华安强化收益债券型证券投资基金

【2012】年度报告摘要

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:二〇一三年三月二十七日

§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2013年3月20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。

本报告期自2012年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1基金基本情况

基金简称	华安强化收益债券	
基金主代码	040012	
交易代码	040012	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年4月13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	219757741.88份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
下属分级基金的交易代码	040012	040013
报告期末下属分级基金的份额总额	95221429.71份	124536312.17份

2.2基金产品说明

投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过增强信用产品的投资,以获取资产的长期增值。
投资策略	本基金将以宏观经济、市场利率研究主导固定收益资产投资,在控制风险和保持资产流动性的前提下,获取债券市场平均收益;同时在严格的信用评估和利差分析基础上,通过投资于有一定信用风险、具有较高收益率的信用类债券,以获取超越市场平均水平的收益;此外,本基金还将通过积极的新股申购和个股精选来增强基金资产的收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险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,属于证券投资基金中的中低等风险和中低等收益品种。

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		4008800999	95588
传真		021-68863414	010-66105798

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	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

§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 单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012年		2011年		2010年	
	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
本期已实现收益	7475611.40	6081888.92	-2971561.67	-4327711.00	54252179.34	25305334.20
本期利润	10576485.08	9109367.68	-7476409.77	-5246164.93	36608152.94	17123474.30
加权平均基金份额本期利润	0.0767	0.0740	-0.0264	-0.0279	0.0600	0.0598
本期基金份额净值增长率	8.03%	7.61%	-2.15%	-2.65%	5.84%	5.46%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末		2011年末		2010年末	
	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
期末可供分配基金份额利润	0.0525	0.0359	0.0018	-0.0096	0.0243	0.0169
期末基金资产净值	101469797.01	130612473.74	188754176.15	143154216.31	457373900.80	220832746.68
期末基金份额净值	1.066	1.049	1.002	0.990	1.024	1.017

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

华安强化收益债券A:

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	2.50%	0.14%	1.17%	0.13%	1.33%	0.01%
过去六个月	3.19%	0.13%	-0.45%	0.12%	3.64%	0.01%
过去一年	8.03%	0.13%	1.04%	0.13%	6.99%	0.00%
过去三年	11.87%	0.23%	-0.88%	0.15%	12.75%	0.08%
目基金合同生效起至今	17.93%	0.25%	0.85%	0.16%	17.08%	0.09%

华安强化收益债券B:

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	2.44%	0.13%	1.17%	0.13%	1.27%	0.00%
过去六个月	2.94%	0.13%	-0.45%	0.12%	3.39%	0.01%
过去一年	7.61%	0.12%	1.04%	0.13%	6.57%	-0.01%
过去三年	10.48%	0.23%	-0.88%	0.15%	11.36%	0.08%
目基金合同生效起至今	16.13%	0.25%	0.85%	0.16%	15.28%	0.09%

注:本基金业绩比较基准为:中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%

根据本基金合同的有关规定,本基金为债券型基金,投资范围为固定收益类金融工具,包括国内依法发行、上市的国债、金融债、央行票据、企业(公司)债、短期融资券、可转换债券、可分离债券、资产支持证券、次级债、债券回购等,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。基金的投资组合比例限制为:债券类资产的投资比例不低于基金资产的80%。其中,除国债和央行票据以外的信用类固定收益资产投资比例范围不低于基金资产净值的30%;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%。本基金也可投资于非固定收益类金融工具,包括一级市场的新股申购或增发新股、因可转债转股或因权证行权所形成的股票、因持仓股票所派发或因参与可分离债券一级市场申购而产生的权证、二级市场股票等法律法规或监管机构允许投资的其他非固定收益类品种。本基金投资于股票等权益类资产的比例不高于基金资产的20%。本基金的业绩比较基准为:中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%。

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2013年3月26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")、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安强化收益债券型证券投资基金《基金合同》和在财务报表附注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。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012年度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12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4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。

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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》及其他相关财政法规和实务操作,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)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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。

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
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
国泰君安投资管理股份有限公司	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

无。

7.4.8.1.2权证交易

无。

7.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1884712.28	3340182.79
其中:支付销售机构的客户维护费	355749.16	528782.11

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0.7%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x0.7%/当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	538489.27	954337.99

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0.2%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x0.2%/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 2012年1月1日至2012年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B	合计
华安基金管理有限公司	-	99,568.57	99,568.57
中国工商银行股份有限公司	-	241,577.48	241,577.48
合计	-	341,146.05	341,146.05
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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B	合计
华安基金管理有限公司	-	137,641.41	137,641.41
中国工商银行股份有限公司	-	391,631.75	391,631.75
合计	-	529,273.16	529,273.16

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0.4%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x0.4%/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 2012年1月1日至2012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
中国工商银行股份有限公司	-	50,011,403.02	-	-	-	-
	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日					
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国工商银行股份有限公司	9,958,958.90	-	-	-	-	-

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

无。

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

无。

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 2012年1月1日至2012年12月31日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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	2,089,608.73	107,467.10	21,099,531.03	250,201.98

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。

7.4.8.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9期末(2012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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:债券									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127001	海直转债	2012-12-24	2013-01-07	网下新债申购	100.00	100.00	4,120	412,000.00	412,000.00	-

7.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000002	万科A	2012-12-26	公告重大事项	10.12	2013-01-21	11.13	390,000	3,562,633.33	3,946,800.00	-

注:本基金截止至2012年12月31日止有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1银行间市场债券正回购

无。

7.4.9.3.2交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012年12月31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11,000,000.00元,于2013年1月4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。

7.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值,公允价值层级可分为:

第一层级:相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级:直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级:以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

ii)各层次金融工具公允价值

于2012年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为99,862,814.90元,属于第二层级的余额为138,649,300.00元,无属于第三层级的余额(2011年12月31日:第一层级102,107,108.87元,第二层级343,199,000.00元,无属于第三层级的余额)。

iii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层级;非根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

无。

v)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	31,249,102.92	12.69
	其中:股票	31,249,102.92	12.69
2	固定收益投资	207,263,011.98	84.13
	其中:债券	207,263,011.98	84.13
	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	3,216,511.46	1.31
6	其他各项资产	4,617,904.19	1.87
7	合计	246,346,530.55	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	6,875,600.00	2.96
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	901,000.00	0.39
C7	机械、设备、仪表	1,502,600.00	0.65
C8	医药、生物制品	4,472,000.00	1.93
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	10,201,885.25	4.40
J	房地产业	14,171,617.67	6.11
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	31,249,102.92	13.46

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

金额单位:人民币元

代码	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	600208	新湖中宝	1,741,257	7,504,817.67	3.23
2	600016	民生银行	580,000	4,558,800.00	1.96
3	600557	康缘药业	215,000	4,472,000.00	1.93
4	000002	万科A	390,000	3,946,800.00	1.70
5	600837	海通证券	306,301	3,139,585.25	1.35
6	600048	保利地产	200,000	2,720,000.00	1.17
7	601166	兴业银行	150,000	2,503,500.00	1.08
8	600418	江淮汽车	220,000	1,502,600.00	0.65
9	600720	祁连山	85,000	901,000.00	0.39

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于http://www.huaan.com.cn网站的年度报告正文。

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	600030	中信证券	25,358,679.21	7.64
2	600048	保利地产	16,634,406.47	5.01
3	600239	云南城投	13,911,641.70	4.19
4	000002	万科A	11,442,614.80	3.45
5	600809	山西汾酒	10,628,821.03	3.20
6	600383	金地集团	9,491,040.90	2.86
7	002013	中航精机	9,214,904.38	2.78
8	601628	中国人寿	8,332,783.44	2.51
9	000024	招商地产	7,473,776.13	2.25
10	600547	山东黄金	7,445,554.40	2.24
11	000858	五粮液	7,426,494.58	2.24
12	601788	光大证券	7,247,168.75	2.18
13	601601	中国太保	7,128,740.10	2.15
14	600028	中国石化	6,988,900.00	2.11
15	600837	海通证券	6,846,266.81	2.06
16	600585	海螺水泥	6,496,598.70	1.96
17	600208	新湖中宝	6,364,212.07	1.92
18	601318	中国平安	6,138,459.46	1.85
19	000651	格力电器	6,043,390.00	1.82
20	600557	康缘药业	5,072,293.50	1.53

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	600030	中信证券	24,923,267.00	7.51
2	600239	云南城投	15,126,427.92	4.56
3	600048	保利地产	14,065,347.65	4.24
4	600809	山西汾酒	11,334,804.66	3.42
5	002013	中航精机	9,493,352.47	2.86
6	600383	金地集团	9,327,492.93	2.81
7	000002	万科A	8,006,476.72	2.41
8	601628	中国人寿	7,850,975.42	2.37
9	600547	山东黄金	7,625,072.27	2.30
10	000024	招商地产	7,423,589.74	2.24
11	000858	五粮液	7,145,245.40	2.15
12	601788	光大证券	6,944,564.49	2.09
13	600028	中国石化	6,930,319.53	2.09
14	601601	中国太保	6,822,157.38	2.06
15	600585	海螺水泥	6,330,947.99	1.91
16	000651	格力电器	6,015,341.51	1.81
17	601318	中国平安	5,945,059.66	1.79
18	601038	一拖股份	5,151,414.02	1.55
19	600837	海通证券	4,073,917.00	1.23
20	601339	百隆东方	3,590,306.31	1.08

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

买入股票的成本(成交)总额	241,424,571.66
卖出股票的收入(成交)总额	216,182,604.36

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	11,708,710.00	5.05
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	115,541,784.58	49.78
5	企业短期融资券	40,150,000.00	17.30
6	中期票据	20,335,000.00	8.76
7	可转债	19,527,517.40	8.41
8	其他	-	-
9	合计	207,263,011.98	89.31

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	1080099	10锡产业债	200,000	19,860,000.00	8.56
2	122078	11东阳光	172,870	17,354,419.30	7.48
3	122957	09蓉工投	165,420	16,591,626.00	7.15
4	1180100	11清河投资债	150,000	15,073,500.00	6.49
5	019202	12国债02	104,000	10,404,160.00	4.48

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	216,166.84
2	应收证券清算款	518,244.36
3	应收股利	-
4	应收利息	3,382,344.24
5	应收申购款	501,148.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,617,904.19

8.9.4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	110015	石化转债	6,586,240.00	2.84
2	110013	国投转债	3,049,750.00	1.31
3	113003	重工转债	352,247.40	0.15

8.9.5期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000002	万科A	3,946,800.00	1.70	重大事项停牌

§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
华安强化收益债券A	5,790	16,445.84	22,104,669.98	23.21%	73,116,759.73	76.79%
华安强化收益债券B	4,253	29,281.99	30,799,884.00	24.73%	93,736,428.17	75.27%
合计	10,043	21,881.68	52,904,553.98	24.07%	166,853,187.90	75.93%

注:分级基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中,对下属两级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。1.1期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	华安强化收益债券A	-	-
	华安强化收益债券B	776.46	0.0006%
	合计	776.46	0.0004%

注:1、分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中,对下属分级基金,比例的分母采用各自级别的份额,对合计数,比例的分母采用下属分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

2、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。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
基金合同生效日(2009年4月13日)基金份额总额	1,433,106,240.88	1,321,762,427.92
本报告期期初基金份额总额	188,421,267.51	144,545,854.57
本报告期基金总申购份额	294,382,071.53	54,989,858.35
减:本报告期基金总赎回份额	387,581,909.33	74,999,400.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	95,221,429.71	124,536,312.17

§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)、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)、2012年9月24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,秦军先生任华安基金管理有限公司副总经理。秦军先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

3)、2012年9月24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,章国富先生不再担任华安基金管理有限公司督察长,转任华安基金管理有限公司副总经理。章国富先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

4)、2012年9月24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,薛珍女士任华安基金管理有限公司督察长。薛珍女士经中国证监会核准取得高管任职资格。

5)、2012年10月20日,本基金管理人发布关于基金经理变更公告,黄勤先生不再担任本基金的基金经理,苏玉平女士继续管理本基金。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3涉及基金管理人、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:56,000.00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的情况

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

11.7.1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	
长城证券有限责任公司	1	44,554,433.81	9.96%	40,512.57	10.39%	-
中银国际证券有限责任公司	1	16,997,102.87	3.80%	13,961.42	3.58%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	9,241,401.96	2.07%	8,165.28	2.09%	-
国信证券股份有限公司	1	2,985,750.00	0.67%	2,537.78	0.65%	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	1	27,771,222.26	6.21%	24,224.95	6.22%	-
招商证券股份有限公司	1	14,816,671.88	3.31%	12,508.24	3.21%	-
国金证券股份有限公司	1	9,989,595.24	2.23%	8,491.25	2.18%	-
华泰联合证券有限责任公司	1	3,418,869.77	0.76%	2,778.02	0.71%	-
安信证券股份有限公司	1	10,666,267.55	2.38%	8,666.32	2.22%	-
民生证券有限责任公司	1	6,844,484.22	1.53%	5,817.88	1.49%	-
中国中投证券有限责任公司	2	22,166,105.32	4.95%	19,224.37	4.93%	-
宏源证券股份有限公司	1	38,352,280.64	8.57%	34,104.70	8.75%	-
中信证券股份有限公司	1	40,731,611.66	9.10%	36,670.05	9.41%	-
北京高华证券有限责任公司	1	7,308,250.00	1.63%	6,232.20	1.60%	-
东北证券股份有限公司	1	14,383,796.09	3.22%	12,373.95	3.17%	-
齐鲁证券