

安信证券投资基金 2008 年年度报告摘要

2008 年 12 月 31 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

送出日期： 2009 年 3 月 26 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 2009 年 3 月 24 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。

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。

本年度报告已经普华永道中天会计师事务所有限公司审计。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ...	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
7.4 报表附注	17
§ 8 投资组合报告	21
8.1 期末基金资产组合情况	21
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	21
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	22
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	23
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	24
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	25
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	25
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	25
8.9 投资组合报告附注	25
§ 9 基金份额持有人信息	26

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	26
9.2 期末上市基金前十名持有人	26
§ 10 重大事件揭示	27
10.1 基金份额持有人大会决议	27
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	27
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	27
10.4 基金投资策略的改变	27
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	27
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	27
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	28

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	基金安信
交易代码	500003
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998 年 6 月 22 日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000 份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1998 年 6 月 26 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险，确保基金资产的安全，并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金为成长型基金，本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于国债的比例控制在基金资产净值的 20-50%，股票资产的比例控制在 45-80%，现金比例根据运作情况调整。在股票资产中，70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期 GDP 增长率的上市公司股票。

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	蒋松云
	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		40088-50099	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	http://www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

§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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
本期已实现收益	437,901,405.50	3,256,255,025.56	843,371,595.07
本期利润	-2,026,254,078.50	3,974,838,712.90	2,320,611,273.28
加权平均基金份额本期利润	-1.0131	1.9874	1.1603
本期基金份额净值增长率	-41.08%	104.24%	111.13%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年
期末可供分配基金份额利润	0.2799	1.2302	0.4221
期末基金资产净值	2,559,724,036.31	6,725,978,114.81	4,391,139,401.91
期末基金份额净值	1.2799	3.3630	2.1956

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
过去三个月	-7.36%	3.97%	-	-	-	-
过去六个月	-18.51%	3.15%	-	-	-	-
过去一年	-41.08%	3.21%	-	-	-	-
过去三年	154.07%	3.27%	-	-	-	-
过去五年	169.06%	2.90%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	510.67%	2.64%	-	-	-	-

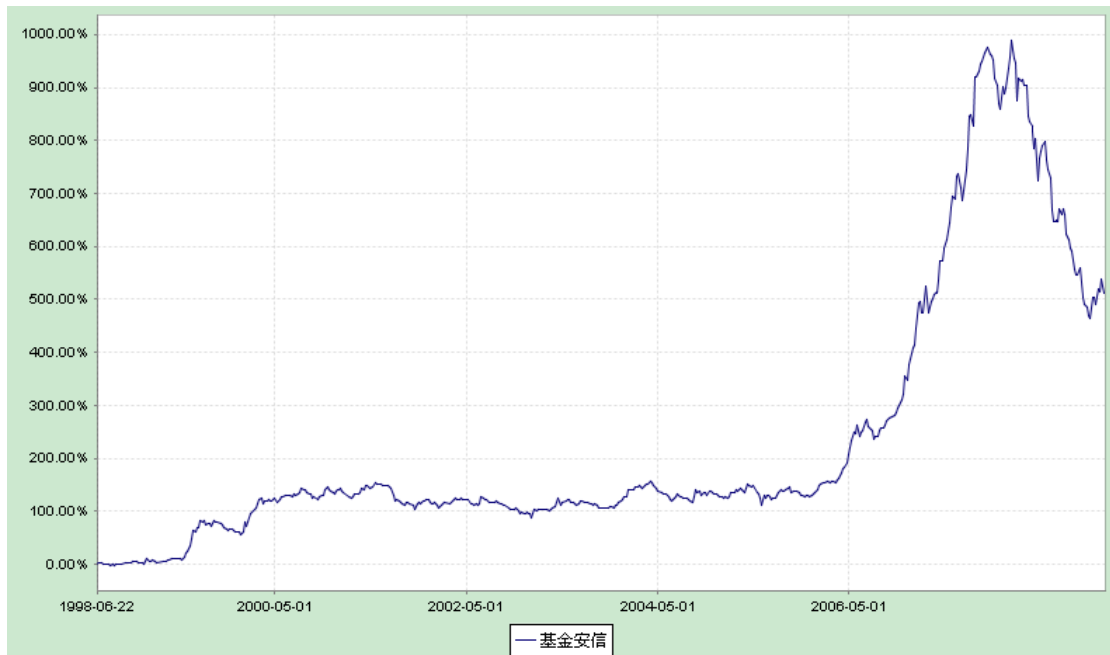
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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

安信证券投资基金

份额累计净值增长率历史走势图

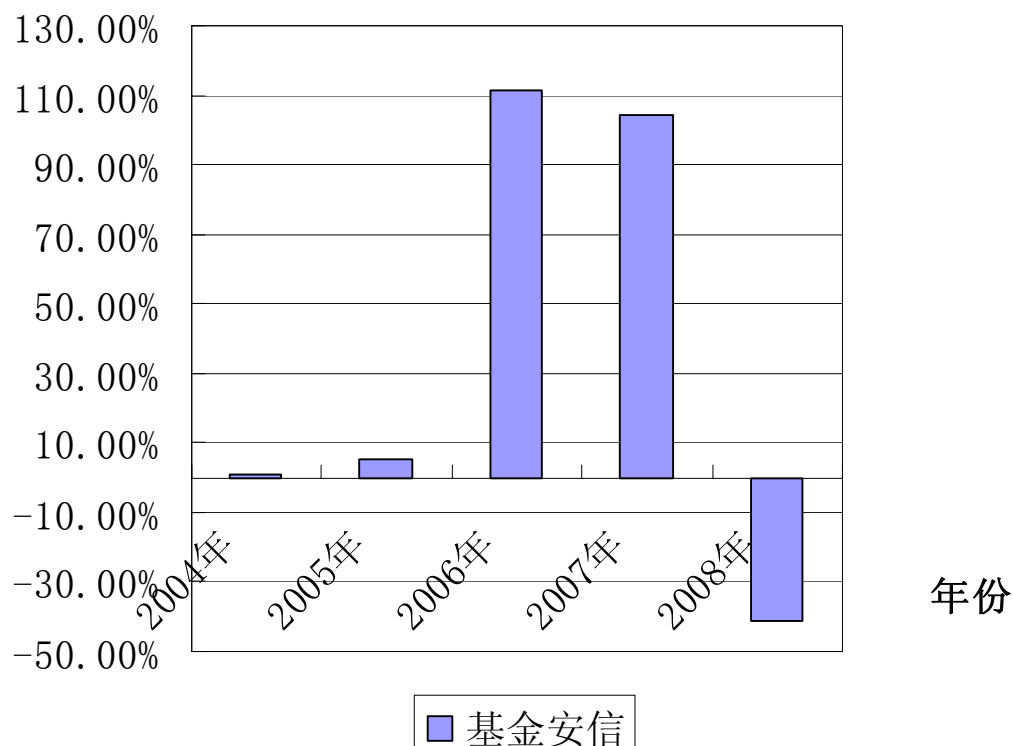
(1998 年 6 月 22 日至 2008 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

基金安信过往5年每年的净值增长率的柱状图

净值增长率



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2008年	10.700	2,140,000,000.00	-	2,140,000,000.00	-
2007年	8.200	1,640,000,000.00	-	1,640,000,000.00	-
2006年	0.290	58,000,000.16	-	58,000,000.16	-
合计	19.190	3,838,000,000.16	-	3,838,000,000.16	-

§ 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上海沸点投资发展有限公司。

截至 2008 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺 2 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、上证 180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等 11 只开放式基金，管理资产规模达到 694.94 亿人民币、0.97 亿美元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘新勇	本基金的基金经理	2007 年 4 月 18 日	2008 年 2 月 13 日	12 年	硕士，持有基金从业人员资格证书，12 年证券从业经历。曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999 年 5 月加入华安基金管理有限公司后，曾任研究发展部高级研究员，2002 年 11 月至 2003 年 9 月担任华安上证 180 指数增强型证券投资基金（后更名为华安 MSCI 中国 A 股指数增强型证券投资基金）的基金经理，2003 年 9 月起担任华安创新的基金经理，2007 年 4 月至 2008 年 2 月担任本基金的基金经理。
陈俏宇	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	-	13 年	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，12 年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、基金安顺和华安宏利基金经理助理，2007 年 3 月至 2008 年 2 月担任基金安顺、华安宏利基金经理，2008 年 2 月起担任本基金的基金经理，2008 年 10 月 22 日起同时兼任华安核心基金

					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《安信证券投资基金基金合同》、《安信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

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端基金间公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金间公平交易系统模块，不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端基金间公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

华安旗下以成长为投资风格的有 3 个基金：华安成长、华安创新、基金安信。08 年度，基金净值增长率分别为：华安成长基金-57.68%、华安创新基金-45.44%、安信基金-41.08%。虽然同属于成长类投资风格，但三基金在基金合同中资产配置的限制上存在较大差异：基金安信和华安创新股票仓位的最高上限都是 80%，没有最低限制；而华安成长的股票投资限制为 60%-95%。2008 年内，三基金的股票平均仓位分别是：基金安信和华安创新 60%上下、华安成长 80%左右。安信和华安创新的仓位比较接近，所以业绩差异小。华安成长仓位偏高，及组合在结构上与其他两个基金的差异，导致净值跌幅较大。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

2008 年中国经历了雪灾、512 地震等的考验，同时和全球一起经历了由美国次贷引发的金融和经济危机的冲击，尤其是下半年以来实体经济受到的负面影响在涉及面上和程度上均超出预期，宏观经济形势严峻。由于投资者信心匮乏，即使政策面在三、四季度有所调整，也无助于 A 股市场的修复，全年沪深两市基本呈现单边下行，且出

现巨幅下跌。A 股市场的跌幅之大，跌速之快基本上创下了历史之最。

本基金在报告期内整体上采取了偏保守的投资策略，主要表现为较严格地控制股票投资仓位，降低受外需冲击较大的强周期行业的配置比重，偏向防御类行业的配置等措施。尽管如此，也未能完全规避市场的系统性风险。我们在 2008 年的操作中深刻体会了“敬畏市场”的涵义。

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 2009 年，我们认为在各阶段，市场预期与现实经济数据需要进行检验与较量，从而获得新的平衡区间。一方面我们相信中国政府会持续出台各类积极政策，引领中国走出全球危机的影响，但另一方面由于全球经济一体化的发展模式影响之深，以及实体经济的投资信心也需要时间来修复，我们认为经济恢复的过程可能会持续较长时间，并出现多次阶段性的调整。基于此，我们认为 A 股市场全年将呈现出震荡态势，演绎翘翘板行情。同时，结构性的投资机会将更多体现在：短期内的政府投资拉动型受益行业，中长期内以产业转型为代表的新兴行业、改善民生行业等方面。我们认为尤其值得关注那些有助于帮助中国跨越中等收入陷阱，调整与确立新的国家竞争力的产业，这其中也会诞生出一批经洗礼的优秀企业。

基于上述分析，我们将持续关注宏观与微观的经济数据及信号，在股票仓位上保持相对灵活的调整。同时，我们也将积极关注各类产业政策导向，把握在经济修复各阶段受益最敏感行业的投资机会，以及经济增长模式转变过程中的优质企业的投资价值。我们希望寻找到既符合产业发展方向，又在这轮金融和经济危机中被证明具有良好风险控制能力、战略调整能力、决策执行能力的企业。

作为安信基金的管理人，我将继续秉承努力回报基金持有人的传统，勤勉尽责地履行管理人的职责，力争以良好的业绩和分红回报持有人。

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：

根据中国证监会 [2008] 年 38 号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，经与托管银行协商，自 2008 年 9 月 16 日起，对本基金的估值原则作如下调整：

(1) 估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，以最近交易日的收盘价估值。

(2) 估值日无交易，且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，参考《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》，采用指数收益法，调整最近交易日收盘价，确定公允价值进行估值。

如有确凿证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实反映股票的公允价值，基金将与基金托管行协商采用其它估值方法，对停牌股票进行估值。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响

从 2008 年 9 月 16 日至 12 月 31 日，按照调整后的估值原则，本基金对持有的长期停牌的股票估值进行了调整，调整后对本基金的净值及本报告期损益产生的影响如下：

(1) 长江电力，影响本报告期损益 -6,160,000.00，影响基金净值比例 -0.24%；

(2) 盐湖钾肥，影响本报告期损益-250,000.00，影响基金净值比例-0.01%；

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、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部负责人、金融工程部负责人、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：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998 年加入华安基金管理有限公司，曾任基金安信的基金经理、华安 180 指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

尚志民，基金投资部总经理，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，基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理，现任基金安顺、华安宏利的基金经理，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，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，现任研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部负责人，经济学硕士，12 年银行、基金从业经历。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，现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。

许之彦，金融工程部负责人，理学博士，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 股基金经理，金融工程部负责人。

朱永红，基金运营部总经理，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理有限公司，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

1、本报告期内应分配收益为本年已实现收益的 90%，对应分配但尚未实施的利润，本基金拟在年度收益分配中实施相关的收益分配。

2、报告期内已实施的利润分配情况如下：

(1) 2007 年度第三次分红，每 10 份基金份额派发现金红利 3.00 元，共派发现金红利 600,000,000.00 元。

(2) 2007 年度分红，每 10 份基金份额派发现金红利 7.70 元，共派发现金红利 1,540,000,000.00 元。

3、2008 年度应分配但尚未实施的收益分配安排如下：

向全体持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 2.60 元，共派发现金红利 520,000,000.00 元。红利发放的公告日：2009 年 3 月 25 日，权益登记日：2009 年 3 月 30 日，除息交易日：2009 年 3 月 31 日，红利发放日：2009 年 4 月 7 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

2008 年，本基金托管人在对安信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

2008 年，安信证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在安信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，安信证券投资基金对基金份额持有人进行了两次利润分配，分配金额共计 2,140,000,000.00 元。

5.3 托管人对本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安信证券投资基金 2008 年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 审计报告

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师薛竞、金毅签字出具了普华永道中天审字(2009)第 20101 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安信证券投资基金

报告截止日：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	162,599,380.95	272,391,700.30
结算备付金	1,918,651.57	8,324,830.39
存出保证金	848,780.49	1,706,013.40
交易性金融资产	2,401,742,590.33	6,434,632,416.37
其中：股票投资	1,504,032,978.53	5,038,289,098.27
基金投资	-	-
债券投资	897,709,611.80	1,396,343,318.10
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	-	-
应收利息	15,872,397.09	21,780,136.17
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,582,981,800.43	6,738,835,096.63
负债和所有者权益	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 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	-	-
应付证券清算款	16,080,268.70	-

应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	3,297,528.25	8,242,060.97
应付托管费	549,588.05	1,373,676.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,360,379.12	1,071,244.00
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,970,000.00	2,170,000.00
负债合计	23,257,764.12	12,856,981.82
所有者权益：		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	559,724,036.31	4,725,978,114.81
所有者权益合计	2,559,724,036.31	6,725,978,114.81
负债和所有者权益总计	2,582,981,800.43	6,738,835,096.63

注：报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2799 元，基金份额总额 2,000,000,000 份。

后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

7.2 利润表

会计主体：安信证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
一、收入	-1,921,449,964.77	4,137,780,813.19
1. 利息收入	45,477,552.32	40,102,854.80
其中：存款利息收入	3,927,545.99	4,426,496.90
债券利息收入	41,121,347.38	35,533,518.07
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	428,658.95	142,839.83
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	497,220,226.94	3,378,477,456.51
其中：股票投资收益	473,738,578.87	3,287,206,969.76
基金投资收益	-	-
债券投资收益	9,614,136.80	-14,599,347.07
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	26,462.94	78,394,402.00

股利收益	13,841,048.33	27,475,431.82
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-2,464,155,484.00	718,583,687.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7,739.97	616,814.54
二、费用（以“-”号填列）	-104,804,113.73	-162,942,100.29
1. 管理人报酬	-57,472,335.27	-88,699,324.72
2. 托管费	-9,578,722.54	-14,783,220.85
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	-26,956,768.55	-32,342,793.76
5. 利息支出	-5,495,484.59	-21,697,569.39
其中：卖出回购金融资产支出	-5,495,484.59	-21,697,569.39
6. 其他费用	-5,300,802.78	-5,419,191.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-2,026,254,078.50	3,974,838,712.90
所得税费用（以“-”号填列）	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-2,026,254,078.50	3,974,838,712.90

注：后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安信证券投资基金

本报告期：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 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）	2,000,000,000.00	4,725,978,114.81	6,725,978,114.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,026,254,078.50	-2,026,254,078.50
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
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）	-	-2,140,000,000.00	-2,140,000,000.00
五、期末所有者权益（基金	2,000,000,000.00	559,724,036.31	2,559,724,036.31

净值)			
项目	上年度可比期间		
	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 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）	2,000,000,000.00	2,391,139,401.91	4,391,139,401.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,974,838,712.90	3,974,838,712.90
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-	-	-
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）	-	-1,640,000,000.00	-1,640,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	2,000,000,000.00	4,725,978,114.81	6,725,978,114.81

注：后附 7.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

7.4 报表附注

7.4.1 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

本报告期内发生如下会计估计的变更：

根据中国证监会公告[2008]38 号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金自 2008 年 9 月 16 日起变更特殊事项停牌股票公允价值的确定方法，从按停牌前最后交易日的收盘价估值改按《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法估值。

上述会计估计变更导致本基金持有的特殊事项停牌股票的公允价值于 2008 年 9 月 16 日下调 27,520,000.00 元，相应调减本基金的净利润 27,520,000.00 元和基金资产净值 27,520,000.00 元。

除以上变更外，本报告期所采用的会计政策和其他会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 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	基金管理人、基金发起人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

上海国际信托有限公司(“上海国际信托”)	基金管理人的股东、基金发起人
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
上海沸点投资发展有限公司	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

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。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.3.1.1 股票交易

本基金本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日)均无应支付关联方的佣金。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	57,472,335.27	88,699,324.72
其中：当期已支付	54,174,807.02	80,457,263.75
期末未支付	3,297,528.25	8,242,060.97

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 1.5%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 X 1.5% / 当年天数。如持有现金比例高于基金资产净值的 20%(由于卖出回购证券和现金分红的原因造成可以除外)，超出部分不计提基金管理人报酬。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	9,578,722.54	14,783,220.85
其中：当期已支付	9,029,134.49	13,409,544.00
期末未支付	549,588.05	1,373,676.85

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 0.25% 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 $\times$ 0.25% / 当年天数。

7.4.3.3 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

本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 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	125,594,461.49	98,025,885.56	-	-	321,600,000.00	397,175.55
上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 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	259,734,437.67	-	-	-	3,571,415,746.15	5,609,861.57

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	14,433,600.00	14,433,600.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-

期末持有的基金份额	14,433,600.00	14,433,600.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.72%	0.72%

7.4.3.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2008 年 12 月 31 日		上年度末 2007 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
上海国际信托有 限公司	18,000,000.00	0.90%	18,000,000.00	0.90%

7.4.3.5 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 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 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	162,599,380.95	3,839,435.58	272,391,700.30	4,268,724.40

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券 代码	证券 名称	发行 方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券 代码	证券 名称	发行 方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.4 期末（2008 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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：股票									
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

600169	太原重工	2008-12-31	2009-12-29	非公开发行	12.67	12.68	1,500,000	19,005,000.00	19,020,000.00
--------	------	------------	------------	-------	-------	-------	-----------	---------------	---------------

注：本报告期内本基金未持有流通受限债券及其他流通受限证券。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌股票

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
600900	长江电力	2008-05-08	公告重大 事项	7.35	未知	未知	880,000	12,788,998.59	6,468,000.00
000792	盐湖钾肥	2008-06-26	公告重大 事项	56.78	2008-12-26	78.23	1,000,000	15,759,226.89	56,780,000.00

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于 2008 年 12 月 31 日采用指数收益法估值。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板，当日的收盘价为每股 37.99 元。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2008 年 12 月 31 日止，本基金无债券正回购，因此无债券作为抵押。

§ 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	1,504,032,978.53	58.23
	其中：股票	1,504,032,978.53	58.23
2	固定收益投资	897,709,611.80	34.75
	其中：债券	897,709,611.80	34.75
	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	164,518,032.52	6.37
6	其他资产	16,721,177.58	0.65
7	合计	2,582,981,800.43	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	98,967,589.52	3.87
C	制造业	658,287,320.55	25.72
C0	食品、饮料	102,486,656.65	4.00
C1	纺织、服装、皮毛	13,530,000.00	0.53
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	184,367,304.94	7.20
C5	电子	10,998,000.00	0.43
C6	金属、非金属	44,469,100.00	1.74
C7	机械、设备、仪表	176,005,978.84	6.88
C8	医药、生物制品	108,542,080.12	4.24
C99	其他制造业	17,888,200.00	0.70
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,015,000.00	0.31
E	建筑业	128,997,358.50	5.04
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	112,391,127.34	4.39
H	批发和零售贸易	75,195,630.00	2.94
I	金融、保险业	213,575,367.50	8.34
J	房地产业	100,160,319.77	3.91
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	20,959,075.25	0.82
M	综合类	87,484,190.10	3.42
	合计	1,504,032,978.53	58.76

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

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	601088	中国神华	4,298,988	75,404,249.52	2.95
2	600895	张江高科	6,900,990	68,940,890.10	2.69
3	600519	贵州茅台	610,000	66,307,000.00	2.59
4	601169	北京银行	6,790,000	60,498,900.00	2.36
5	000792	盐湖钾肥	1,000,000	56,780,000.00	2.22
6	600000	浦发银行	3,799,990	50,349,867.50	1.97
7	600820	隧道股份	4,593,977	50,074,349.30	1.96
8	600309	烟台万华	4,700,000	47,000,000.00	1.84
9	002038	双鹭药业	1,280,000	46,950,400.00	1.83
10	000002	万科A	6,980,000	45,021,000.00	1.76

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	600036	招商银行	227,919,185.70	3.39
2	601088	中国神华	214,655,119.99	3.19
3	600519	贵州茅台	143,100,792.19	2.13
4	000800	一汽轿车	139,440,384.70	2.07
5	000983	西山煤电	102,661,488.54	1.53
6	601390	中国中铁	76,527,176.63	1.14
7	002024	苏宁电器	74,379,200.34	1.11
8	601328	交通银行	72,979,171.80	1.09
9	601186	中国铁建	70,282,175.69	1.04
10	600900	长江电力	69,792,626.67	1.04
11	601628	中国人寿	67,565,498.40	1.00
12	600895	张江高科	67,330,168.85	1.00
13	600770	综艺股份	66,668,777.39	0.99
14	600019	宝钢股份	61,426,217.86	0.91
15	600000	浦发银行	61,160,136.06	0.91
16	600271	航天信息	59,083,431.65	0.88
17	601169	北京银行	56,338,512.88	0.84
18	600015	华夏银行	54,970,797.99	0.82
19	002073	青岛软控	51,935,203.90	0.77
20	600325	华发股份	51,856,978.59	0.77

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	600036	招商银行	370,538,928.11	5.51
2	000002	万科A	266,663,442.90	3.96
3	601318	中国平安	203,801,651.06	3.03
4	601699	潞安环能	194,125,114.44	2.89
5	600426	华鲁恒升	189,392,897.71	2.82
6	600383	金地集团	185,989,635.50	2.77
7	000069	华侨城A	167,720,294.10	2.49

8	600309	烟台万华	155,514,442.33	2.31
9	000422	湖北宜化	154,142,314.30	2.29
10	002007	华兰生物	150,560,678.08	2.24
11	600000	浦发银行	146,006,960.48	2.17
12	601919	中国远洋	132,745,055.84	1.97
13	600252	中恒集团	131,707,913.45	1.96
14	600052	浙江广厦	119,249,672.86	1.77
15	600066	宇通客车	118,199,838.09	1.76
16	600030	中信证券	110,295,736.20	1.64
17	000537	广宇发展	98,123,404.37	1.46
18	600009	上海机场	91,880,441.35	1.37
19	000800	一汽轿车	85,277,699.75	1.27
20	600015	华夏银行	76,842,646.91	1.14

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

买入股票成本（成交）总额	3,668,513,592.24
卖出股票收入（成交）总额	5,163,043,174.06

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	170,264,611.80	6.65
2	央行票据	266,685,000.00	10.42
3	金融债券	409,760,000.00	16.01
	其中：政策性金融债	409,760,000.00	16.01
4	企业债券	51,000,000.00	1.99
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	897,709,611.80	35.07

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	0801044	08 央票 44	1,000,000	106,850,000.00	4.17
2	0801023	08 央票 23	1,000,000	106,490,000.00	4.16
3	080308	08 进出 08	600,000	64,704,000.00	2.53
4	080202	08 国开 02	500,000	55,705,000.00	2.18
5	080216	08 国开 16	500,000	53,800,000.00	2.10

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存在受到公开谴责、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 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	848,780.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,872,397.09
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	16,721,177.58

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	000792	盐湖钾肥	56,780,000.00	2.22	股票交易未能体现活跃市场交易特征

注：青海盐湖钾肥股份有限公司股票自 2008 年 12 月 26 日复牌至 2008 年 12 月 31 日证券交易所闭市时连续跌停且成交量极低，故作为流通受限证券列示且于 2008 年 12 月 31 日采用指数收益法估值。该股票于 2009 年 1 月 8 日打开跌停板，当日的收盘价为每股 37.99 元。

§ 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

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
76,970	25,984	748,931,251	37.45%	1,251,068,749	62.55%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	131,971,220	6.60%
2	中国人寿保险 (集团) 公司	92,788,629	4.64%
3	中国平安保险 (集团) 股份有限公司	68,099,790	3.40%
4	国泰君安—招行—国泰君安君得益优选基金集合资产管理计划	56,146,291	2.81%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司	51,133,612	2.56%
6	UBS AG	47,037,328	2.35%
7	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	44,248,574	2.21%
8	全国社保基金六零一组合	32,517,744	1.63%
9	宝钢集团有限公司	26,750,000	1.34%
10	光大永明人寿保险有限公司	24,834,850	1.24%

§ 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：

(1). 2008 年 6 月 10 日，本基金管理人发布关于董事和监事变更的公告，经本公司股东会审议，选举马名驹先生担任本公司董事，顾培柱先生不再担任本公司董事；选举李梅清女士担任本公司监事，戴金宝先生不再担任本公司监事。

(2). 2009 年 1 月 12 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(3). 2009 年 2 月 19 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

(4). 2008 年 2 月 13 日，本基金管理人发布关于基金经理调整的公告，聘任陈俏宇女士担任安信证券投资基金的基金经理，刘新勇先生不再担任安信证券投资基金的基金经理职务。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：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

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：100,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2007 年 6 月 5 日起至今。

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

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

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	
上海证券有限责任公司	1	1,531,643,587.52	17.53%	1,301,887.11	17.77%	
中国银河证券股份有限公司	1	844,267,006.92	9.66%	685,974.67	9.36%	
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
申银万国证券股份有限公司	1	71,331,381.55	0.82%	57,957.20	0.79%	
光大证券股份有限公司	1	1,446,187,757.99	16.55%	1,229,253.57	16.78%	
国信证券股份有限公司	2	1,174,467,036.00	13.44%	976,665.68	13.33%	
海通证券股份有限公司	1	720,537,444.25	8.24%	612,454.93	8.36%	
国泰君安证券股份有限公司	1	686,922,709.22	7.86%	583,881.00	7.97%	
红塔证券股份有限公司	1	374,405,448.22	4.28%	318,247.75	4.34%	
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	
中银国际证券有限责任公司	1	1,210,870,892.25	13.86%	983,840.81	13.43%	
中国建银投资证券有限责任公司	1	678,628,976.87	7.77%	576,834.28	7.87%	

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		回购交易		权证交易		备注
		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	
上海证券有限责任公司	1	12,044,359.30	2.37%	605,000,000.00	28.79%	-	-	
中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-	

招商证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-	-
申银万国证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-	-
光大证券股份 有限公司	1	223,059,561.20	43.95%	300,000,000.00	14.28%	72,499.38	100%	
国信证券股份 有限公司	2	4,627,257.40	0.91%	451,000,000.00	21.46%	-	-	
海通证券股份 有限公司	1	227,202,026.90	44.76%	340,000,000.00	16.18%	-	-	
国泰君安证券 股份有限公司	1	-	-	-	-	-	-	
红塔证券股份 有限公司	1	40,623,403.70	8.00%	-	-	-	-	
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-	-	
中银国际证券 有限责任公司	1	-	-	-	-	-	-	
中国建银投资 证券有限责任 公司	1	-	-	405,200,000.00	19.28%	-	-	

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

由研究发展部/市场部分别牵头并组织相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》

研究发展部或基金投资部/市场部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研究发展部或基金投资部/市场部提交的《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《证券交易单元使用协议》, 并通知基金托管人。

3、本报告期内无新增和退租的交易单元。

华安基金管理有限公司
2009 年 3 月 26 日