

华安宏利股票型证券投资基金 2009 年年度报告摘要

2009 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2010 年 3 月 29 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2010 年 3 月 23 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 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安宏利股票	
基金主代码	040005	
交易代码	040005(前端)	041005(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 9 月 6 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,507,885,070.97 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益，以及分红所带来的红利收益，实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合，并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持，使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准 = 中信标普 300 指数收益率 × 90% + 同业存款利率 × 10%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，基金的风险与预期收益都要高于混合型基金，属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的稳定增值。

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 (简称“华安基金”)	中国建设银行股份有限公司 (简称“中国建设银行”)
信息披露负责人	姓名	冯颖	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	fengying@huanan.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		40088-50099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833

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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	1,496,935,997.67	-3,715,666,282.19	5,326,140,112.38
本期利润	6,205,469,629.63	-9,395,389,976.74	8,206,673,812.37
加权平均基金份额本期利润	1.2273	-1.6151	1.9197
本期基金份额净值增长率	75.46%	-48.39%	166.25%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配基金份额利润	0.3420	0.2780	0.9267
期末基金资产净值	14,544,303,777.30	8,048,764,980.44	16,640,603,735.18
期末基金份额净值	2.6406	1.6399	3.1774

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	14.55%	1.45%	17.50%	1.58%	-2.95%	-0.13%
过去六个月	14.60%	1.71%	12.36%	1.90%	2.24%	-0.19%
过去一年	75.46%	1.67%	85.57%	1.83%	-10.11%	-0.16%
过去三年	141.11%	1.97%	72.26%	2.25%	68.85%	-0.28%
自基金合同生效起至今	236.97%	1.91%	153.63%	2.17%	83.34%	-0.26%

注：本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%。

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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%，债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金

资产净值的 5%以上。

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 93.76%，债券的投资比例为基金资产净值的 5.17%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 7.22%。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

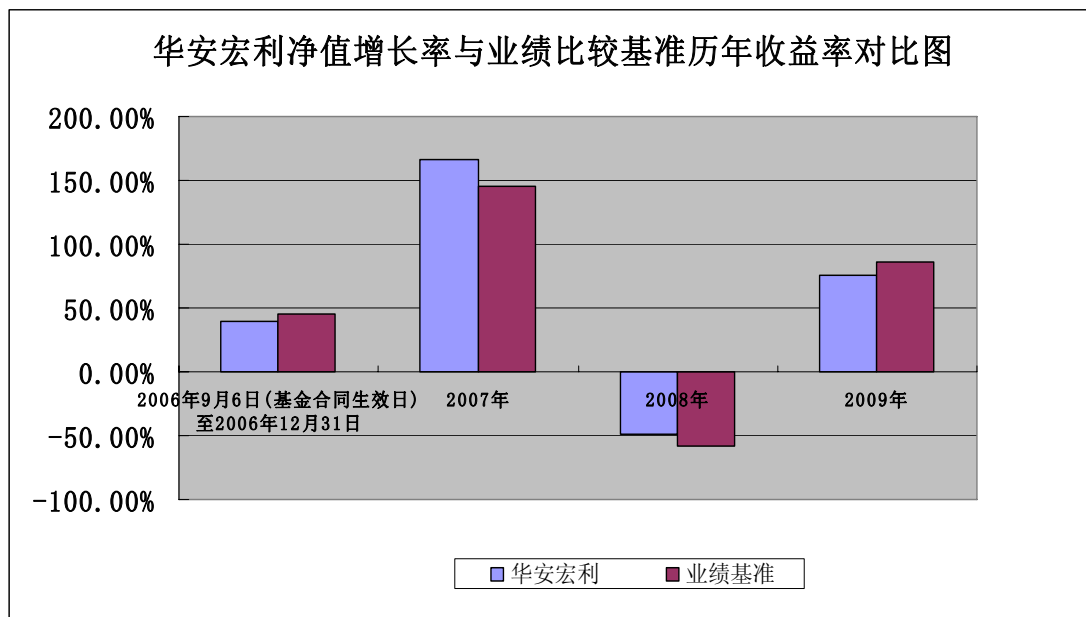
华安宏利股票型证券投资基金

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

(2006 年 9 月 6 日至 2009 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来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



注：合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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
2009年	2.300	525,292,822.53	686,942,275.44	1,212,235,097.97	-
2008年	-	-	-	-	-
2007年	3.900	664,248,544.64	1,013,706,377.25	1,677,954,921.89	-
合计	6.200	1,189,541,367.17	1,700,648,652.69	2,890,190,019.86	-

§ 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2009年12月31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，华安创新混合、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、华安动态灵活配置混合、华安上证180ETF联接、华安国际配置(QDII)等14只开放式基金，管理资产规模达到930.18亿人民币。

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(助理) 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚志民	本基金的基金经理，基金投资部总经理	2006年9月6日	—	13 年	工商管理硕士，13 年证券、基金从业经验，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，1999 年 6 月至 2001 年 9 月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000 年 7 月至 2001 年 9 月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001 年 9 月至 2003 年 9 月担任华安创新证券投资基金的基金经理，2003 年 9 月至今担任安顺证券投资基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任本基金的基金经理。
汪光成	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	2009 年 3 月 27 日	8 年	管理学博士，持有基金从业资格证书，8 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 月至 2009 年 3 月担任本基金和安顺证券投资基金的基金经理，2009 年 3 月 27 日起担任华安创新证券投资基金的基金经理。
陆从珍	本基金的基金经理助理	2009 年 5 月 16 日	—	10 年	经济学硕士，10 年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商局职员；京华山一证券上海公司高级研究员；中企东方

					资产管理公司高级研究员；东方证券研究部资深研究员等职。2008 年 3 月加入华安基金管理公司，任研究发展部高级研究员，2009 年 5 月 16 日起担任本基金和安顺证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》、《华安宏利股票型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《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-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（账户）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《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）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

按照华安宏利股票与华安核心股票的基金合同，华安宏利股票和华安核心股票都属于价值型基金，09 年度，华安宏利股票与华安核心股票的净值增长率分别为 75.46% 与 64.43%，华安宏利股票的增长率高于华安核心股票 11.03 个百分点。造成差异的主要原因是华安核心股票成立于 2008 年 10 月 22 日，第一季度处于建仓期内，期间华安核心股票保持了较低股票仓位，导致基金业绩在上半年大幅落后于华安宏利股票 16.19 个百分点。下半年，华安核心股票的增长率为 20.10%，高于华安宏利股票 5.5 个百分点，业绩差距有所缩小。

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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009年，A股市场走出了波澜壮阔的行情。年初，在政府4万亿政策刺激下，A股市场一改08年的疲弱走势，强劲反弹。随着刺激政策的进展，相关板块轮番表现，前期政策扶持板块表现优异，新能源、4万亿投资相关行业超越市场，之后随着各国央行向市场注入大量流动性、国内经济复苏预期强烈，资产类股一度成为主流，地产、煤炭、有色、金融行情可观。下半年，政策重点从保增长转向调结构，防御性行业表现出色，医药、商业等远远跑赢市场，同时，作为未来经济结构调整方向的新兴产业表现持续突出。在全年的行情中，市场热点纷呈，投资人也获得良好回报。

宏利在 2009 年一直保持相对高的仓位运作。年初，我们判断经济最差的时候正在过去，政府也有拉动经济的能力，因此提高了股票配置比例。在操作中，我们根据政策调整方向，及经济复苏对产业拉动的变化路径，对投资组合进行适时调整。一季度的重点在新能源，二季度提高对资产资源类股票的配置，而且逐步提高对稳定性行业的配置，使得基金在三季度的市场调整中保持相对平稳的表现。四季度增加对新兴产业的配置，但考虑基金规模，宏利主要配置在大中盘股，而政府调控的速度超过预期，在四季度后半期，地产和大盘股组合拖累了组合的表现。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 2.6406 元，本报告期份额净值增长率为 75.46%，同期业绩比较基准增长率为 85.57%。

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 2010 年，经济增长速度可能呈现同比前高后低的走势，从而对政府决策产生影响。2009 年四季度，中国 GDP 增长 10.7%，全年 GDP 增速达到 8.7%，完成 09 年初制定的规划。目前市场普遍预期 2010 年一季度的 GDP 增速在 10%以上，二季度的经济增长势头也依然强劲，从而引起调控的担忧。确实，调控已经开始，标志性的事件是 1 月 25 日提高银行存款准备金率，此外还有严格的窗口指导来抑制商业银行的贷款发放速度。退出政策对 A 股市场产生了一定的负面影响，但纵观全年，我们认为不必过分悲观。调控的目标是经济可持续地较高速增长，而非抑制经济的发展。因此，2010 年的政策将会根据各项经济指标相机抉择，不排除适时放松的可能。而围绕可持续增长这一目标，调结构将成为未来的重点。在经济调结构的过程中，A 股市场将展现出许多结构性机会，我们将依托公司的研究能力，努力挖掘行业与个股。

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、基金投资部总经理、研

究发展部总经理、固定收益部总经理、风险管理和金融工程部总经理、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，曾任华安安信封闭的基金经理、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，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，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在鹏证券、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，现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部总经理，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、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦，风险管理和金融工程部总经理，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，现任华安中国A股增强指数、华安上证180ETF及华安上证180ETF联接的基金经理，风险管理和金融工程部总经理。

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等的复核和核查责任。

(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

本基金的基金经理尚志民作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

2009 年度向基金持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 2.30 元。红利发放的公告日：2009 年 10 月 27 日；权益登记日、除息日：2009 年 11 月 3 日；红利划出日：2009 年 11 月 4 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

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 1,212,235,097.97 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

本托管人复核审查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。

§ 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，注册会计师马颖旋、金毅签字出具了普华永道中天审字(2010)第 20112 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：华安宏利股票型证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	288,992,379.59	588,516,531.02
结算备付金	29,855,140.47	8,096,042.80
存出保证金	204,269.22	249,669.89

交易性金融资产	14,389,600,296.28	7,665,639,744.09
其中：股票投资	13,637,362,296.28	6,395,659,744.09
基金投资	-	-
债券投资	752,238,000.00	1,269,980,000.00
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	4,134,785.42	23,059,538.15
应收股利	-	-
应收申购款	103,237,462.56	45,985,438.84
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	14,816,024,333.54	8,331,546,964.79
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2009 年 12 月 31 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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	220,416,624.13	250,376,240.52
应付赎回款	19,069,796.95	13,011,933.30
应付管理人报酬	18,352,583.74	10,623,427.49
应付托管费	3,058,763.98	1,770,571.25
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	9,766,944.34	6,314,319.91
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,055,843.10	685,491.88
负债合计	271,720,556.24	282,781,984.35
所有者权益：		
实收基金	5,507,885,070.97	4,908,200,581.65
未分配利润	9,036,418,706.33	3,140,564,398.79
所有者权益合计	14,544,303,777.30	8,048,764,980.44
负债和所有者权益总计	14,816,024,333.54	8,331,546,964.79

注：1、报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.6406 元，基金份额总额 5,507,885,070.97 份。

7.2 利润表

会计主体：华安宏利股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
一、收入	6,480,452,163.69	-9,043,917,577.40
1. 利息收入	28,709,552.43	75,379,505.72
其中：存款利息收入	7,539,637.86	21,257,790.35
债券利息收入	21,169,914.57	52,080,906.02
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,040,809.35
其他利息收入	-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)	1,736,370,056.01	-3,448,024,999.64
其中：股票投资收益	1,653,712,968.54	-3,539,350,898.49
基金投资收益	-	-
债券投资收益	1,160,063.59	5,915,572.14
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	1,942,480.59
股利收益	81,497,023.88	83,467,846.12
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	4,708,533,631.96	-5,679,723,694.55
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6,838,923.29	8,451,611.07
减：二、费用	274,982,534.06	351,472,399.34
1. 管理人报酬	180,217,871.52	200,114,966.70
2. 托管费	30,036,311.91	33,352,494.52
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	63,669,853.70	114,308,348.11
5. 利息支出	543,717.17	3,158,361.17
其中：卖出回购金融资产支出	543,717.17	3,158,361.17
6. 其他费用	514,779.76	538,228.84
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	6,205,469,629.63	-9,395,389,976.74
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	6,205,469,629.63	-9,395,389,976.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华安宏利股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 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）	4,908,200,581.65	3,140,564,398.79	8,048,764,980.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,205,469,629.63	6,205,469,629.63
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）	599,684,489.32	902,619,775.88	1,502,304,265.20
其中：1. 基金申购款	3,959,298,237.82	5,443,930,318.27	9,403,228,556.09
2. 基金赎回款	-3,359,613,748.50	-4,541,310,542.39	-7,900,924,290.89
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）	-	-1,212,235,097.97	-1,212,235,097.97
五、期末所有者权益（基金净值）	5,507,885,070.97	9,036,418,706.33	14,544,303,777.30
项目	上年度可比期间 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）	5,237,124,136.00	11,403,479,599.18	16,640,603,735.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-9,395,389,976.74	-9,395,389,976.74
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）	-328,923,554.35	1,132,474,776.35	803,551,222.00
其中：1. 基金申购款	3,265,039,694.28	5,554,050,039.82	8,819,089,734.10
2. 基金赎回款	-3,593,963,248.63	-4,421,575,263.47	-8,015,538,512.10
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）	4,908,200,581.65	3,140,564,398.79	8,048,764,980.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

俞妙根
基金管理公司负责人

李炳旺
主管会计工作的负责人

朱永红
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安宏利股票型证券投资基金(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”)证监基金字[2006]第 143 号《关于同意华安宏利股票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《华安宏利股票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 1,683,963,683.51 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(2006)第 112 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于 2006 年 9 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,684,224,358.17 份基金份额,其中认购资金利息折合 260,674.66 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的 60-95%,债券的投资比例为基金资产净值的 5-40%,现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5%以上。本基金的业绩比较基准为:中信标普 300 指数收益率 $\times$ 90%+金融同业存款利率 $\times$ 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 2010 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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》、《华安宏利股票型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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 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 12 月 31 日的财务状况以及 2009 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

本会计期间不存在会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本会计期间不存在会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

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[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》、[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》及其他相关财税法规和实务操作，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。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。
- (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。
- (5) 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。

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	基金管理人 基金注册登记机构 基金销售机构
中国建设银行股份有限公司 （“中国建设银行”）	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
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的原股东(2009年11月4日以前)
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(自2009年11月4日起)

注：根据华安基金管理有限公司于 2009 年 11 月 4 日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监许可[2009]1087 号文批准，公司原股东上海沸点投资发

展有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 20%股权全部转让给国泰君安投资管理股份有限公司。

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

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)均无应支付关联方的佣金。

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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	180,217,871.52	200,114,966.70
其中：支付销售机构的客户维护费	14,297,209.64	15,693,415.80

注：1. 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×1.5% / 当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	30,036,311.91	33,352,494.52

注：1. 支付基金托管人中国建设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 ×0.25% / 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

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 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
中国建设银行	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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
中国建设银行	176,042,589.52	-	-	-	-	-

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

份额单位：份

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	22,915,897.81	9,114,850.11
期间申购/买入总份额	15,521,245.76	13,801,047.70
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	38,437,143.57	22,915,897.81
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.70%	0.47%

注：基金管理人华安基金管理有限公司在本年度运用固有资金 29,600,000.00 元经代销机构申银万国证券股份有限公司购入本基金 12,393,842.68 份基金份额，申购费合计 35,399.60 元。其中每笔大于等于 500 万的申购，其申购费率为 1000 元；每笔小于 100 万的申购，其申购费率为 0.6%。另通过红利再投获得本基金 3,127,403.08 份基金份额。

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

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末和上年度末均无投资本基金的情况。

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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 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
中国建设银行	288,992,379.59	7,163,785.23	588,516,531.02	20,764,680.23

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2009 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：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	备注
601117	中国化学	2009 年 12 月 29 日	2010 年 1 月 7 日	网上新股认购	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
601888	中国国旅	2009 年 9 月 25 日	2010 年 1 月 15 日	网下新股认购	11.78	20.94	89,359	1,052,649.02	1,871,177.46	-
002299	圣农发展	2009 年 10 月 13 日	2010 年 1 月 21 日	网下新股认购	19.75	25.03	64,239	1,268,720.25	1,607,902.17	-
002301	齐心文具	2009 年 10 月 14 日	2010 年 1 月 21 日	网下新股认购	20.00	35.20	35,656	713,120.00	1,255,091.20	-
002333	罗普斯金	2009 年 12 月 30 日	2010 年 1 月 12 日	网上新股认购	22.00	22.00	500	11,000.00	11,000.00	-
300017	网宿科技	2009 年 10 月 15 日	2010 年 2 月 1 日	网下新股认购	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

截至报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 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	13,637,362,296.28	92.04
	其中：股票	13,637,362,296.28	92.04
2	固定收益投资	752,238,000.00	5.08
	其中：债券	752,238,000.00	5.08
	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	318,847,520.06	2.15
6	其他各项资产	107,576,517.20	0.73
7	合计	14,816,024,333.54	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	52,673,577.45	0.36
B	采掘业	1,042,303,281.39	7.17
C	制造业	4,551,033,799.07	31.29
C0	食品、饮料	962,183,223.70	6.62

C1	纺织、服装、皮毛	936,000.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	383,054,981.83	2.63
C4	石油、化学、塑胶、塑料	282,616,638.00	1.94
C5	电子	1,907,855.50	0.01
C6	金属、非金属	597,245,329.20	4.11
C7	机械、设备、仪表	1,535,649,962.50	10.56
C8	医药、生物制品	721,374,133.12	4.96
C99	其他制造业	66,065,675.22	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	121,300.00	0.00
E	建筑业	878,478,064.88	6.04
F	交通运输、仓储业	2,794,795.00	0.02
G	信息技术业	1,121,123,027.75	7.71
H	批发和零售贸易	820,488,852.36	5.64
I	金融、保险业	3,411,695,285.02	23.46
J	房地产业	721,357,342.32	4.96
K	社会服务业	379,870,362.79	2.61
L	传播与文化产业	107,718,922.80	0.74
M	综合类	547,703,685.45	3.77
	合计	13,637,362,296.28	93.76

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	601318	中国平安	14,199,000	782,222,910.00	5.38
2	600196	复星医药	36,699,906	718,217,160.42	4.94
3	601166	兴业银行	17,499,000	705,384,690.00	4.85
4	600519	贵州茅台	3,990,000	677,581,800.00	4.66
5	601398	工商银行	119,999,910	652,799,510.40	4.49
6	601088	中国神华	18,199,900	633,720,518.00	4.36
7	601668	中国建筑	132,999,929	627,759,664.88	4.32
8	002024	苏宁电器	30,000,000	623,400,000.00	4.29
9	600588	用友软件	20,475,321	566,347,378.86	3.89
10	600036	招商银行	30,999,998	559,549,963.90	3.85

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	601398	工商银行	932,158,375.04	11.58
2	601318	中国平安	845,119,825.87	10.50
3	601088	中国神华	841,287,205.00	10.45
4	600016	民生银行	752,301,523.75	9.35
5	600036	招商银行	676,514,797.98	8.41
6	601668	中国建筑	634,105,926.91	7.88
7	600585	海螺水泥	554,214,807.89	6.89
8	002024	苏宁电器	537,485,174.04	6.68
9	600050	中国联通	512,536,855.23	6.37
10	000069	华侨城 A	506,025,124.45	6.29
11	600588	用友软件	474,095,687.99	5.89
12	600030	中信证券	460,219,828.32	5.72
13	601169	北京银行	449,488,666.77	5.58
14	601166	兴业银行	434,597,380.32	5.40
15	600675	中华企业	428,553,891.99	5.32
16	000718	苏宁环球	407,189,872.23	5.06
17	601328	交通银行	402,906,546.59	5.01
18	600196	复星医药	383,100,386.47	4.76
19	600519	贵州茅台	360,080,933.38	4.47
20	600395	盘江股份	354,111,776.55	4.40
21	600586	金晶科技	338,650,626.60	4.21
22	600635	大众公用	337,548,864.61	4.19
23	000001	深发展 A	320,050,474.77	3.98
24	002202	金风科技	318,044,907.05	3.95
25	601988	中国银行	314,154,230.62	3.90
26	600875	东方电气	304,744,801.36	3.79
27	601899	紫金矿业	292,979,470.46	3.64
28	600028	中国石化	292,801,032.65	3.64
29	600153	建发股份	289,442,393.63	3.60
30	600166	福田汽车	284,721,047.08	3.54
31	600256	广汇股份	265,043,733.21	3.29
32	600820	隧道股份	252,930,803.94	3.14
33	000792	盐湖钾肥	240,972,565.45	2.99
34	600000	浦发银行	231,193,104.50	2.87
35	600195	中牧股份	221,935,798.26	2.76
36	600123	兰花科创	217,371,429.96	2.70
37	600162	香江控股	208,713,614.53	2.59
38	600266	北京城建	206,474,606.12	2.57
39	000651	格力电器	193,514,649.54	2.40

40	600298	安琪酵母	191,584,376.79	2.38
41	601857	中国石油	185,597,432.98	2.31
42	600415	小商品城	183,074,972.16	2.27
43	601918	国投新集	177,539,689.16	2.21
44	000024	招商地产	167,692,357.64	2.08
45	600718	东软集团	160,826,451.30	2.00

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	601088	中国神华	897,684,346.58	11.15
2	601328	交通银行	615,654,497.75	7.65
3	601398	工商银行	574,868,768.56	7.14
4	600016	民生银行	541,860,721.90	6.73
5	600309	烟台万华	530,678,388.47	6.59
6	600030	中信证券	502,613,184.02	6.24
7	000001	深发展 A	495,657,964.79	6.16
8	600036	招商银行	459,862,485.62	5.71
9	601169	北京银行	450,056,483.24	5.59
10	002024	苏宁电器	425,362,424.44	5.28
11	600000	浦发银行	380,191,814.60	4.72
12	600635	大众公用	356,875,781.79	4.43
13	000983	西山煤电	347,393,830.74	4.32
14	601899	紫金矿业	347,319,060.63	4.32
15	600875	东方电气	336,629,502.49	4.18
16	600649	城投控股	328,733,279.86	4.08
17	600266	北京城建	318,388,948.78	3.96
18	601166	兴业银行	315,626,612.24	3.92
19	601988	中国银行	315,619,559.58	3.92
20	000792	盐湖钾肥	315,511,522.79	3.92
21	601318	中国平安	304,656,104.70	3.79
22	000698	沈阳化工	291,129,583.70	3.62
23	600586	金晶科技	284,871,689.47	3.54
24	600315	上海家化	282,228,753.31	3.51
25	600028	中国石化	278,877,260.97	3.46
26	600585	海螺水泥	259,358,621.50	3.22
27	600900	长江电力	249,039,225.54	3.09
28	600195	中牧股份	247,203,179.09	3.07
29	600428	中远航运	233,075,093.89	2.90

30	600895	张江高科	230,013,945.07	2.86
31	600153	建发股份	228,082,821.18	2.83
32	600426	华鲁恒升	218,751,848.83	2.72
33	600737	中粮屯河	209,317,785.36	2.60
34	601918	国投新集	206,017,186.00	2.56
35	002202	金风科技	203,948,651.66	2.53
36	600395	盘江股份	202,997,063.43	2.52
37	600820	隧道股份	197,450,903.65	2.45
38	600256	广汇股份	195,134,546.19	2.42
39	600271	航天信息	187,917,322.51	2.33
40	601857	中国石油	186,518,763.99	2.32
41	600887	*ST 伊利	184,728,468.87	2.30
42	600202	哈空调	184,102,102.19	2.29
43	600479	千金药业	183,593,229.03	2.28
44	600026	中海发展	179,237,775.81	2.23
45	601601	中国太保	176,881,851.04	2.20
46	600169	太原重工	167,667,114.28	2.08
47	600308	华泰股份	167,626,608.89	2.08

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

买入股票成本（成交）总额	21,368,741,121.53
卖出股票收入（成交）总额	20,502,482,310.81

注：1、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。

2、本期买入股票成本总额中扣减了 002257 立立电子首发失败退款部分，共计人民币 1,537,037.94 元。

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	20,458,000.00	0.14
2	央行票据	731,780,000.00	5.03
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—

8	合计	752,238,000.00	5.17
---	----	----------------	------

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	0901044	09央票44	4,500,000	442,125,000.00	3.04
2	0901049	09央票49	1,300,000	129,571,000.00	0.89
3	0701095	07央票95	700,000	70,945,000.00	0.49
4	0901055	09央票55	500,000	49,835,000.00	0.34
5	0901042	09央票42	400,000	39,304,000.00	0.27

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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序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 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	204,269.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,134,785.42
5	应收申购款	103,237,462.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,576,517.20

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。

8.9.5.1 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。

§ 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
233,537	23,584.64	2,541,201,406.67	46.14%	2,966,683,664.30	53.86%

9.2 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	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	1,492,108.98	0.027%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2006年9月6日）基金份额总额	1,684,224,358.17
本报告期期初基金份额总额	4,908,200,581.65
本报告期基金总申购份额	3,959,298,237.82
减：本报告期基金总赎回份额	3,359,613,748.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,507,885,070.97

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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) 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。

(2) 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。

(3) 2009年3月27日，本基金管理人发布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的基金经理。

(4) 2009年5月16日，本基金管理人发布关于增聘基金经理助理的公告，增聘陆从珍女士为安顺证券投资基金的基金经理助理。

(5) 2009年11月17日，本基金管理人发布关于董事长变更的公告，经本公司董

事会会议审议通过，同意徐建国同志辞去本公司董事长职务，并选举俞妙根同志任本公司董事长。俞妙根同志的董事长任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1144 号文核准。在公司总经理招聘工作尚未完成之前，俞妙根同志将兼任公司总经理职务。

(6) 2010 年 1 月 16 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通过，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

2、本基金托管人重大人事变动如下：无。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

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

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 160,000 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。

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	
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	369,479,594.90	0.88%	314,054.79	0.89%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	845,949,929.69	2.02%	687,339.59	1.95%	-
国信证券股份有限公司	1	1,998,711,555.30	4.78%	1,698,895.69	4.82%	-
海通证券股份有限公司	1	2,175,391,712.29	5.20%	1,849,075.85	5.25%	-
中信建投证券有限责任公司	1	3,887,108,710.93	9.29%	3,304,028.25	9.37%	-
上海证券有限责任公司	1	1,975,058,256.19	4.72%	1,678,788.30	4.76%	-

申银万国证券股份有限公司	1	1,326,396,849.08	3.17%	1,077,712.22	3.06%	-
兴业证券股份有限公司	1	2,931,611,552.64	7.01%	2,491,848.23	7.07%	-
中国银河证券股份有限公司	1	603,951,505.86	1.44%	513,356.85	1.46%	-
招商证券股份有限公司	1	2,423,933,079.15	5.79%	2,060,333.32	5.85%	-
中国国际金融有限公司	1	308,119,289.50	0.74%	261,901.26	0.74%	-
中信证券股份有限公司	1	3,390,018,399.84	8.10%	2,881,495.73	8.18%	-
长江证券股份有限公司	1	7,215,055,461.41	17.24%	6,132,792.58	17.40%	-
齐鲁证券有限公司	1	3,839,703,704.71	9.18%	3,119,786.66	8.85%	-
华泰证券股份有限公司	1	4,298,702,915.60	10.27%	3,653,893.95	10.37%	-
德邦证券有限责任公司	1	237,096,647.99	0.57%	201,530.28	0.57%	-
中山证券有限责任公司	1	1,814,061,774.01	4.34%	1,473,942.72	4.18%	-
宏源证券股份有限公司	1	117,216,681.15	0.28%	95,240.30	0.27%	-
财富证券有限责任公司	1	1,506,668,471.96	3.60%	1,280,661.90	3.63%	-
湘财证券有限责任公司	1	575,453,907.77	1.38%	467,561.60	1.33%	-

11.7.2 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	交易单元数量	债券交易		回购交易		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	
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	26,421,054.00	78.67%	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	5,819,908.50	17.33%	19,600,000.00	100.00%	-

中国银河证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
长江证券股份有限公司	1	1,345,513.00	4.01%	-	-	-
齐鲁证券有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
德邦证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中山证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
宏源证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
财富证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
湘财证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本基金与华安核心优选股票型证券投资基金、华安稳定收益债券型证券投资基金共用交易单元。

2. 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；具备健全的内部控制制度，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。

3. 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。

4. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

- (1) 新增宏源证券股份有限公司深圳交易单元 1 个;
- (2) 新增中山证券有限责任公司深圳交易单元 1 个;
- (3) 新增上海证券有限责任公司上海交易单元 1 个;
- (4) 新增国信证券股份有限公司上海交易单元 1 个;
- (5) 新增中国银河证券股份有限公司上海交易单元 1 个;

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下:

- 1、2009 年 1 月 16 日,本托管人公告本行聘请胡哲一先生担任本行副行长;
- 2、2009 年 5 月 14 日,美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书;
- 3、2009 年 5 月 26 日,中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书;
- 4、2009 年 5 月 26 日,中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书;
- 5、2009 年 8 月 2 日,本托管人公告,自 2009 年 7 月 24 日起陈佐夫先生就任本行执行董事;
- 6、2009 年 9 月 27 日,本托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告;2009 年 10 月 11 日,本托管人发布关于控股股东增持本行股份的公告。

华安基金管理有限公司
2010 年 3 月 29 日