公平交易制度的执行情况

4.3.6 公平交易制度的执行情况

4.3.7 公平交易制度的执行情况

4.3.8 公平交易制度的执行情况

4.3.9 公平交易制度的执行情况

4.3.10 公平交易制度的执行情况

4.3.11 公平交易制度的执行情况

4.3.12 公平交易制度的执行情况

4.3.13 公平交易制度的执行情况

4.3.14 公平交易制度的执行情况

4.3.15 公平交易制度的执行情况

4.3.16 公平交易制度的执行情况

4.3.17 公平交易制度的执行情况

4.3.18 公平交易制度的执行情况

4.3.19 公平交易制度的执行情况

4.3.20 公平交易制度的执行情况

4.3.21 公平交易制度的执行情况

4.3.22 公平交易制度的执行情况

4.3.23 公平交易制度的执行情况

4.3.24 公平交易制度的执行情况

4.3.25 公平交易制度的执行情况

4.3.26 公平交易制度的执行情况

4.3.27 公平交易制度的执行情况

4.3.28 公平交易制度的执行情况

4.3.29 公平交易制度的执行情况

4.3.30 公平交易制度的执行情况

4.3.31 公平交易制度的执行情况

4.3.32 公平交易制度的执行情况

4.3.33 公平交易制度的执行情况

4.3.34 公平交易制度的执行情况

4.3.35 公平交易制度的执行情况

4.3.36 公平交易制度的执行情况

4.3.37 公平交易制度的执行情况

4.3.38 公平交易制度的执行情况

4.3.39 公平交易制度的执行情况

4.3.40 公平交易制度的执行情况

4.3.41 公平交易制度的执行情况

4.3.42 公平交易制度的执行情况

4.3.43 公平交易制度的执行情况

4.3.44 公平交易制度的执行情况

4.3.45 公平交易制度的执行情况

4.3.46 公平交易制度的执行情况

4.3.47 公平交易制度的执行情况

4.3.48 公平交易制度的执行情况

4.3.49 公平交易制度的执行情况

4.3.50 公平交易制度的执行情况

4.3.51 公平交易制度的执行情况

4.3.52 公平交易制度的执行情况

4.3.53 公平交易制度的执行情况

4.3.54 公平交易制度的执行情况

4.3.55 公平交易制度的执行情况

4.3.56 公平交易制度的执行情况

4.3.57 公平交易制度的执行情况

4.3.58 公平交易制度的执行情况

4.3.59 公平交易制度的执行情况

4.3.60 公平交易制度的执行情况

4.3.61 公平交易制度的执行情况

4.3.62 公平交易制度的执行情况

4.3.63 公平交易制度的执行情况

4.3.64 公平交易制度的执行情况

4.3.65 公平交易制度的执行情况

4.3.66 公平交易制度的执行情况

4.3.67 公平交易制度的执行情况

4.3.68 公平交易制度的执行情况

4.3.69 公平交易制度的执行情况

4.3.70 公平交易制度的执行情况

4.3.71 公平交易制度的执行情况

4.3.72 公平交易制度的执行情况

4.3.73 公平交易制度的执行情况

4.3.74 公平交易制度的执行情况

4.3.75 公平交易制度的执行情况

4.3.76 公平交易制度的执行情况

4.3.77 公平交易制度的执行情况

4.3.78 公平交易制度的执行情况

4.3.79 公平交易制度的执行情况

4.3.80 公平交易制度的执行情况

4.3.81 公平交易制度的执行情况

4.3.82 公平交易制度的执行情况

4.3.83 公平交易制度的执行情况

4.3.84 公平交易制度的执行情况

4.3.85 公平交易制度的执行情况

4.3.86 公平交易制度的执行情况

4.3.87 公平交易制度的执行情况

4.3.88 公平交易制度的执行情况

4.3.89 公平交易制度的执行情况

4.3.90 公平交易制度的执行情况

4.3.91 公平交易制度的执行情况

4.3.92 公平交易制度的执行情况

4.3.93 公平交易制度的执行情况

4.3.94 公平交易制度的执行情况

4.3.95 公平交易制度的执行情况

4.3.96 公平交易制度的执行情况

4.3.97 公平交易制度的执行情况

4.3.98 公平交易制度的执行情况

4.3.99 公平交易制度的执行情况

4.3.100 公平交易制度的执行情况

4.3.101 公平交易制度的执行情况

4.3.102 公平交易制度的执行情况

4.3.103 公平交易制度的执行情况

4.