

华安创新证券投资基金 2009 年半年度报告

2009 年 6 月 30 日

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

送出日期：2009 年 8 月 28 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 27 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
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.....	12
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表.....	12
6.2	利润表.....	13
6.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4	报表附注.....	15
§ 7	投资组合报告	29
7.1	期末基金资产组合情况.....	29
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	30
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
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.....	34
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	34
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.....	34
7.9	投资组合报告附注.....	34
§ 8	基金份额持有人信息	35
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	35
§ 9	开放式基金份额变动	35
§ 10	重大事件揭示	35
10.1	基金份额持有人大会决议.....	35
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.....	35
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4	基金投资策略的改变.....	36
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	36
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	36
10.8	其他重大事件.....	38
§ 11	备查文件目录	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安创新证券投资基金	
基金简称	华安创新混合	
交易代码	040001 (前端)	041001 (后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2001 年 9 月 21 日	
报告期末基金份额总额	11,618,730,514.90 份	

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>基金管理人将以分散投资风险，提高基金资产的安全性，并积极追求投资收益的稳定增长为目标，以诚信原则及专业经营方式，将本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法公开发行的、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。</p>
投资策略	<p>本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益，通过建立科学合理的投资组合，为投资者降低和分散投资风险，提高基金资产的安全性。</p> <p>这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。</p> <p>高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。</p> <p>传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。</p> <p>本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务市场空间大，财务状况良好，具有相当竞</p>

	争优势等。 本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=75%×中信标普 300 指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-68888917
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-50099	95559
传真		021-68863414	021-58408842
注册地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		俞妙根	胡怀邦

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	华安基金管理有限公司
办公地址	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼

§ 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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
---------------	-------------------------------------

本期已实现收益	-196,617,217.33
本期利润	2,116,734,674.13
加权平均基金份额本期利润	0.1668
本期加权平均净值利润率	26.52%
本期基金份额净值增长率	30.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期（2009年1月1日-2009年6月30日）
期末可供分配利润	3,090,384,157.62
期末可供分配基金份额利润	0.2660
期末基金资产净值	8,247,744,702.21
期末基金份额净值	0.710
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009年1月1日-2009年6月30日）
基金份额累计净值增长率	269.36%

注：

1、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

2、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字

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
过去一个月	5.65%	0.76%	10.57%	0.89%	-4.92%	-0.13%
过去三个月	12.34%	1.04%	18.90%	1.14%	-6.56%	-0.10%
过去六个月	30.51%	1.18%	53.64%	1.45%	-23.13%	-0.27%
过去一年	5.03%	1.38%	11.41%	1.90%	-6.38%	-0.52%
过去三年	109.70%	1.53%	99.57%	1.81%	10.13%	-0.28%
自基金合同生效起至今	269.36%	1.18%	94.26%	1.39%	175.10%	-0.21%

注：

本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。

根据本基金合同的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%；投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。

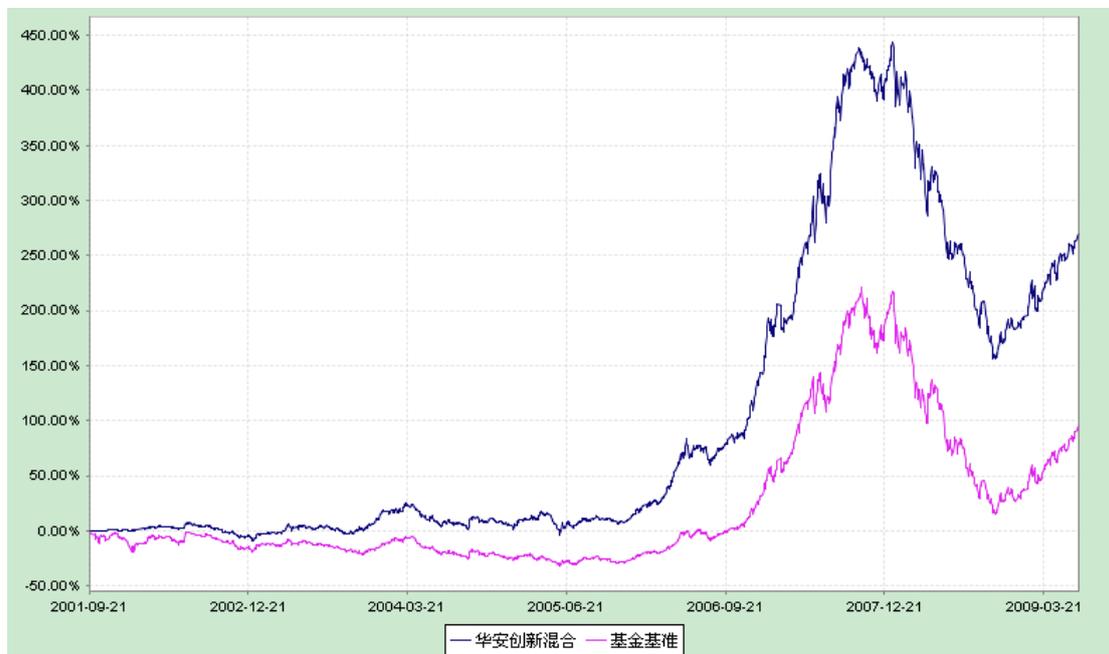
截至 2009 年 6 月 30 日，本基金投资于股票等权益资产占基金净资产 71.44%，权证投资比例为 0.00%，投资于国债和政策性金融债占基金净资产 23.93%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

华安创新证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2001 年 9 月 21 日至 2009 年 6 月 30 日)



§ 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 2009 年 6 月 30 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新股票、华安中国 A 股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证 180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安国际配置(QDII) 等 12 只开放式基金，管理资产规模达到 790.62 亿人民币、0.972 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	2003 年 9 月 18 日	2009 年 3 月 27 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 月至 2009 年 3 月担任本基金的基金经理,2007 年 4 月至 2008 年 2 月期间曾担任安信证券投资基金的基金经理。
汪光成	本基金的 基金经理	2009 年 3 月 27 日	-	7 年	管理学博士,持有基金从业资格证书,7 年证券、基金行业从业经历,2002 年 1 月加入华安基金管理有限公司后,曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008 年 2 月-2009 年 3 月担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2009 年 3 月 27 日起担任本基金的基金经理。

注: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。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《华安创新证券投资基金基金合同》、《华安创新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、账户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：华安中小盘成长股票、华安创新混合、基金安信封闭。09 年上半年，三基金净值增长率分别为：华安中小盘成长股票 56.75%、华安创新混合 30.51%、华安安信封闭 36.24%，华安中小盘成长股票的增长率高于华安创新混合和华安安信封闭。股票仓位的差异是三基金业绩差异较大的主要原因。上半年内，华安中小盘成长股票、华安创新混合和华安安信封闭的股票仓位的比例平均仓位为 77.68%、60.72%与 70.60%，华安中小盘成长股票的平均持仓比例明显要高于另外两个基金。

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

2009 年上半年，国家实施了宽松的货币政策和积极的财政政策，出台了多个产业振兴规划，国内经济开始止跌回升，而不断超预期的信贷投放和复苏特征的日渐显现，使得 A 股市场保持强势上涨。在此期间，在充裕的资金和业绩复苏预期驱动下，行业和板块热点频现，呈现“乱花渐欲迷人眼”的态势。

本报告期内，本基金的基金经理进行了更换，由于前期组合的防御特征比较明显且仓位比较低，基于市场特征的变化，对组合进行了大幅度的调整，减持了食品饮料、医药等，增持了周期性行业，同时对银行股的配置结构进行了调整，但由于在组合调整过程中对市场的转折性趋势认识不深刻，且在配置过程中过于注重风险控制和组合行业的均衡性，对强势行业没有进行充分配置，使得股票组合比例不高且组合的进攻性不足，同时对配置的一些行业如房地产、煤炭、有色金属等股票的上涨幅度估计不足，过早的进行了减持，这在很大程度上影响了基金净值的上涨幅度。

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 年下半年，国内经济复苏特征明显，刺激市场上涨的三大因素货币流动性、政策和复苏预期依然存在，市场将可能围绕经济或行业复苏不断演绎结构性行情，但市场同时也在业绩和预期之间经受考验，而在持续宽松的货币政策下，通胀预期开始出现，国家政策可能出现一些微调，虽然对宏观经济运行趋势影响不大，但可能对投资者情绪产生重要影响。在这些因素的作用下，我们判断市场仍然将保持强势特征，但震荡可能会加剧。

基于上述判断，本基金在总体资产配置上保持较高仓位，并根据经济的复苏进程和国家政策的变化对行业配置比例进行调整。一方面，金融行业仍然将作为重点配置行业，房地产、钢铁和一些资源类行业也将作为基本行业配置，但配置比例将根据市场变化进行调整；另一方面，下半年固定资产和房地产投资的加快将明显拉动对中下游行业产品的需求，而出口复苏进程也可能超过预期，相关行业如建材、机械、家电和一些化工产品将明显受益，同时，在经济复苏过程中，一些行业也可能出现拐点，如电力等行业。本基金将围绕这些主线进行积极操作，在个股选择标准方面主要考虑行业复苏的可能性和公司业绩变化的潜在趋势、以及业绩增长可预见性和可持续性等等。

最后想说的是，作为本基金的新任基金经理，上半年遇到了一些困难，包括操作上的和心理上的，但本人相信，困难和挫折是暂时的，而信心、努力和坚韧不拔才能使得困难变得渺小，相信创新业绩会走出上半年的低迷，争取为投资者取得良好的回报。

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本报告期损益的影响：

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：

姓名	职务	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，13 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

本报告期由于基金投资当期亏损，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

2009 年上半年度，基金托管人在华安创新证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2009 年上半年度，华安基金管理有限公司在华安创新证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2009 年上半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关华安创新证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 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：华安创新证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.6.1	135,669,462.49	530,257,164.25
结算备付金		191,076,639.39	5,539,093.77
存出保证金		2,790,529.31	1,648,908.58
交易性金融资产	6.4.6.2	7,956,592,687.87	6,707,670,478.69
其中：股票投资		5,960,016,558.67	3,461,207,558.39
基金投资		-	-
债券投资		1,996,576,129.20	3,246,462,920.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.6.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.6.4	-	-

应收证券清算款		17,171,430.19	-
应收利息	6.4.6.5	34,842,410.90	60,821,381.21
应收股利		2,664,314.96	-
应收申购款		1,763,835.90	671,760.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.6.6	-	-
资产总计		8,342,571,311.01	7,306,608,786.99
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末
		2009年6月30日	2008年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.6.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		64,691,714.71	140,490,958.66
应付赎回款		10,256,652.41	1,585,468.38
应付管理人报酬	6.4.9.2.1	10,129,808.55	9,190,284.95
应付托管费	6.4.9.2.2	1,688,301.41	1,531,714.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.6.7	6,886,264.71	4,015,842.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.6.8	1,173,867.01	1,021,589.75
负债合计		94,826,608.80	157,835,858.74
所有者权益:			
实收基金	6.4.6.9	2,703,637,907.91	3,059,772,856.80
未分配利润	6.4.6.10	5,544,106,794.30	4,089,000,071.45
所有者权益合计		8,247,744,702.21	7,148,772,928.25
负债和所有者权益总计		8,342,571,311.01	7,306,608,786.99

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.710 元，基金份额总额 11,618,730,514.90 份。

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

6.2 利润表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2009年1月1日至	2008年1月1日至2008

		2009 年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、收入		2,211,424,682.53	-4,254,868,396.67
1. 利息收入		49,042,138.91	60,404,257.77
其中：存款利息收入	6.4.6.11	3,643,712.16	6,741,186.10
债券利息收入		45,398,426.75	53,663,071.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-152,157,986.00	-1,562,057,262.60
其中：股票投资收益	6.4.6.12	-220,697,846.48	-1,588,105,471.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	35,777,058.90	1,512,893.81
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	136,199.42
股利收益	6.4.6.15	32,762,801.58	24,399,115.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	2,313,351,891.46	-2,757,143,461.81
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,188,638.16	3,928,069.97
二、费用（以“-”号填列）		-94,690,008.40	-151,867,724.50
1. 管理人报酬		-59,142,149.00	-88,849,823.00
2. 托管费		-9,857,024.78	-14,808,303.83
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		-25,453,095.61	-39,166,465.42
5. 利息支出		-	-8,793,518.62
其中：卖出回购金融资产支出		-	-8,793,518.62
6. 其他费用		-237,739.01	-249,613.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,116,734,674.13	-4,406,736,121.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,116,734,674.13	-4,406,736,121.17

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

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安创新证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 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）	3,059,772,856.80	4,089,000,071.45	7,148,772,928.25

二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	2,116,734,674.13	2,116,734,674.13
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)	-356,134,948.89	-661,627,951.28	-1,017,762,900.17
其中: 1. 基金申购款	34,319,124.21	58,562,410.87	92,881,535.08
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-390,454,073.10	-720,190,362.15	-1,110,644,435.25
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)	2,703,637,907.91	5,544,106,794.30	8,247,744,702.21
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 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)	3,364,097,609.57	11,051,219,465.26	14,415,317,074.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-4,406,736,121.17	-4,406,736,121.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (减少以“-”号填列)	-231,715,079.40	-675,538,588.30	-907,253,667.70
其中: 1. 基金申购款	75,516,809.71	180,199,663.57	255,716,473.28
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-307,231,889.11	-855,738,251.87	-1,162,970,140.98
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)	3,132,382,530.17	5,968,944,755.79	9,101,327,285.96

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安创新证券投资基金(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”)证监基金字[2001]第 33 号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》(后更名为《华安创新证券投资基金基金合同》)发起,并于 2001 年 9 月 21 日募集成立。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 5,000,001,124.00 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2001)第 84 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《华安创新证券投资基金招募说明书》和《华安创新证券投资基金基金份额拆分公告》的有关规定,本基金于 2007 年 10 月 26 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1: 4.297369516,并于 2007 年 10 月 29 日进行了份额变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创新证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资

产总值的 80%；投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。本基金的业绩比较基准为中信标普 300 指数收益率 \times 75%+中信标普国债指数收益率 \times 25%。

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 2009 年 8 月 27 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”)、中国证监会基金部通知[2009]4 号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安创新证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 上半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 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 上半年度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半年度报告一致。

6.4.5 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]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (a) 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。
- (b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- (c) 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。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。
- (d) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

- (e) 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）
活期存款	135,669,462.49
定期存款	-
其他存款	-
合计	135,669,462.49

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）			
	成本	公允价值	估值增值	
股票	4,902,576,475.09	5,960,016,558.67	1,057,440,083.58	
债券	交易所市场	140,923,269.43	143,140,129.20	2,216,859.77
	银行间市场	1,839,243,980.00	1,853,436,000.00	14,192,020.00
	合计	1,980,167,249.43	1,996,576,129.20	16,408,879.77
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	6,882,743,724.52	7,956,592,687.87	1,073,848,963.35	

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

6.4.6.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末（2009年6月30日）买入返售金融资产余额为零。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）
应收活期存款利息	54,301.02
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	47,881.62
应收债券利息	34,739,962.42
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	233.26
其他	32.58
合计	34,842,410.90

6.4.6.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）
其他应收款	-
待摊费用	-
合计	-

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）
交易所市场应付交易费用	6,879,089.71
银行间市场应付交易费用	7,175.00
合计	6,886,264.71

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2009年6月30日）
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付深圳通信费	72,000.00
预提费用	343,149.47
应付赎回费	8,717.54
合计	1,173,867.01

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,148,931,633.62	3,059,772,856.80

本期申购	147,469,423.21	34,319,124.21
本期赎回	-1,677,670,541.93	-390,454,073.10
本期末	11,618,730,514.90	2,703,637,907.91

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,674,840,128.26	414,159,943.19	4,089,000,071.45
本期利润	-196,617,217.33	2,313,351,891.46	2,116,734,674.13
本期基金份额交易产生的变动数	-387,838,753.31	-273,789,197.97	-661,627,951.28
其中：基金申购款	36,924,802.25	21,637,608.62	58,562,410.87
基金赎回款	-424,763,555.56	-295,426,806.59	-720,190,362.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,090,384,157.62	2,453,722,636.68	5,544,106,794.30

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
活期存款利息收入	1,132,827.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,509,038.92
其他	1,845.81
合计	3,643,712.16

6.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
卖出股票成交总额	8,199,159,519.71
卖出股票成本总额	-8,419,857,366.19
买卖股票差价收入	-220,697,846.48

注：本基金于本半年度未获得股权分置改革中由非流通股股东支付的现金对价。

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	3,057,598,700.88
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-2,962,798,979.44
应收利息总额	-59,022,662.54
债券投资收益	35,777,058.90

6.4.6.14 衍生工具收益

6.4.6.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
卖出权证成交金额	-
卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	-

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
股票投资产生的股利收益	32,762,801.58
基金投资产生的股利收益	-
合计	32,762,801.58

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
1. 交易性金融资产	
——股票投资	2,405,992,630.13
——债券投资	-92,640,738.67
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	
——权证投资	-
合计	2,313,351,891.46

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
基金赎回费及转换费收入*	1,174,679.86
印花税返还	1,549.35
其他	12,408.95
合计	1,188,638.16

*注：本基金的赎回费率按持有期间递减，基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，赎回费在扣除不超过赎回总金额的0.1%的基金注册与过户登记费后的余额列入基金资产。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
交易所市场交易费用	25,431,995.61
银行间市场交易费用	21,100.00
合计	25,453,095.61

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)
信息披露费	148,765.71
审计费用	74,383.76
银行划款手续费	5,589.54
债券托管账户维护费	9,000.00
合计	237,739.01

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

无。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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 (“华安基金公司”)	基金管理人 基金销售机构 基金注册登记机构
交通银行股份有限公司 (“交通银行”)	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。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

本报告期通过关联人交易单元的股票成交量：无。

上年度可比期间通过关联人交易单元的股票成交量：无

6.4.9.1.2 权证交易

本报告期通过关联人交易单元的权证成交量：无。

上年度可比期间通过关联人交易单元的权证成交量：无。

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期应支付关联方的佣金：无。

上年度可比期间应支付关联方的佣金：无。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)	上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)
当期应支付的管理费	59,142,149.00	88,849,823.00
其中：当期已支付	49,012,340.45	76,936,065.41
期末未支付	10,129,808.55	11,913,757.59

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的基金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：
 日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)	上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)
当期应支付的托管费	9,857,024.78	14,808,303.83
其中：当期已支付	8,168,723.37	12,822,677.56
期末未支付	1,688,301.41	1,985,626.27

注：支付基金托管人交通银行的基金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：
 日基金托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.9.3 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(2009年1月1日至2009年6月30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
交通银行	110,094,346.58	71,580,426.44	-	-	-	-
上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)						
银行间市场交	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

易的各关联方名称	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	297,480,000.00	99,892,538.46	-	-	785,600,000.00	417,121.32

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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(2009年1月1日至2009年6月30日)	上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)
期初持有的基金份额	15,260,320.32	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	7,196,909.85	-
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	22,457,230.17	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%	-

注：1、基金管理人华安基金管理有限公司在本半年度运用自有资金 4,200,000.00 元经代销机构购入本基金 7,196,909.85 份基金份额，申购费 25,049.70 元，申购费率 0.6%
 2、申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额

6.4.9.4.2 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

本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。
 上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况：无。

6.4.9.5 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(2009年1月1日至2009年6月30日)		上年度可比期间(2008年1月1日至2008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
交通银行	135,669,462.49	1,132,827.43	796,737,523.59	4,419,088.59

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2009 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2008 年 6 月 30 日：同)。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内买入的管理人、托管人的控股股东在承销期内担任副主承销商或分销商所承销的证券和管理人、托管人的主要股东（非控股）在承销期内承销的股票等：无。

6.4.10 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	利润分配合计	备注
-	-	-	-	-	-	-	-

6.4.11 期末（2009 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

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（股）	期末成本总额	期末估值总额
600239	云南城投	2009 年 4 月 14 日	2010 年 4 月 12 日	非公开发行	15.18	13.34	5,000,000	75,900,000.00	66,700,000.00
600239	云南城投	2009 年 6 月 16 日	2010 年 4 月 12 日	非公开发行送股转增部分	-	13.34	2,500,000	-	33,350,000.00

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无持有的暂时停牌股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无正回购余额。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只偏股型的证券投资基金，属于中等风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.12.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注期末本基金持有的流通受限证券中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可

通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.12.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.12.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末（2009年6月30日）	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	135,669,462.49	-	-	-	135,669,462.49
结算备付金	191,076,639.39	-	-	-	191,076,639.39
存出保证金	103,913.63	-	-	2,686,615.68	2,790,529.31
交易性金融资产	352,027,534.00	1,335,679,595.20	308,869,000.00	5,960,016,558.67	7,956,592,687.87
应收利息	-	-	-	34,842,410.90	34,842,410.90
应收股利	-	-	-	2,664,314.96	2,664,314.96
应收清算款	-	-	-	17,171,430.19	17,171,430.19
应收申购款	1,049,624.58	-	-	714,211.32	1,763,835.90
资产总计	679,927,174.09	1,335,679,595.20	308,869,000.00	6,018,095,541.72	8,342,571,311.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	64,691,714.71	64,691,714.71
应付赎回款	-	-	-	10,256,652.41	10,256,652.41
应付管理人报酬	-	-	-	10,129,808.55	10,129,808.55

应付托管费	-	-	-	1,688,301.41	1,688,301.41
应付交易费用	-	-	-	6,886,264.71	6,886,264.71
其他负债	-	-	-	1,173,867.01	1,173,867.01
负债总计	-	-	-	94,826,608.80	94,826,608.80
利率敏感度缺口	679,927,174.09	1,335,679,595.20	308,869,000.00	5,923,268,932.92	8,247,744,702.21
上年度末(2008年12月31日)	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	530,257,164.25	-	-	-	530,257,164.25
结算备付金	5,539,093.77	-	-	-	5,539,093.77
存出保证金	101,282.05	-	-	1,547,626.53	1,648,908.58
交易性金融资产	1,137,509,388.50	1,576,726,815.00	532,226,716.80	3,461,207,558.39	6,707,670,478.69
应收利息	-	-	-	60,821,381.21	60,821,381.21
应收申购款	355,070.18	-	-	316,690.31	671,760.49
资产总计	1,673,761,998.75	1,576,726,815.00	532,226,716.80	3,523,893,256.44	7,306,608,786.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	140,490,958.66	140,490,958.66
应付赎回款	-	-	-	1,585,468.38	1,585,468.38
应付管理人报酬	-	-	-	9,190,284.95	9,190,284.95
应付托管费	-	-	-	1,531,714.14	1,531,714.14
应付交易费用	-	-	-	4,015,842.86	4,015,842.86
其他负债	-	-	-	1,021,589.75	1,021,589.75
负债总计	-	-	-	157,835,858.74	157,835,858.74
利率敏感度缺口	1,673,761,998.75	1,576,726,815.00	532,226,716.80	3,366,057,397.70	7,148,772,928.25

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币万元)	
		本期末(2009年6月30日)	上年度末(2008年12月31日)
	市场利率下降25个基点	增加246	增加2,583
	市场利率上升25个基点	下降243	下降2,540

6.4.12.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响,也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中,采用“自上而下”的策略,通

通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中股票、债券投资比例不低于基金资产总值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。于 2009 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.12.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	5,960,016,558.67	72.26	3,461,207,558.39	48.42
交易性金融资产-债券投资	1,996,576,129.20	24.21	3,246,462,920.30	45.41
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,956,592,687.87	96.47%	6,707,670,478.69	93.83

6.4.12.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币亿元)
本期末 (2009 年 6 月 30 日)			上年度末 (2008 年 12 月 31 日)
业绩比较基准上升 5%		增加约 2.83	增加约 2.56
业绩比较基准下降 5%		下降约 2.85	下降约 2.56

§ 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	5,960,016,558.67	71.44
	其中：股票	5,960,016,558.67	71.44
2	固定收益投资	1,996,576,129.20	23.93
	其中：债券	1,996,576,129.20	23.93
	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	326,746,101.88	3.92
6	其他资产	59,232,521.26	0.71
7	合计	8,342,571,311.01	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	采掘业	524,095,957.53	6.35
C	制造业	1,743,718,025.12	21.14
C0	食品、饮料	124,597,902.00	1.51
C1	纺织、服装、皮毛	34,000,000.00	0.41
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	86,972,294.46	1.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	119,382,511.45	1.45
C5	电子	76,593,442.99	0.93
C6	金属、非金属	228,977,089.27	2.78
C7	机械、设备、仪表	758,454,194.54	9.20
C8	医药、生物制品	258,985,349.91	3.14
C99	其他制造业	55,755,240.50	0.68
D	电力、煤气及水的生产和供应业	313,441,482.21	3.80
E	建筑业	35,028,879.02	0.42
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	303,255,776.60	3.68

H	批发和零售贸易	354,473,173.85	4.30
I	金融、保险业	1,851,383,841.76	22.45
J	房地产业	541,999,375.52	6.57
K	社会服务业	24,300,000.00	0.29
L	传播与文化产业	127,705,654.32	1.55
M	综合类	140,614,392.74	1.70
	合计	5,960,016,558.67	72.26

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600000	浦发银行	26,911,907	619,512,099.14	7.51
2	600016	民生银行	48,000,000	380,160,000.00	4.61
3	601318	中国平安	5,500,000	272,030,000.00	3.30
4	601169	北京银行	14,000,000	227,640,000.00	2.76
5	002024	苏宁电器	14,069,666	226,099,532.62	2.74
6	000651	格力电器	10,425,000	217,882,500.00	2.64
7	600196	复星医药	14,099,959	204,308,405.91	2.48
8	601899	紫金矿业	20,000,000	204,000,000.00	2.47
9	600675	中华企业	11,700,000	186,732,000.00	2.26
10	601168	西部矿业	11,000,000	167,640,000.00	2.03
11	002202	金风科技	5,007,830	150,835,839.60	1.83
12	600067	冠城大通	10,055,916	130,626,348.84	1.58
13	000002	万科A	10,000,000	127,500,000.00	1.55
14	601918	国投新集	6,911,019	113,962,703.31	1.38
15	600036	招商银行	5,000,000	112,050,000.00	1.36
16	601998	中信银行	18,007,882	107,507,055.54	1.30
17	600795	国电电力	15,080,418	105,110,513.46	1.27
18	600239	云南城投	7,500,000	100,050,000.00	1.21
19	601988	中国银行	20,002,692	89,812,087.08	1.09
20	600308	华泰股份	8,097,979	86,972,294.46	1.05
21	600718	东软集团	4,526,197	81,154,712.21	0.98
22	600309	烟台万华	5,000,000	78,850,000.00	0.96
23	000911	南宁糖业	5,000,000	75,050,000.00	0.91
24	600570	恒生电子	6,000,000	71,940,000.00	0.87
25	600588	用友软件	3,786,931	71,913,819.69	0.87
26	600549	厦门钨业	3,665,390	67,992,984.50	0.82
27	600739	辽宁成大	2,000,000	66,240,000.00	0.80
28	600880	博瑞传播	3,000,000	63,570,000.00	0.77
29	600635	大众公用	5,344,027	62,578,556.17	0.76

30	600005	武钢股份	7,893,649	62,201,954.12	0.75
31	000009	中国宝安	4,999,944	59,299,335.84	0.72
32	600153	建发股份	4,333,145	58,627,451.85	0.71
33	600031	三一重工	2,000,000	57,540,000.00	0.70
34	600208	新湖中宝	5,000,470	55,755,240.50	0.68
35	000402	金融街	3,999,990	55,039,862.40	0.67
36	000028	一致药业	2,892,960	54,676,944.00	0.66
37	600478	科力远	2,793,139	50,723,404.24	0.61
38	600238	海南椰岛	4,467,800	49,547,902.00	0.60
39	600202	哈空调	3,500,000	49,525,000.00	0.60
40	600660	福耀玻璃	6,000,000	49,260,000.00	0.60
41	600037	歌华有线	4,000,000	46,040,000.00	0.56
42	600325	华发股份	2,000,000	45,180,000.00	0.55
43	000527	美的电器	3,000,000	42,900,000.00	0.52
44	600030	中信证券	1,510,000	42,672,600.00	0.52
45	600649	城投控股	3,000,000	41,370,000.00	0.50
46	600315	上海家化	1,880,859	40,532,511.45	0.49
47	600089	特变电工	2,000,000	36,080,000.00	0.44
48	600266	北京城建	2,058,101	35,028,879.02	0.42
49	000726	鲁泰 A	4,000,000	34,000,000.00	0.41
50	601088	中国神华	1,000,000	29,910,000.00	0.36
51	000983	西山煤电	1,000,000	29,900,000.00	0.36
52	600123	兰花科创	846,639	29,860,957.53	0.36
53	000839	中信国安	2,000,000	29,480,000.00	0.36
54	600019	宝钢股份	4,000,000	28,160,000.00	0.34
55	000027	深圳能源	2,500,593	27,906,617.88	0.34
56	600320	振华重工	2,600,000	27,040,000.00	0.33
57	600990	四创电子	922,887	26,339,194.98	0.32
58	600995	文山电力	3,319,001	25,091,647.56	0.30
59	600741	华域汽车	3,000,000	24,300,000.00	0.29
60	600547	山东黄金	400,000	24,040,000.00	0.29
61	600581	八一钢铁	1,833,661	21,362,150.65	0.26
62	601699	潞安环能	500,000	19,745,000.00	0.24
63	002155	辰州矿业	1,000,000	19,000,000.00	0.23
64	000917	电广传媒	1,177,336	18,095,654.32	0.22
65	002214	大立科技	1,000,000	17,150,000.00	0.21
66	600048	保利地产	611,908	17,066,114.12	0.21
67	000528	柳工	1,000,000	16,640,000.00	0.20
68	600881	亚泰集团	1,764,551	13,992,889.43	0.17
69	600289	亿阳信通	1,121,327	13,478,350.54	0.16
70	000550	江铃汽车	853,630	12,334,953.50	0.15

71	600517	置信电气	799,419	12,311,052.60	0.15
72	600736	苏州高新	1,663,700	10,431,399.00	0.13
73	600973	宝胜股份	512,583	8,949,699.18	0.11
74	002055	得润电子	1,170,475	8,720,038.75	0.11
75	600770	综艺股份	341,267	4,743,611.30	0.06
76	600475	华光股份	270,000	4,738,500.00	0.06
77	000061	农产品	308,101	3,506,189.38	0.04
合计				5,960,016,558.67	72.24

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	600016	民生银行	299,825,151.29	4.19
2	600000	浦发银行	297,855,599.15	4.17
3	601899	紫金矿业	260,776,335.58	3.65
4	600030	中信证券	222,665,140.20	3.11
5	601168	西部矿业	211,362,640.19	2.96
6	601318	中国平安	185,660,068.61	2.60
7	600196	复星医药	178,645,469.46	2.50
8	601699	潞安环能	141,828,150.06	1.98
9	600005	武钢股份	139,249,897.51	1.95
10	601169	北京银行	138,934,962.39	1.94
11	601939	建设银行	138,782,751.06	1.94
12	002202	金风科技	123,088,067.69	1.72
13	601601	中国太保	122,240,373.61	1.71
14	600309	烟台万华	121,954,422.24	1.71
15	600675	中华企业	118,210,307.26	1.65
16	600635	大众公用	111,130,727.04	1.55
17	600795	国电电力	106,221,715.12	1.49
18	601918	国投新集	105,178,019.45	1.47
19	600028	中国石化	105,096,992.53	1.47
20	600089	特变电工	100,701,073.67	1.41

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	600030	中信证券	320,194,360.00	4.48

2	600036	招商银行	299,401,431.09	4.19
3	600309	烟台万华	214,056,121.56	2.99
4	601088	中国神华	206,130,726.42	2.88
5	000002	万科A	194,716,108.22	2.72
6	600519	贵州茅台	182,193,734.55	2.55
7	601939	建设银行	169,810,197.04	2.38
8	601398	工商银行	166,359,677.03	2.33
9	600089	特变电工	164,259,296.00	2.30
10	600028	中国石化	161,887,274.62	2.26
11	000983	西山煤电	161,034,073.71	2.25
12	601699	潞安环能	154,772,597.74	2.17
13	600000	浦发银行	140,595,402.35	1.97
14	600858	银座股份	136,979,253.91	1.92
15	600048	保利地产	134,348,235.05	1.88
16	601601	中国太保	131,716,752.45	1.84
17	600439	瑞贝卡	123,840,770.14	1.73
18	601899	紫金矿业	121,184,771.40	1.70
19	002022	科华生物	113,516,578.05	1.59
20	600426	华鲁恒升	109,574,928.93	1.53

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	8,512,673,736.34
卖出股票收入（成交）总额	8,199,159,519.71

注：本项的“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）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	154,205,129.20	1.87
2	央行票据	1,198,619,000.00	14.53
3	金融债券	643,752,000.00	7.81
	其中：政策性金融债	643,752,000.00	7.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-

8	合计	1,996,576,129.20	24.21
---	----	------------------	-------

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	0801035	08 央票 35	3,000,000	314,490,000.00	3.81
2	0801005	08 央票 05	3,000,000	313,170,000.00	3.80
3	070227	07 国开 27	1,200,000	131,484,000.00	1.59
4	0801044	08 央票 44	1,200,000	125,940,000.00	1.53
5	080216	08 国开 16	1,000,000	106,080,000.00	1.29

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,790,529.31
2	应收证券清算款	17,171,430.19
3	应收股利	2,664,314.96
4	应收利息	34,842,410.90
5	应收申购款	1,763,835.90
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,232,521.26

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§ 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

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
549,684	21,137.11	376,541,102.56	3.24%	11,242,189,412.34	96.76%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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	-	168,369.71	0.0014%
	合计	168,369.71	0.0014%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2001年9月21日)基金份额总额	5,000,001,124.00
报告期期初基金份额总额	13,148,931,633.62
报告期期间基金总申购份额	147,469,423.21
报告期期间基金总赎回份额	1,677,670,541.93
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	11,618,730,514.90

注：申购含红利再投资、转换转入份额，赎回含转换转出份额

§ 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. 基金管理人的专门基金托管部门的重大人事变动：

2009 年 1 月 12 日，基金管理人发布了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。

2009 年 2 月 19 日，基金管理人发布了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。

2009 年 3 月 27 日，基金管理人发布了关于基金经理调整的公告。汪光成先生不再担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，尚志民先生仍然担任上述两只基金的基金经理；刘新勇先生不再担任华安创新证券投资基金的基金经理，由汪光成先生担任该基金的基金经理。

2. 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：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

基金改聘为其审计的会计师事务所情况：无。

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

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 股票交易

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	
东方证券股份有限公司	1	304,200,661.44	1.83%	247,164.92	1.76%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	2,508,890,055.77	15.08%	2,121,479.11	15.14%	-
国信证券有限责任公司	1	286,919,288.07	1.72%	233,124.31	1.66%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	1,616,286,235.45	9.72%	1,313,249.78	9.37%	-
申银万国证券股份有限公司	2	2,265,397,216.37	13.62%	1,925,573.07	13.74%	-
中国银河证券股份有限公司	1	2,739,461,253.29	16.47%	2,328,523.58	16.62%	-
招商证券股份有限公司	1	580,328,302.99	3.49%	493,279.59	3.52%	-
中国国际金融有限公司	1	5,418,172,421.28	32.57%	4,605,421.53	32.87%	-
联合证券有限责任公司	1	917,236,894.33	5.51%	745,264.04	5.32%	-
合计	13	16,636,892,328.99	100.00%	14,013,079.93	100.00%	-

10.7.2 债券、权证交易

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	5,310,000.00	4.23%	-	-
申银万国证券股份有限公司	62,804,481.30	50.00%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1,275,589.00	1.02%	-	-
中国国际金融有限公司	56,213,264.50	44.75%	-	-
联合证券有限责任公司	-	-	-	-
合计	125,603,334.80	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、本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于参加深圳发展银行基金定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-9]
2	关于新增东海证券为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-9]
3	关于参加中国光大银行基金定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-20]
4	关于基金电子直销推出中国农业银行金穗卡持有人定期定额申购业务及相关交易费率调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-21]
5	关于新增江南证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-21]
6	关于新增上海农村商业银行开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-2-5]
7	关于参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-2-25]
8	关于参加中国工商银行股份有限公司基金定投业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-2-26]
9	关于新增恒泰证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-12]
10	关于参加江海证券经纪有限责任公司网上申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-13]
11	关于新增江海证券经纪有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-13]

12	关于新增兴业银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-18]
13	关于参加兴业银行股份有限公司电子渠道基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-18]
14	关于新增国盛证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-24]
15	关于新增国金证券股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-26]
16	关于在山西证券股份有限公司开通旗下基金定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-26]
17	关于开通电子直销平台后端定期定额投资业务及调低旗下开放式基金定期定额投资申购金额下限的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-31]
18	关于参加中国工商银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-3-31]
19	关于新增天相投资顾问有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-7]
20	关于电子直销平台开通“华安-建行 e 付通”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-15]
21	关于在中国银行开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-20]
22	关于新增爱建证券为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-6-2]
23	关于新增临商银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-6-9]
24	关于参加兴业银行基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-6-10]
25	关于电子直销平台开通“定期不定额”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-7-1]

26	关于在中国邮政储蓄银行有限责任公司延长定期定额投资优惠时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-7-1]
27	关于新增华夏银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-7-8]
28	关于电子直销平台“华安—民生银基通”基金电子交易业务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-7-20]
29	关于参加华夏银行网上银行基金申购费率优惠活动和定期定额申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-7-21]
30	关于参加中信银行股份有限公司网上银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-8-3]
31	关于在渤海证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-8-6]
32	关于在华夏银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-8-6]
33	关于恢复旗下基金持有的“盐湖钾肥”股票进行市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-1-6]
34	关于提请投资者及时更新身份证明文件的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-2-14]
35	关于旗下基金投资云南城投（600239）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-4-16]
36	关于恢复旗下基金持有的“长江电力”股票进行市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-5-19]
37	关于新增中国国际金融有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-8-22]
38	关于调整旗下部分开放式基金前端申购费率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	[2009-8-22]

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

备查文件目录

- 1、中国证监会批准华安创新证券投资基金设立的文件；
- 2、《华安创新证券投资基金基金合同》；
- 3、《华安创新证券投资基金招募说明书》；
- 4、《华安创新证券投资基金托管协议》；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则。

存放地点：

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站

<http://www.huaan.com.cn>。

查阅方式：

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
2009 年 8 月 28 日