

华安可转换债券债券型证券投资基金

[2012] 第一季度报告

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年四月二十三日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董监会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法律责任。基金合同由基金管理人和基金托管人共同规定，于2012年4月18日复核了本报告中的财务指

标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核后的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未来表现。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。

§2 基金产品概况

基金简称

华安可转债债券

040002

契约型开放式

人民币

2011年6月22日

764,408,626.47份

报告期末基金份额总额

本基金主要投资于具备债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种，在控制风险和维持流动性的同时，力求实现基金资产的长期稳定增值。

本基金主要投资于可转债品种，一方面通过可转债的债券特性，吸收收益的安全性和稳定性，另一方面利用可转债的股票特性(内含期权)，分享股市上

所蕴含的较高成长性。

业绩比较基准 中证转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%

风险收益特征 本基金为债券型基金，其预期的回报水平和预期收益率都低于股票基金，混合基金，高风险的货币市场基金，属于证券投资基金中的中等风险和中等收益的产品。

基金管理人 华安基金管理有限公司

基金托管人 招商银行股份有限公司

下阶段基金的名称 华安可转债债券型证券投资基金

040002

类别

华安可转债债券型证券投资基金

040023

报告期末基金份额总额 560,538,573.06份

报告期末基金份额净值 203,870,053.41份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标

报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

单位:人民币元

华安可转债债券A类 1,-833,574.45 -1,057,171.50

华安可转债债券B类 4,196,942.61 2,140,413.94

1.本期已实现收益 -0.0074 0.0093

2.本期利润 542,538,797.26 196,782,876.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.968 0.965

4.期末基金资产净值 1,057,171.50 1,057,171.50

注:1. 所述基金业业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:封闭式基金交易佣金,开放式基金的申购费、赎回费、转托管费、申购费、赎回费、不含公允价值变动收益)扣除相关费用后

的余额,定期报告中“期末可供分配基金份额总额”即为“期末基金资产净值”。

2. 根据本基金的基金合同,基金净值以人民币计算,因此实现收益、不含公允价值变动收益)扣除相关费用后

的余额,定期报告中“期末可供分配基金份额总额”即为“期末基金资产净值”。

3.2.1 本基金基金资产净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

1.华安可转债债券A类:

2.华安可转债债券B类:

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年6月22日至2012年3月31日

华安可转换债券型证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

2011年6月22日至2012年3月31日

华安可转债债券A类: 华安可转债债券B类:

注:1.本基金管理人于2011年6月22日成立,截至本报告期末,本基金成立不满一年。
2.根据华安可转债债券型证券投资基金基金合同,基金管理人应自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同中约定的投资范围、投资限制的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名

贺涛

2011-6-22

- 14年

担任本基金的基金经理期限

任职日期

离任日期

限

说明

金融学硕士(金融工程方向),14年在长信证券有限责任公司从事研究员,并担任过长信基金管理有限公司基金经理,债券投资经理,风险管理部总监,固定收益投资经理,2008年1月起担任华安可转债债券型证券投资基金的基金经理。2011年6月起同时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,即公告日为准。

2.根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,基金管理人高级管理人员、基金经理等从事投资管理工作的人员不得担任基金托管人。

3.4 公司办公会议说明

4.3 公平交易制度的执行情况

5.根据中国证监会《证券投资基金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、专户客户资产管理组合及其他投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等环节纳入公平交易制度的管理框架,并建立了健全的公平交易监督机制。

6.在研究环节,研究部负责各类型的资产配置,提供研究报告,并通过会议形式,定期对投资组合的交易行为进行合规性审核。

7.在投资决策环节,投资决策委员会定期对投资组合的交易行为进行合规性审核。

8.在交易环节,公司实行公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易机会。

9.在交易监控环节,公司对大宗交易、关联交易、异常交易等交易行为进行监控,并建立相关预警制度,对异常交易行为进行识别和判定,对存在异常交易嫌疑的账户及时进行调查,并视情况采取必要的控制措施。

10.在投资绩效评估环节,公司定期对投资组合的绩效进行评价,并形成评估报告,作为公司内部的考核依据。

11.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

12.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

13.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

14.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

15.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

16.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

17.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

18.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

19.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

20.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

21.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

22.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

23.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

24.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

25.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

26.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

27.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

28.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

29.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

30.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

31.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

32.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

33.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

34.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

35.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

36.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

37.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

38.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

39.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

40.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

41.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

42.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

43.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

44.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

45.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

46.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

47.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

48.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

49.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

50.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

51.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

52.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

53.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

54.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

55.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

56.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

57.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

58.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

59.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

60.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

61.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

62.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

63.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

64.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

65.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

66.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

67.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

68.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

69.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

70.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

71.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

72.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

73.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

74.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。

75.在投资组合的绩效评价过程中,公司定期对基金经理的绩效进行评价,并形成评价报告,作为公司内部的考核依据。