华安可转换债券债券型证券投资基金

【2013】半年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:招商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年八月二十四日

§ 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2013年8月16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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安可转债债券	
基金主代码	040022	
交易代码	040022	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
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	
报告期末基金份额总额	706,428,458.45份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
下属分级基金的交易代码	040022	040023
报告期末下属分级基金的份额总额	434,124,673.18份	272,303,785.27份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于兼具债券和股票特性的可转债(含分离交易可转债)品种,在控制风险和保持流动性的基础上,力求实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金主要投资于可转债品种,一方面通过利用可转债的债券特性,强调收益的安全性与稳定性,另一方面利用可转债的股票特性(内含股票期权),分享股市上涨所产生的较高收益。
业绩比较基准	天相可转债指数收益率×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,其预期的风险水平和预期收益都要低于股票基金、混合基金,高于货币市场基金,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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	张燕
	联系电话	021-38969999	0755-83199084
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4008850099	95555
传真		021-68863414	0755-83195201

2.4 信息披露方式

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

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(2013年1月1日至2013年6月30日)	
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
本期已实现收益	9,145,698.91	4,500,287.90
本期利润	-19,730,473.13	-27,866,843.48
加权平均基金份额本期利润	-0.0467	-0.1043
本期基金份额净值增长率	-1.25%	-1.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2013年6月30日)	
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
期末可供分配基金份额利润	0.0198	0.0116
期末基金资产净值	444,005,579.29	276,292,217.46
期末基金份额净值	1.023	1.015

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

华安可转债债券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
过去一个月	-11.81%	2.19%	-5.22%	0.85%	-6.59%	1.34%
过去三个月	-9.23%	1.40%	-2.99%	0.61%	-6.24%	0.79%
过去六个月	-1.25%	1.28%	0.56%	0.59%	-1.81%	0.69%
过去一年	3.02%	0.96%	1.68%	0.45%	1.34%	0.51%
自基金合同生效起至今	2.30%	0.74%	-2.97%	0.46%	5.27%	0.28%

华安可转债债券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
过去一个月	-11.82%	2.18%	-5.22%	0.85%	-6.60%	1.33%
过去三个月	-9.29%	1.40%	-2.99%	0.61%	-6.30%	0.79%
过去六个月	-1.55%	1.27%	0.56%	0.59%	-2.11%	0.68%
过去一年	2.53%	0.96%	1.68%	0.45%	0.85%	0.51%
自基金合同生效起至今	1.50%	0.74%	-2.97%	0.46%	4.47%	0.28%

注:本基金业绩比较基准为:天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%。

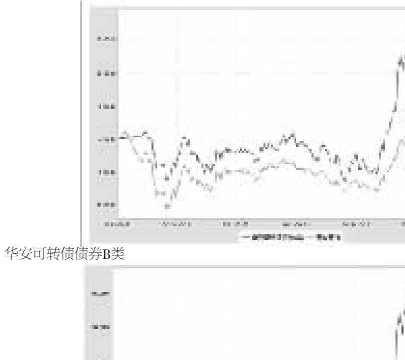
根据基金合同的有关规定,本基金为债券型基金,投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行和上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。重点投资于固定收益类证券,包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、可转债(含分离交易可转债)、资产支持证券、次级债、债券回购、期限在一年期以内的定期存款等。

本基金的投资组合比例限制为:固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。

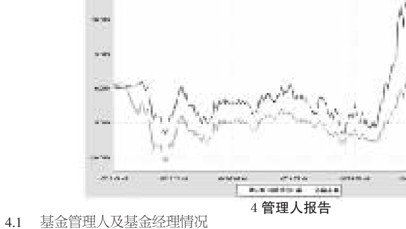
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安可转换债券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
(2011年6月22日至2013年6月30日)

华安可转债债券A类



华安可转债债券B类



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2013年6月30日,公司旗下共管理了华安安顺封闭1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、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券、华安纯债债券、华安保本混合、华安双债添利、华安安信消费等38只开放式基金。管理资产规模达到782.67亿元人民币。

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		
贺涛	本基金的基金经理、固定收益部助理总监	2011-06-22	-	15年	金融学硕士(金融工程方向),15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月起担任华安稳定收益债券基金的基金经理。2011年6月起同时担任本基金的基金经理。2012年12月起同时担任华安信用增强债券型证券投资基金的基金经理。2013年6月起同时担任华安双债添利债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部助理总监。

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《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》、《华安可转换债券债券型证券投资基金基金招募说明书》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

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iwind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单只股票的数量极少,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,?美国经济复苏态势好于预期,就业人数增加、失业率下降、消费信心指数上升。欧洲经济继续疲弱,但渐显触底迹象。日本推行"安倍经济学"大规模QE,日本经济略有提振。美联储QE退出预期不断升温,黄金价格大幅下挫、债券收益收益率上升,美股迭创新高。国内经济疲弱、制造业投资增速下滑,通胀预期消退。社会融资总量增长较快,金融体系中长期风险不断累积。在"促转型、防风险"基调下,政府对经济下滑的容忍度提升,在不刺激经济的同时,一方面推出诸多放权改革措施,另一方面加大了"影子银行"清理力度。相继出台了"地产调控新国五条"、"银监会8号文",加强外汇资金流入管理、加强债市监管等措施。央行货币政策由偏松转向偏紧,公开市场重启正回购操作和央票发行。6月份诸多因素叠加导致资金市场空前紧张,市场恐慌情绪蔓延,回购利率迭创历史新高。6月末央行发布维稳公告,并暂停了公开市场操作,市场逐步恢复正常。上半年债券市场波动较大,1至5月份在流动性宽裕以及经济下行预期的引导下,信用债收益率下行近50BP,6月份受资金面趋紧以及CPI触底走高的共同影响,债市收益率全面上行、基本回到或超过年初水平。可转债市场亦受6月份资金面紧张、股市大幅下挫,以及石化2和平安转债等大盘转债发行获批的影响,可转债指数下跌,基本抹去了前5个月累计的涨幅。

可转债基金组合结构较为均衡,但仓位较高,净值表现不如人意。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金资产净值为7.20亿元,A类份额累计净值1.023,B类份额累计净值1.015,本报告期A类份额净值增长率为-1.25%,B类份额净值增长率为-1.55%,同期业绩比较基准增长率为0.56%。

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,外围经济的复苏有助于中国出口增速的恢复,美国QE的退出也将是渐进和有序的,日本政局的稳定亦将降低日元崩溃所引发局部金融风险的概率。当然在美QE正式宣布退出前,市场预期仍不稳定,资金的流动和再配置容易引发子市场或金融产品价格大幅波动,新兴市场资金外流压力仍较大。为稳定和引导预期,政府提出今年"CPI3.5%上限和GDP7%下限"的宏观管理框架,短期或将出台稳经济的举措,但在经济转型、去产能和降杠杆的大背景下,预计刺激力度不大且更加兼顾中短期效应,央行仍将维持中性偏紧的政策取向。下半年CPI预计将高于上半年但大幅走高的概率不大,外汇占款将面临少增或减少的压力,市场资金面将维持偏紧的格局。利率市场化的推进,中长期看,将有助于降低高信用等级大型企业的融资成本,中小型企业也将更容易地从商业银行获得贷款、增加其经营的稳定性;短期看,受资金面偏紧以及信用资质下降的影响,信用债尤其是中低等级信用债收益率将经历再定价过程,信用利差有扩大的趋势。国债期货的推出或将促进利率现货市场的流动性,增加更多波段性操作机会。下半年随着三中全会的召开和更多立足中长期的重大改革措施出台,资本市场预期将逐渐稳定,成长股或仍将是市场聚焦的重点,大盘蓝筹股也可能将进行估值修复。IPO的重启将为市场创造新的投资机会。可转债市场面临扩容压力,但目前转债"债性"较强具有中期配置价值。下阶段,我们将基于正股基本面结合转债条款,自下而上精选个券。关注符合经济转型方向的环保、医药、电子软件和传媒等成长股投资机会,积极参与新股申购。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副总经理、首席投资官。

翁启森,工业工程学硕士,曾在台湾JP证券任金融产业分析师及投资经理,台湾摩根富林明投信投资管理部任基金经理,台湾中信证券投资总监助理,台湾保德信投信任基金经理。2004年10月进入华安基金管理有限公司,负责QDII基金的投资管理工作。现任华安香港精选基金(QDII)、华安大中华升级基金(QDII)的基金经理、全球投资部总监、基金投资部总监。

杨明,投资研究部总监,研究生学历,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,现任华安优选基金经理、投资研究部总监。

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、华安7日鑫短期理财债券的基金经理、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,华安中国A股增强指数。现任华安上证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

本报告期不进行收益分配。

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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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:华安可转换债券债券型证券投资基金

报告截止日:2013年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012年12月31日
资 产:		
银行存款	5,808,492.74	8,638,952.31
结算备付金	27,317,072.63	10,542,428.37
存出保证金	921,002.39	250,000.00
交易性金融资产	1,477,474,435.61	839,961,262.13
其中:股票投资	133,314,587.21	55,598,742.63
基金投资	-	-
债券投资	1,344,159,848.40	784,362,519.50
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	6,320,511.67	-
应收利息	5,189,717.38	3,840,272.78
应收股利	-	-
应收申购款	4,196,632.20	168,529,348.24
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,527,227,864.62	1,031,762,263.83
负债和所有者权益	本期末 2013年6月30日	上年度末 2012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	799,800,000.00	319,800,000.00
应付证券清算款	-	5,889,553.44
应付赎回款	5,274,063.50	8,278,456.42
应付管理人报酬	501,516.64	330,537.46
应付托管费	143,290.47	94,439.25
应付销售服务费	99,703.20	39,739.00
应付交易费用	283,305.14	152,209.29
应交税费	295,769.60	289,617.60
应付利息	306,591.22	75,753.69
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	225,828.10	621,979.60
负债合计	806,930,067.87	335,572,285.75
所有者权益:		
实收基金	706,428,458.45	673,307,219.72
未分配利润	13,869,338.30	22,882,758.36
所有者权益合计	720,297,796.75	696,189,978.08
负债和所有者权益总计	1,527,227,864.62	1,031,762,263.83

注:报告截止日2013年6月30日,基金份额总额706428458.45份,其中华安可转换债券A份额总额434124673.18份,华安可转换债券B份额总额272303785.27份。华安可转换债券A份额净值1.023元,华安可转换债券B份额净值1.015元。

6.2 利润表

会计主体:华安可转换债券债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
一、收入	-34,336,313.31	32,880,429.46
1.利息收入	5,098,036.46	3,945,045.27
其中:存款利息收入	352,332.77	124,653.37
债券利息收入	4,468,378.70	3,578,134.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	277,324.99	242,257.60
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	21,707,341.20	-4,467,679.93
其中:股票投资收益	-2,881,058.37	-5,532,543.48
基金投资收益	-	-
债券投资收益	23,875,746.36	756,103.52
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	712,653.21	308,760.03
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-61,243,303.42	33,378,314.89
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	101,612.45	24,749.23
减:二、费用	13,261,003.30	6,364,058.89
1.管理人报酬	2,680,913.39	2,656,987.09
2.托管费	765,975.30	759,139.16
3.销售服务费	518,566.42	385,082.50
4.交易费用	1,219,035.34	711,919.84
5.利息支出	7,908,316.38	1,668,668.35
其中:卖出回购金融资产支出	7,908,316.38	1,668,668.35
6.其他费用	168,196.47	182,261.95
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-47,597,316.61	26,516,370.57
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-47,597,316.61	26,516,370.57

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安可转换债券债券型证券投资基金

本报告期:2013年1月1日至2013年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013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)	673,307,219.72	22,882,758.36	696,189,978.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-47,597,316.61	-47,597,316.61
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)	33,121,238.73	38,583,896.55	71,705,135.28
其中:1.基金申购款	1,323,162,811.21	172,222,669.49	1,495,385,480.70
2.基金赎回款	-1,290,041,572.48	-133,638,772.94	-1,423,680,345.42
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)	706,428,458.45	13,869,338.30	720,297,796.75
项目	上年度可比期间 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)	794,543,583.32	-32,087,122.13	762,456,461.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,516,370.57	26,516,370.57
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)	-140,787,053.96	643,996.38	-140,143,057.58
其中:1.基金申购款	198,880,423.08	-3,303,232.15	195,577,190.93
2.基金赎回款	-339,667,477.04	3,947,228.53	-335,720,248.51
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)	653,756,529.36	-4,926,755.18	648,829,774.18

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:章国富,会计机构负责人:陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安可转换债券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[2011]第606号《关于核准华安可转换债券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《华安可转换债券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1,287,722,831.15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(2011)第251号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》于2011年6月22日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,287,981,171.43份基金份额,其中认购资金利息折合258,340.28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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《华安可转换债券债券型证券投资基金基金合同》和《华安可转换债券债券型证券投资基金招募说明书》,本基金根据费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的,称为A类;在投资者认购/申购时不收取认购/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类、B类两种收费模式并存,各类基金份额分别计算基金份额净值。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《华安可转换债券债券型证券投资基金合同》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,包括国内依法发行和上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,固定收益类资产的投资比例不低于基金资产的80%,其中对可转债(含分离交易可转债)的投资比例不低于固定收益类资产的80%;股票、权证等非固定收益类资产的投资比例不高于基金资产的20%;现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:天相可转债指数收益率×60%+中证综合债券指数收益率×30%+沪深300指数收益率×10%。

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8月23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》、《华安可转换债券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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年1月1日至2013年6月30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2013年6月30日的财务状况以及2013年1月1日至2013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》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作,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。2013年1月1日以前,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。自2013年1月1日起,对基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。@(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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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
招商银行股份有限公司("招商银行")	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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

无。

6.4.8.1.2权证交易

无。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,680,913.39	2,656,987.09
其中:支付销售机构的客户维护费	1,047,299.97	1,059,976.98

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×0.7% / 当年天数。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2013年1月1日至2013年6月30日	上年度可比期间 2012年1月1日至2012年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	765,975.30	759,139.16

注:支付基金托管人招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×0.2% / 当年天数。

6.4.8.2.3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 2013年1月1日至2013年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类	合计
华安基金管理有限公司	-	117,959.55	117,959.55
招商银行股份有限公司	-	105,801.51	105,801.51
合计	-	223,761.06	223,761.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类	合计
华安基金管理有限公司	-	57,146.47	57,146.47
招商银行股份有限公司	-	160,314.18	160,314.18
合计	-	217,460.65	217,460.65

注: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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2013年1月1日至2013年6月30日		上年度可比期间 2012年1月1日至2012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
招商银行股份有限公司	5,808,492.74	173,436.60	3,592,536.73	96,590.26

注:本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2013年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2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
600292	中电远达	2013-06-05	公告重大事项	19.37	2013-07-01	17.50	1,100,000	19,144,782.46	21,307,000.00	-

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年6月30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799,800,000.00元,分别于2013年7月4日前后到期。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。

6.4.10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	133,314,587.21	8.73
	其中:股票	133,314,587.21	8.73
2	固定收益投资	1,344,159,848.40	88.01
	其中:债券	1,344,159,848.40	88.01
	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	33,125,565.37	2.17
6	其他各项资产	16,627,863.64	1.09
7	合计	1,527,227,864.62	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	采矿业	-	-
C	制造业	26,726,130.21	3.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	38,713,400.00	5.37
E	建筑业	26,656,000.00	3.70
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,978,800.00	1.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,433,995.00	0.48
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	27,806,262.00	3.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	133,314,587.21	18.51

7.3 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

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	601117	中国化学	2,800,000	26,656,000.00	3.70
2	600292	中电远达	1,100,000	21,307,000.00	2.96
3	002573	国电清新	1,200,000	19,536,000.00	2.71
4	000669	金鸿能源	460,000	17,406,400.00	2.42
5	002368	太极股份	520,000	9,978,800.00	1.39
6	600066	宇通客车	500,000	9,165,000.00	1.27
7	300187	永清环保	397,800	8,270,262.00	1.15
8	600388	龙净环保	230,663	5,229,130.21	0.73
9	600252	中恒集团	300,000	4,164,000.00	0.58
10	002055	得润电子	400,000	4,100,000.00	0.57

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于www.huaan.com.cn网站的半年度报告正文。

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	601117	中国化学	33,286,658.11	4.78
2	002573	国电清新	25,348,653.31	3.64
3	600048	保利地产	20,051,113.69	2.88
4	600292	中电远达	19,144,782.46	2.75
5	600422	昆明制药	18,712,029.05	2.69
6	601006	大秦铁路	17,749,994.00	2.55
7	000669	金鸿能源	16,880,820.51	2.42
8	600030	中信证券	16,515,162.27	2.37
9	000001	平安银行	16,097,639.36	2.31
10	600066	宇通客车	11,972,376.60	1.72
11	601166	兴业银行	11,959,680.00	1.72
12	300203	聚光科技	11,516,322.89	1.65
13	300088	长信科技	11,206,604.22	1.61
14	600199	金种子酒	10,896,755.59	1.57
15	601998	中信银行	10,800,000.00	1.55
16	002646	青青稞酒	10,767,231.02	1.55
17	601158	重庆水务	10,708,296.22	1.54
18	600801	华新水泥	10,668,153.51	1.53
19	601989	中国重工	10,058,452.02	1.44
20	002368	太极股份	9,978,758.00	1.43

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	600048	保利地产	42,668,029.09	6.13
2	600292	中电远达	20,157,979.31	2.90
3	600422	昆明制药	19,396,827.36	2.79
4	600208	新湖中宝	18,580,354.29	2.67
5	601006	大秦铁路	17,726,843.03	2.55
6	600030	中信证券	15,158,497.10	2.18
7	000001	平安银行	14,231,364.05	2.04
8	300088	长信科技	11,570,909.45	1.66
9	600801	华新水泥	10,861,969.51	1.56
10	601989	中国重工	10,743,150.96	1.54
11	601166	兴业银行	10,722,000.00	1.54
12	300136	信维通信	9,914,529.00	1.42
13	600199	金种子酒	9,787,334.34	1.41
14	600795	国电电力	9,724,107.44	1.40
15	601998	中信银行	9,675,872.50	1.39
16	002646	青青稞酒	9,133,584.82	1.31
17	600332	广州药业	9,030,488.73	1.30
18	600557	康缘药业	9,000,763.01	1.29
19	600867	通化东宝	8,647,871.84	1.24
20	601158	重庆水务	8,457,566.38	1.21

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	452,834,791.60
卖出股票的收入(成交)总额	372,748,957.21

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	39,880,000.00	5.54
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	162,423,650.80	22.55
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	1,141,856,197.60	158.53
8	其他	-	-
9	合计	1,344,159,848.40	186.61

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	113002	工行转债	1,765,030	193,058,981.40	26.80
2	110018	国电转债	1,796,130	193,048,052.40	26.80
3	110015	石化转债	1,849,510	184,618,088.20	25.63
4	110023	民生转债	1,733,590	180,206,680.50	25.02
5	113003	重工转债	1,436,200	157,005,384.00	21.80

7.7 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。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期没有投资股指期货。

7.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.10 投资组合报告附注

7.10.1 本基金投资的中恒集团(600252)因重大事项(合同)履行过程中风险提示不及时、不充分,遭到上海证券交易所公开谴责。

7.10.2 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。

7.10.3期末其他各项资产构成

序号	名称	金额
1	存出保证金	921,002.39
2	应收证券清算款	6,320,511.67
3	应收股利	-
4	应收利息	5,189,717.38
5	应收申购款	4,196,632.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,627,863.64

7.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	193,058,981.40	26.80
2	110018	国电转债	193,048,052.40	26.80
3	110015	石化转债	184,618,088.20	25.63
4	113003	重工转债	157,005,384.00	21.80
5	110016	川投转债	89,440,320.00	12.42
6	110020	南山转债	59,946,000.00	8.32
7	113001	中行转债	50,055,000.00	6.95
8	110022	同仁转债	34,477,691.10	4.79

7.10.5 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	600292	中电远达	21,307,000.00	2.96	重大事项停牌

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

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
华安可转债债券A类	9,152	47,434.95	93,654,785.11	21.57%	340,469,888.07	78.43%
华安可转债债券B类	6,140	44,349.15	51,815,557.11	19.03%	220,488,228.16	80.97%
合计	15,292	46,195.95	145,470,342.22	20.59%	560,958,116.23	79.41%

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两级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 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开放式基金	华安可转债债券A类	177,426.68	0.04%
	华安可转债债券B类	231,547.27	0.09%
	合计	408,973.95	0.06%

1、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两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。

9 开放式基金份额变动

单位:份

项目	华安可转债债券A类	华安可转债债券B类
基金合同生效日(2011年6月22日)基金份额总额	706,745,673.56	581,235,497.87
本报告期期初基金份额总额	390,605,250.66	282,701,969.06
本报告期基金总申购份额	507,646,630.40	815,516,180.81
减:本报告期基金总赎回份额	464,127,207.88	825,914,364.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	434,124,673.18	272,303,785.27

注:总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

10 重大事件揭示

10.1 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。

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:

无。

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

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

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	
中信证券股份有限公司	2	825,583,748.81	100.00%	745,423.59	100.00%	-

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。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

无。

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
中信证券股份有限公司	2,816,522,280.80	100.00%	23,252,000,000.00	100.00%	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一三年八月二十四日