

华安中小盘成长股票型证券投资基金 2009 年年度报告

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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 18 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。

本报告期自 2009 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	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.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§ 4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
§ 5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§ 6 审计报告.....	15
§ 7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§ 8 投资组合报告.....	40
8.1 期末基金资产组合情况.....	40
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	41
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
8.7 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.....	48

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	48
8.9 投资组合报告附注	48
§ 9 基金份额持有人信息.....	49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
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	49
§ 10 开放式基金份额变动.....	49
§ 11 重大事件揭示.....	50
11.1 基金份额持有人大会决议	50
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	50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
11.4 基金投资策略的改变	50
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
11.8 其他重大事件	54
§ 12 备查文件目录.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安中小盘成长股票型证券投资基金	
基金简称	华安中小盘成长股票	
基金主代码	040007	
交易代码	040007（前端）	041007（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 4 月 10 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	9,219,215,856.49 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。
投资策略	主要依靠基金管理人的研究优势，将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中，在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性、以及上市公司业绩成长性的基础上，积极把握备选股票的投资机会，为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。
业绩比较基准	$40\% \times \text{天相中盘成长指数} + 40\% \times \text{天相小盘成长指数} + 20\% \times \text{中债-国债总指数}$
风险收益特征	本基金是积极成长型股票基金，属于证券投资基金中的较高风险和较高预期收益品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。

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
注册地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		俞妙根	姜建清

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华安基金管理有限公司	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年	2008 年	2007 年 4 月 10 日-2007 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,017,993,383.88	-2,504,246,413.80	5,298,188,043.69
本期利润	6,402,258,248.23	-12,071,042,338.14	8,460,937,860.00
加权平均基金份额本期利润	0.5893	-0.9518	0.6144
本期加权平均净值利润率	58.60%	-90.32%	45.58%
本期基金份额净值增长率	84.31%	-57.68%	73.04%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	3,459,963,815.51	2,859,124,239.06	8,039,203,513.18
期末可供分配基金份额利润	0.3753	0.2391	0.6521
期末基金资产净值	11,401,600,104.05	8,025,427,032.85	19,544,161,732.53
期末基金份额净值	1.2367	0.6710	1.5854
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率	34.98%	-26.76%	73.04%

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）。

4、本基金于 2007 年 4 月 10 日转型，转型后的合同生效日当年的可比数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

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	17.45%	1.53%	19.75%	1.50%	-2.30%	0.03%
过去六个月	17.58%	1.75%	18.78%	1.78%	-1.20%	-0.03%
过去一年	84.31%	1.66%	76.94%	1.74%	7.37%	-0.08%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金转型起至今	34.98%	2.09%	27.68%	2.10%	7.30%	-0.01%

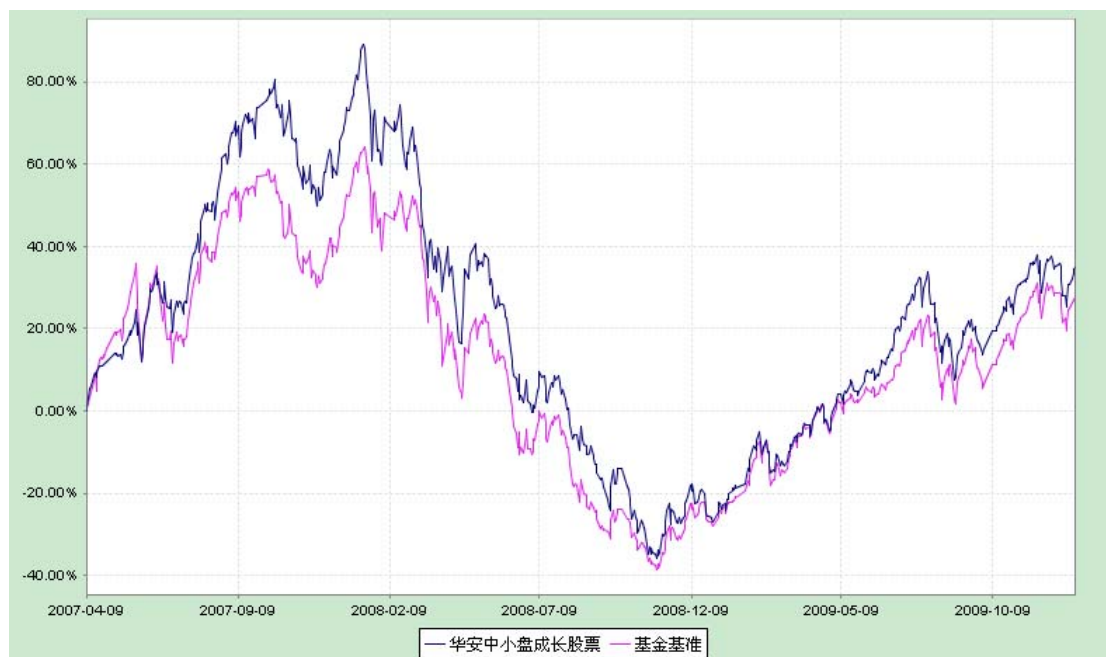
注：1、本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数×40%+天相小盘成长指数×40%+中债-国债总指数×20%。

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或金融衍生工具。其中，股票投资比例为基金资产的 60-95%，股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票；债券、权证、资产支持证券、货

币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。

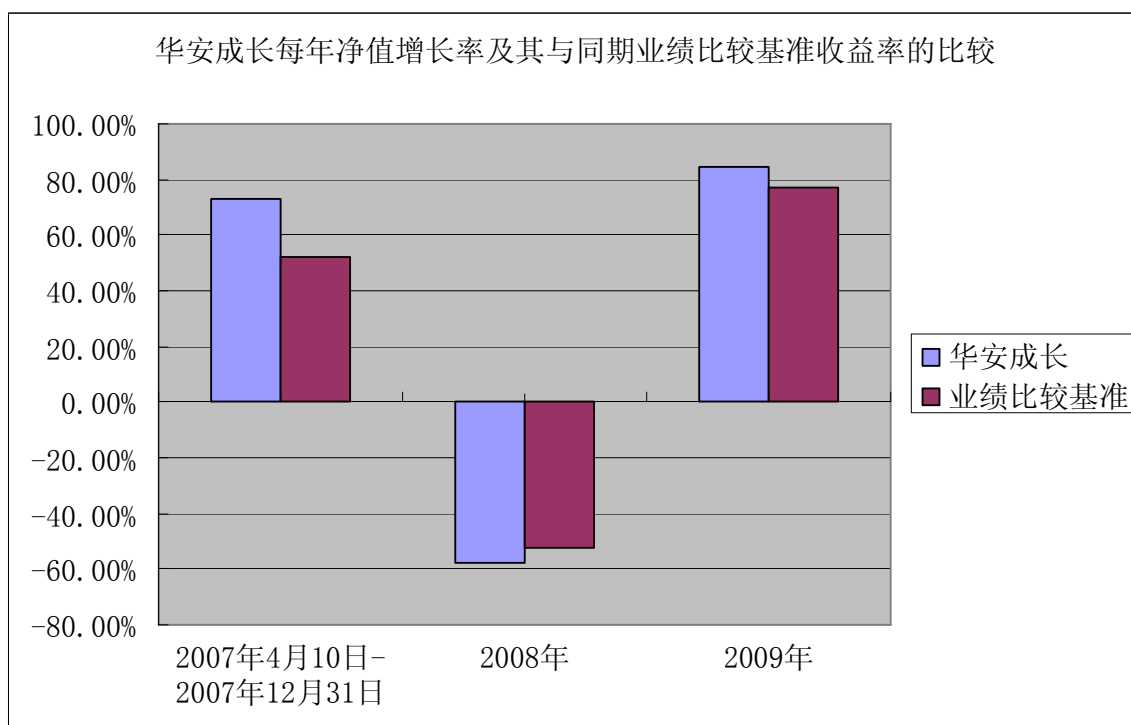
截至 2009 年 12 月 31 日，本基金股票投资比例为基金资产净值的 92.66%，债券的投资比例为基金资产净值的 2.66%，现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的 5.92%，投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票占股票资产市值的 81.08%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

3.2.2 自基金转型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



注：本基金于 2007 年 4 月 10 日转型。

3.2.3 自基金转型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：本基金于 2007 年 4 月 10 日转型，转型后的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	-	-	-	-	-
2008年	-	-	-	-	-
2007年4月10日(基金合同生效日)至2007年12月31日	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

§ 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		
刘光华	本基金的基金经理	2007 年 3 月 14 日	2009 年 6 月 25 日	12 年	工商管理硕士，12 年银行、基金从业经历。曾在农业银行上海分行国际部、路透集团上海代表处、中银国际上海代表处工作。2001 年加入华安基金管理公司，曾任研究部高级研究员，2006 年 4 月至 2007 年 3 月担任华安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2005 年 5 月至 2008 年 10 月 11 日担任华安 MSCI 中国 A 股指数基金经理，2007 年 3 月至 2009 年 6 月 25 日担任本基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理	2009 年 6 月 25 日	-	16 年	经济学硕士，16 年证券、基金行业从业经历。历任安徽省国际信托投资公司投资银行部业务主办、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、投研部副总监等职。2006 年 6 月 21 日至 2007 年 10 月 27 日任华富货币市场基金基金经理，2007 年 5 月 12 日至 2008 年 5 月 17 日同时任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。2008 年 6 月重新加入华安基金管理公司，并于 2008 年 10 月 11 日起担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理，2009 年 6 月 25 日起同时担任本基金的基金经理。

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《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》、《华安中小盘成长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

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、华安安信封闭。09 年度，三基金净值增长率分别为：华安中小盘成长股票 84.31%、华安创新混合 43.20%、华安安信封闭 57.95%，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。股票仓位与基金合同的投资方向的差异是三基金业绩差异较大的主要原因。2009 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平均仓位为 82.10%、67.31%与 72.59%，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，另外，华安中小盘成长股票由于主要投资于中小盘成长类股票，2009 年度深沪两市中小盘股票的上涨幅度明显要远领先大盘股票，也是产生较大差异的一个重要原因。

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 年是投资的收获年，A 股的特点可以用“否极泰来”来形容。2008 年 A 股市场系统性下跌给投资提供了估值的安全边际，而 2009 年全球蔓延的金融危机导致全球范围内扩张性的经济刺激政策，给投资提供了充裕的流动性支持。基于市场低风险、高收益的判断，本基金在 2009 年度保持了看多做多的思路，保持平均较高仓位运作。在行业选择、个股选择、仓位控制、股票交易等几个因素中，本基金个股选择超额贡献度遥遥领先，行业选择贡献次之，显示了本基金价值投资为基准的理念。行业配置超额贡献最大的行业为汽车、公用事业和医药等。交易策略仍是本基金的弱项，本基金善于通过仓位降低回避风险，但是加仓时点把握仍需进一步提高。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内本基金收益率 84.31%，基准收益率 76.94%，基金收益超过基准收益率 7.37 个百分点。

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，中国经济引领全球宏观经济复苏是主基调，虽然国际经济复苏缓慢甚至间或有所反复，但是宽松的经济政策退出不可避免。我们认为这是影响 A 股市场的关键冲击因素。2010 年伊始，中国就开始了控制信贷、调高存款准备金率、调控房地产资产价格泡沫等一系列紧缩政策，政策出台的时点和力度均超出预期，A 股也呈现震荡调整态势。经济复苏也带来物价回升和通胀压力，公司经营成本压力相应加大。融资融券、股指期货的推出将对目前资金的盈利模式产生影响，市场逐步成熟和开放，整体估值中枢也将相应下移。

但是，从另一角度来看，国家扶持的新能源、物联网、新材料、微电子、生物医药等新兴战略产业，新疆等区域经济振兴、节能环保等低碳经济、行业制度大变革的医药、教育、传媒领域，3G、三网融合等新领域均充满生机，包括创业板、中小板中大量优秀的行业领先公司上市，均为投资提供了投资标的和机会。而随着居民收入提高、农民工工资提升，城镇化建设加速，农村医保的逐步覆盖和完善，城乡居民消费仍将稳步增长，大消费领域的行业会继续受益。总体上，我们认为 2010 年市场难以呈现单边上涨趋势，但是结构性机会丰富。我们有信心通过把握政策扶持方向和个股精选，努力把握投资机会，为持有人创造理想回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，强化员工的合规意识，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 积极配合公司管理层深化“主动合规”的管理理念，落实《合规手册》，规范公司在业务运作、道德规范、反洗钱、利益冲突、客户信息保密、市场营销和客户投诉处理、投资和交易行为等环节的行为；

(2) 落实和完善合规员制度，发挥部门合规员在各业务环节的合规控制及

风险管理中的作用；

(3) 初步完成了投资交易合规监察系统，实行了投资合规检查的自动化，提高合规监察效率；

(4) 除经常性地组织员工进行法律法规的学习与培训，提高员工的合规意识，还组织投资部门、销售部门进行合规考试，主要内容包括了法律法规、公司的合规政策、合规手册、部门制度、反洗钱规定等；

(5) 组织公司各部门进行业务流程的梳理，进行风险评估；

(6) 聘请外部咨询机构梳理关键投资业务流程，开展投资业务流程标准化，初步完成了标准投资业务流程的编写；

(7) 除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察外，还有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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，本基金托管人在对华安中小盘成长股票型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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年, 华安中小盘成长股票型证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在华安中小盘成长股票型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, 华安中小盘成长股票型证券投资基金未进行利润分配。

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华安中小盘成长股票型证券投资基金 2009 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

普华永道中天审字(2010)第 20113 号

华安中小盘成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“华安中小盘成长基金”)的财务报表, 包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华安中小盘成长基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;
- (2) 选择和运用恰当的会计政策;
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范, 计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保

证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员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，在所有重大方面公允反映了华安中小盘成长基金 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。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师

马 颖 旎

中国·上海市

注册会计师

2010 年 3 月 26 日

金 毅

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华安中小盘成长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	附注号	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	7.4.7.1	743,575,138.31	250,378,611.84

结算备付金		18,953,139.18	3,469,326.16
存出保证金		8,574,231.37	2,755,139.87
交易性金融资产	7.4.7.2	10,867,372,431.66	7,736,105,923.60
其中：股票投资		10,564,552,431.66	6,279,677,923.60
基金投资		-	-
债券投资		302,820,000.00	1,456,428,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	14,109,078.62
应收利息	7.4.7.5	8,173,809.65	37,044,951.48
应收股利		-	-
应收申购款		2,203,436.27	1,514,015.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		11,648,852,186.44	8,045,377,046.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		186,684,385.50	-
应付赎回款		33,167,600.60	3,504,849.37
应付管理人报酬		14,510,540.81	10,851,029.58
应付托管费		2,418,423.49	1,808,504.92
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	9,416,220.62	2,873,438.34
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,054,911.37	912,191.85
负债合计		247,252,082.39	19,950,014.06
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,982,529,786.34	5,166,302,793.79
未分配利润	7.4.7.10	7,419,070,317.71	2,859,124,239.06
所有者权益合计		11,401,600,104.05	8,025,427,032.85
负债和所有者权益总计		11,648,852,186.44	8,045,377,046.91

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2367 元，基金份额总额 9,219,215,856.49 份。

7.2 利润表

会计主体：华安中小盘成长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	附注号	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		6,668,294,342.98	-11,732,288,646.19
1. 利息收入		30,359,632.68	52,073,723.30
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,232,838.05	11,359,998.25
债券利息收入		20,026,516.99	39,620,866.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		100,277.64	1,092,858.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-783,889,928.41	-2,225,045,137.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-881,064,361.14	-2,298,297,583.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	15,415,064.73	4,777,632.27
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-49,853,310.40
股利收益	7.4.7.15	81,759,368.00	118,328,123.89
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	7,420,251,632.11	-9,566,795,924.34
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,573,006.60	7,478,692.61
减：二、费用		266,036,094.75	338,753,691.95
1. 管理人报酬		162,748,971.14	202,696,814.46
2. 托管费		27,124,828.48	33,782,802.34
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	75,517,377.29	97,947,717.07
5. 利息支出		160,742.93	3,854,668.77
其中：卖出回购金融资产支出		160,742.93	3,854,668.77
6. 其他费用	7.4.7.19	484,174.91	471,689.31
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,402,258,248.23	-12,071,042,338.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,402,258,248.23	-12,071,042,338.14

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华安中小盘成长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）	5,166,302,793.79	2,859,124,239.06	8,025,427,032.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	6,402,258,248.23	6,402,258,248.23
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）	-1,183,773,007.45	-1,842,312,169.58	-3,026,085,177.03
其中：1. 基金申购款	446,918,571.25	629,052,983.83	1,075,971,555.08
2. 基金赎回款	-1,630,691,578.70	-2,471,365,153.41	-4,102,056,732.11
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）	3,982,529,786.34	7,419,070,317.71	11,401,600,104.05
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）	5,325,438,362.03	14,218,723,370.50	19,544,161,732.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-12,071,042,338.14	-12,071,042,338.14
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）	-159,135,568.24	711,443,206.70	552,307,638.46
其中：1. 基金申购款	2,050,191,562.86	4,704,499,219.58	6,754,690,782.44
2. 基金赎回款	-2,209,327,131.10	-3,993,056,012.88	-6,202,383,143.98
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）	5,166,302,793.79	2,859,124,239.06	8,025,427,032.85

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	李炳旺	朱永红
_____ 基金管理公司负责人	_____ 主管会计工作负责人	_____ 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安中小盘成长股票型证券投资基金是根据原安瑞证券投资基金(以下简称“基金安瑞”)基金份额持有人大会 2007 年 3 月 1 日审议通过的《关于安瑞证券投资基金转型有关事项的议案》并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[2007]81 号《于核准安瑞证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》核准,由原基金安瑞转型而来。原基金安瑞为契约型封闭式基金,于上海证券交易所(以下简称“上交所”)交易上市,存续期限至 2007 年 6 月 30 日止。根据中国证监会批复及上海证券交易所上证债字[2007]21 号《关于终止安瑞证券投资基金上市的决定》,原基金安瑞于 2007 年 4 月 9 日进行终止上市权利登记,自 2007 年 4 月 10 日起,原基金安瑞终止上市,更名为华安中小盘成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),《安瑞证券投资基金基金合同》失效的同时《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

原基金安瑞于基金合同失效前经审计的基金资产净值为人民币 1,060,436,162.37 元,已于本基金基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。根据《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》和《关于原安瑞证券投资基金基金份额折算结果的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 4 月 18 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 1:2.314909165,并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额变更登记。

本基金在基金合同生效后于 2007 年 4 月 16 日开放集中申购,共募集人民币 9,883,484,414.21 元,业经立信长江会计师事务所有限公司信会师报字(2007)第 11233 号审验报告予以验证。上述集中申购募集资金已按 2007 年 4 月 18 日基金份额转换后的基金份额净值 1.0000 元折合为 9,883,484,414.21 份基金份额,并于 2007 年 4 月 18 日进行了份额确认登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安中小盘成长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或金融衍生工具。其中,股票投资比例为基金资产的 60-95%,股票资产中的 80%以上投资于中国 A 股市场上具有良好成长性和基本面良好的中小盘股票;债券、权证、资产支持证券、货币市场

工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为：天相中盘成长指数 $\times$ 40%+天相小盘成长指数 $\times$ 40%+中债-国债总指数 $\times$ 20%。

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》、《华安中小盘成长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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(i) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具（主要为权证投资）分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(ii) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；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，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益

以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见相关基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

1、计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外,一般采用历史成本计量。

2、重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

(a) 对于特殊事项停牌股票,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》,本基金采用《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》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值,通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动,停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

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

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	743,575,138.31	250,378,611.84
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	743,575,138.31	250,378,611.84

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,313,386,437.79	10,564,552,431.66	1,251,165,993.87
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	302,572,620.00	302,820,000.00	247,380.00
	合计	302,572,620.00	302,820,000.00	247,380.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		9,615,959,057.79	10,867,372,431.66	1,251,413,373.87
项目		上年度末 2008 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		12,478,979,794.03	6,279,677,923.60	-6,199,301,870.43
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	1,425,964,387.81	1,456,428,000.00	30,463,612.19
	合计	1,425,964,387.81	1,456,428,000.00	30,463,612.19
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		13,904,944,181.84	7,736,105,923.60	-6,168,838,258.24

注：

1. 于 2009 年 12 月 31 日，股票投资余额中无按照指数收益法估值的特殊事项相关停牌股票（2008 年 12 月 31 日：169,057,342.65 元，采用该估值技术的股票投资于 2008 年度利润表中确认的公允价值变动损失为 262,013,160.17 元）。

2. 债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间

同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为 30,216,232.19 元 (2008 年度：公允价值变动收益 29,588,343.04 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 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	-	-	-	-
项目	上年度末 2008 年 12 月 31 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	-	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末 (2009 年 12 月 31 日) 和比较报告期末 (2008 年 12 月 31 日) 买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末 (2009 年 12 月 31 日) 和比较报告期末 (2008 年 12 月 31 日) 均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	193,770.60	63,801.09
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	6,633.60	1,561.22
应收债券利息	7,970,882.19	36,977,815.00
应收买入返售证券利息	-	-

应收申购款利息	2,488.66	1,729.68
其他	34.60	44.49
合计	8,173,809.65	37,044,951.48

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	9,415,420.62	2,869,538.34
银行间市场应付交易费用	800.00	3,900.00
合计	9,416,220.62	2,873,438.34

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	24,911.37	10,191.85
预提费用	280,000.00	152,000.00
合计	1,054,911.37	912,191.85

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,959,558,350.79	5,166,302,793.79
本期申购	1,034,580,618.62	446,918,571.25
本期赎回（以“-”号填列）	-3,774,923,112.92	-1,630,691,578.70
本期末	9,219,215,856.49	3,982,529,786.34

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	5,316,243,341.55	-2,457,119,102.49	2,859,124,239.06
本期利润	-1,017,993,383.88	7,420,251,632.11	6,402,258,248.23
本期基金份额交易产生的变动数	-838,286,142.16	-1,004,026,027.42	-1,842,312,169.58
其中：基金申购款	328,846,217.75	300,206,766.08	629,052,983.83
基金赎回款	-1,167,132,359.91	-1,304,232,793.50	-2,471,365,153.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,459,963,815.51	3,959,106,502.20	7,419,070,317.71

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日
活期存款利息收入	9,973,775.34	10,871,452.90
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	227,436.74	252,285.28
其他	31,625.97	236,260.07
合计	10,232,838.05	11,359,998.25

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

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
卖出股票成交总额	25,616,804,867.56	16,492,493,297.45
减：卖出股票成本总额	26,497,869,228.70	18,790,790,880.97
买卖股票差价收入	-881,064,361.14	-2,298,297,583.52

7.4.7.13 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 12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	2,195,143,035.81	3,594,081,932.92
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	2,113,715,027.81	3,534,531,584.80
减：应收利息总额	66,012,943.27	54,772,715.85
债券投资收益	15,415,064.73	4,777,632.27

7.4.7.14 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	-	188,487,738.23
减：卖出权证成本总额	-	238,341,048.63
买卖权证差价收入	-	-49,853,310.40

7.4.7.15 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	81,759,368.00	118,328,123.89
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	81,759,368.00	118,328,123.89

7.4.7.16 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	7,420,251,632.11	-9,566,795,924.34
——股票投资	7,450,467,864.30	-9,596,450,367.38
——债券投资	-30,216,232.19	29,654,443.04
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	7,420,251,632.11	-9,566,795,924.34

7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	1,306,193.97	7,137,837.44
基金转出费收入	249,043.07	226,709.53

印花税手续费返还	10,150.47	114,145.64
其他	7,619.09	-
合计	1,573,006.60	7,478,692.61

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、基金之间的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	75,509,727.29	97,899,667.07
银行间市场交易费用	7,650.00	48,050.00
合计	75,517,377.29	97,947,717.07

7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	160,000.00	152,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款手续费	6,174.91	19,689.31
债券托管账户维护费	18,000.00	-
合计	484,174.91	471,689.31

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本基金在本会计期内无或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金在本会计期内无资产负债表日后事项。

7.4.9 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司 (“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东

上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期和上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期和上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 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	162,748,971.14	202,696,814.46
其中：支付销售机构的客户维护费	31,715,867.52	39,087,921.85

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 × 1.5% / 当年天数。

7.4.10.2.2 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	27,124,828.48	33,782,802.34
----------------	---------------	---------------

注:支付基金托管人中国工商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:日托管费=前一日基金资产净值 $\times$ 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 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
中国工商银行股份有限公司	84,909,537.53	-	-	-	-	-
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
中国工商银行股份有限公司	54,366,143.84	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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	35,419,025.29	24,740,487.76
期间申购/买入总份额	18,368,219.95	13,027,579.00
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	2,349,041.47
期末持有的基金份额	53,787,245.24	35,419,025.29
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.58%	0.30%

注:1、申购含转换入份额,赎回含转换出份额。

2、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 19,400,000.00 元经代销机构申银万国证券股份有限公司购入本基金 18,368,219.95 份基金份额,申购费合计 9,349.90 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%。

7.4.10.4.2 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内和上年度可比期间内均无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5 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
中国工商银行股份有限公司	743,575,138.31	9,973,775.34	250,378,611.84	10,871,452.90

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 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 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
-	-	-	-	-	-

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本报告期由于基金投资当期亏损，不进行收益分配。

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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	2009-12-29	2010-01-07	网上认购新股	5.43	5.43	13,000	70,590.00	70,590.00	

601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	网下配售新股	11.78	20.94	131,060	1,543,886.80	2,744,396.40	
600239	云南城投	2009-04-14	预计 2010-04-12	非公开发行	15.18	22.79	5,000,000	75,900,000.00	113,950,000.00	
600239	云南城投	2009-06-16	预计 2010-4-12	非公开发行送股转增部分	-	22.79	2,500,000	-	56,975,000.00	
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	网下配售新股	60.00	113.99	33,407	2,004,420.00	3,808,063.93	
002306	湘鄂情	2009-11-05	2010-02-11	网下配售新股	18.90	33.36	46,639	881,477.10	1,555,877.04	
002330	得利斯	2009-12-25	2010-01-06	网上认购新股	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	
002331	皖通科技	2009-12-25	2010-01-06	网上认购新股	27.00	27.00	500	13,500.00	13,500.00	
002333	罗普斯金	2009-12-30	2010-01-12	网上认购新股	22.00	22.00	500	11,000.00	11,000.00	
300003	乐普医疗	2009-09-29	2010-02-01	网下配售新股	29.00	51.20	70,615	2,047,835.00	3,615,488.00	
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-01-08	网上认购新股	28.99	28.99	1,000	28,990.00	28,990.00	

注：（1）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。

（2）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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000709	唐钢股份	2009-12-16	资产重组	7.09	2010-01-25	6.60	5,182,150	40,347,753.03	36,741,443.50	复牌后更名为河北钢铁

注：本基金截至 2009 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是积极成长型股票基金, 属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种。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以上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“风险和收益相匹配”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, 将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人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中国工商银行, 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, 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。于 2009 年 12 月 31 日, 本基金未持有信用类债券(2008 年 12 月 31 日: 同)。

7.4.13.3 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。本基金投资于一家公司发行的股票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%。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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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约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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。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、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	743,575,138.31	-	-	-	743,575,138.31
结算备付金	18,953,139.18	-	-	-	18,953,139.18
存出保证金	98,780.49	-	-	8,475,450.88	8,574,231.37
交易性金融资产	-	118,026,000.00	184,794,000.00	10,564,552,431.66	10,867,372,431.66
应收利息	-	-	-	8,173,809.65	8,173,809.65
应收申购款	1,168,308.17	-	-	1,035,128.10	2,203,436.27
资产总计	763,795,366.15	118,026,000.00	184,794,000.00	10,582,236,820.29	11,648,852,186.44
负债					
应付证券清算款	-	-	-	186,684,385.50	186,684,385.50
应付赎回款	-	-	-	33,167,600.60	33,167,600.60
应付管理人报酬	-	-	-	14,510,540.81	14,510,540.81
应付托管费	-	-	-	2,418,423.49	2,418,423.49
应付交易费用	-	-	-	9,416,220.62	9,416,220.62
其他负债	-	-	-	1,054,911.37	1,054,911.37
负债总计	-	-	-	247,252,082.39	247,252,082.39
利率敏感度缺口	763,795,366.15	118,026,000.00	184,794,000.00	10,334,984,737.90	11,401,600,104.05
上年度末 2008 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产				-	-
银行存款	250,378,611.84	-	-	-	250,378,611.84
结算备付金	3,469,326.16	-	-	-	3,469,326.16
存出保证金	98,780.49	-	-	2,656,359.38	2,755,139.87
交易性金融资产	532,455,000.00	550,898,000.00	373,075,000.00	6,279,677,923.60	7,736,105,923.60
应收证券清算款	-	-	-	14,109,078.62	14,109,078.62
应收利息	-	-	-	37,044,951.48	37,044,951.48
应收申购款	1,151,209.05	-	-	362,806.29	1,514,015.34
资产总计	787,552,927.54	550,898,000.00	373,075,000.00	6,333,851,119.37	8,045,377,046.91
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,504,849.37	3,504,849.37
应付管理人报酬	-	-	-	10,851,029.58	10,851,029.58
应付托管费	-	-	-	1,808,504.92	1,808,504.92
应付交易费用	-	-	-	2,873,438.34	2,873,438.34
其他负债	-	-	-	912,191.85	912,191.85
负债总计	-	-	-	19,950,014.06	19,950,014.06
利率敏感度缺口	787,552,927.54	550,898,000.00	373,075,000.00	6,313,901,105.31	8,025,427,032.85

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 2.66% (2008 年 12 月 31 日：18.15%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2008 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 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。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 60-95%，债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为 0-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券占基金资产净值的比例在 5% 以上。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 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	10,564,552,431.66	92.66	6,279,677,923.60	78.25
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	10,564,552,431.66	92.66	6,279,677,923.60	78.25

7.4.13.4.3.2 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：亿元）	
		本期末（2009 年 12 月 31 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 5.20	增加约 3.98
	2. 业绩比较基准下降 5%	下降约 5.20	下降约 3.98

7.4.14 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	10,564,552,431.66	90.69
	其中：股票	10,564,552,431.66	90.69
2	固定收益投资	302,820,000.00	2.60
	其中：债券	302,820,000.00	2.60
	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	762,528,277.49	6.55
6	其他各项资产	18,951,477.29	0.16
7	合计	11,648,852,186.44	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	185,736,730.31	1.63
B	采掘业	1,418,914,838.83	12.44
C	制造业	5,968,664,553.47	52.35
C0	食品、饮料	654,894,139.83	5.74
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	38,271,229.44	0.34
C4	石油、化学、塑胶、塑料	454,072,033.40	3.98
C5	电子	71,671,715.93	0.63
C6	金属、非金属	1,531,516,212.44	13.43
C7	机械、设备、仪表	1,755,765,431.62	15.40
C8	医药、生物制品	1,462,473,790.81	12.83
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	173,944,519.96	1.53
F	交通运输、仓储业	142,480,000.00	1.25
G	信息技术业	216,416,938.69	1.90
H	批发和零售贸易	260,406,691.97	2.28
I	金融、保险业	1,388,478,502.98	12.18
J	房地产业	493,629,617.78	4.33
K	社会服务业	4,370,863.44	0.04
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	311,509,174.23	2.73
	合计	10,564,552,431.66	92.66

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 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	600660	福耀玻璃	33,500,000	500,490,000.00	4.39

2	600585	海螺水泥	8,600,645	428,828,159.70	3.76
3	000983	西山煤电	10,501,652	418,910,898.28	3.67
4	002022	科华生物	18,609,055	407,352,213.95	3.57
5	000538	云南白药	6,700,000	404,680,000.00	3.55
6	601318	中国平安	6,800,000	374,612,000.00	3.29
7	601166	兴业银行	9,000,000	362,790,000.00	3.18
8	600066	宇通客车	17,904,945	357,919,850.55	3.14
9	600276	恒瑞医药	6,403,903	336,204,907.50	2.95
10	600519	贵州茅台	1,905,460	323,585,217.20	2.84
11	600325	华发股份	17,220,097	322,704,617.78	2.83
12	000895	双汇发展	6,006,877	318,965,168.70	2.80
13	600089	特变电工	13,260,414	315,597,853.20	2.77
14	600036	招商银行	15,000,000	270,750,000.00	2.37
15	600415	小商品城	4,704,081	210,413,543.13	1.85
16	000422	湖北宜化	9,500,000	202,825,000.00	1.78
17	600028	中国石化	13,000,000	183,170,000.00	1.61
18	000157	中联重科	6,994,100	181,916,541.00	1.60
19	600239	云南城投	7,500,000	170,925,000.00	1.50
20	000060	中金岭南	6,002,258	167,462,998.20	1.47
21	000999	三九医药	8,002,582	159,731,536.72	1.40
22	000937	金牛能源	3,665,089	152,467,702.40	1.34
23	600997	开滦股份	5,736,299	144,612,097.79	1.27
24	000898	鞍钢股份	9,000,000	144,000,000.00	1.26
25	600598	北大荒	9,402,250	143,384,312.50	1.26
26	601001	大同煤业	3,000,000	134,970,000.00	1.18
27	002152	广电运通	4,003,682	131,520,953.70	1.15
28	601919	中国远洋	9,000,000	125,100,000.00	1.10
29	002024	苏宁电器	6,000,000	124,680,000.00	1.09
30	600015	华夏银行	9,047,533	112,370,359.86	0.99
31	600348	国阳新能	2,300,000	111,251,000.00	0.98
32	601668	中国建筑	23,000,000	108,560,000.00	0.95
33	601169	北京银行	5,500,000	106,370,000.00	0.93
34	600031	三一重工	2,800,000	103,068,000.00	0.90
35	000651	格力电器	3,516,220	101,759,406.80	0.89
36	600529	山东药玻	6,763,311	101,043,866.34	0.89
37	000680	山推股份	7,000,000	88,620,000.00	0.78
38	000009	中国宝安	8,016,403	88,020,104.94	0.77
39	000527	美的电器	3,571,228	82,852,489.60	0.73
40	000425	徐工机械	2,172,000	76,280,640.00	0.67
41	600352	浙江龙盛	6,343,134	72,438,590.28	0.64
42	600489	中金黄金	1,200,000	69,936,000.00	0.61

43	002063	远光软件	3,000,000	68,310,000.00	0.60
44	600581	八一钢铁	4,071,190	65,139,040.00	0.57
45	000028	一致药业	2,300,603	63,680,691.04	0.56
46	000887	中鼎股份	4,070,817	61,713,585.72	0.54
47	000016	深康佳 A	7,913,097	60,851,715.93	0.53
48	600188	兖州煤业	2,600,000	59,904,000.00	0.53
49	002028	思源电气	2,091,754	56,226,347.52	0.49
50	600498	烽火通信	2,005,591	53,589,391.52	0.47
51	000039	中集集团	4,078,115	53,423,306.50	0.47
52	002038	双鹭药业	1,164,064	51,684,441.60	0.45
53	600016	民生银行	6,500,000	51,415,000.00	0.45
54	600395	盘江股份	1,715,257	50,497,166.08	0.44
55	600299	蓝星新材	3,646,554	49,520,203.32	0.43
56	601766	中国南车	8,000,000	45,520,000.00	0.40
57	600309	烟台万华	1,732,768	41,603,759.68	0.36
58	000417	合肥百货	2,766,140	40,579,273.80	0.36
59	600123	兰花科创	917,212	40,118,852.88	0.35
60	600196	复星医药	2,000,000	39,140,000.00	0.34
61	600528	中铁二局	2,879,366	37,604,519.96	0.33
62	000709	唐钢股份	5,182,150	36,741,443.50	0.32
63	600631	百联股份	2,000,000	36,040,000.00	0.32
64	600825	新华传媒	2,763,375	32,524,923.75	0.29
65	600470	六国化工	2,462,473	31,765,901.70	0.28
66	002047	成霖股份	3,390,540	30,955,630.20	0.27
67	600845	宝信软件	953,933	30,106,125.48	0.26
68	600000	浦发银行	1,375,848	29,842,143.12	0.26
69	600765	中航重机	1,331,658	29,429,641.80	0.26
70	600820	隧道股份	2,000,000	27,780,000.00	0.24
71	600583	海油工程	2,411,151	27,487,121.40	0.24
72	600406	国电南瑞	530,070	25,952,227.20	0.23
73	601601	中国太保	1,000,000	25,620,000.00	0.22
74	600409	三友化工	2,962,291	25,534,948.42	0.22
75	601788	光大证券	1,000,000	25,520,000.00	0.22
76	601628	中国人寿	800,000	25,352,000.00	0.22
77	600038	哈飞股份	1,173,736	24,801,041.68	0.22
78	600567	山鹰纸业	4,000,000	24,000,000.00	0.21
79	600582	天地科技	601,484	20,901,569.00	0.18
80	000635	英力特	1,107,200	20,704,640.00	0.18
81	600628	新世界	1,300,000	19,630,000.00	0.17
82	600879	航天电子	1,614,978	18,701,445.24	0.16
83	600962	国投中鲁	1,385,040	18,517,984.80	0.16

84	600893	航空动力	709,289	18,434,421.11	0.16
85	600467	好当家	1,856,431	18,322,973.97	0.16
86	600269	赣粤高速	2,000,000	17,380,000.00	0.15
87	600547	山东黄金	200,000	16,060,000.00	0.14
88	002161	远望谷	657,083	14,357,263.55	0.13
89	002078	太阳纸业	690,432	14,271,229.44	0.13
90	600761	安徽合力	1,000,000	14,210,000.00	0.12
91	600858	银座股份	503,292	13,075,526.16	0.11
92	000418	小天鹅A	882,234	12,907,083.42	0.11
93	600118	中国卫星	500,000	12,110,000.00	0.11
94	002008	大族激光	1,000,000	10,820,000.00	0.09
95	600741	华域汽车	843,616	9,769,073.28	0.09
96	600636	三爱富	1,000,000	9,650,000.00	0.08
97	601958	金钼股份	500,000	9,530,000.00	0.08
98	600737	中粮屯河	509,200	8,529,100.00	0.07
99	600280	南京中商	293,726	6,952,494.42	0.06
100	600271	航天信息	341,603	6,927,708.84	0.06
101	600075	新疆天业	583,841	5,511,459.04	0.05
102	002153	石基信息	153,145	5,050,722.10	0.04
103	000686	东北证券	100,000	3,837,000.00	0.03
104	002304	洋河股份	33,407	3,808,063.93	0.03
105	300003	乐普医疗	70,615	3,615,488.00	0.03
106	002032	苏泊尔	164,460	3,420,768.00	0.03
107	601888	中国国旅	131,060	2,744,396.40	0.02
108	002306	湘鄂情	46,639	1,555,877.04	0.01
109	601117	中国化学	13,000	70,590.00	0.00
110	300037	新宙邦	1,000	28,990.00	0.00
111	002331	皖通科技	500	13,500.00	0.00
112	002333	罗普斯金	500	11,000.00	0.00
113	002330	得利斯	500	6,590.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	787,048,760.63	9.81
2	601088	中国神华	550,392,147.19	6.86

3	000983	西山煤电	545,840,352.91	6.80
4	600585	海螺水泥	545,634,991.40	6.80
5	601318	中国平安	533,450,780.01	6.65
6	600519	贵州茅台	484,313,530.06	6.03
7	600028	中国石化	470,626,772.06	5.86
8	600036	招商银行	454,558,713.82	5.66
9	000157	中联重科	444,346,020.79	5.54
10	002022	科华生物	350,805,449.93	4.37
11	600000	浦发银行	332,705,278.51	4.15
12	600089	特变电工	331,472,417.68	4.13
13	601186	中国铁建	313,685,146.24	3.91
14	601919	中国远洋	311,782,816.69	3.88
15	600325	华发股份	308,920,034.37	3.85
16	002024	苏宁电器	295,263,232.52	3.68
17	600348	国阳新能	295,183,945.46	3.68
18	000002	万科A	293,711,570.31	3.66
19	000538	云南白药	292,250,838.69	3.64
20	601166	兴业银行	258,202,940.20	3.22
21	000895	双汇发展	247,237,224.81	3.08
22	600276	恒瑞医药	244,593,599.79	3.05
23	000402	金融街	244,204,387.23	3.04
24	600066	宇通客车	242,178,701.91	3.02
25	600550	天威保变	239,718,279.92	2.99
26	600048	保利地产	236,397,018.07	2.95
27	600837	海通证券	229,254,108.37	2.86
28	000423	东阿阿胶	211,250,837.82	2.63
29	600660	福耀玻璃	210,240,012.62	2.62
30	600019	宝钢股份	208,432,287.06	2.60
31	600415	小商品城	206,354,441.93	2.57
32	600005	武钢股份	202,086,022.07	2.52
33	600031	三一重工	195,540,520.22	2.44
34	600309	烟台万华	190,076,247.17	2.37
35	600598	北大荒	189,177,663.02	2.36
36	601668	中国建筑	188,646,743.55	2.35
37	000937	金牛能源	181,753,154.42	2.26
38	000009	中国宝安	177,327,901.25	2.21
39	601169	北京银行	176,085,135.51	2.19
40	000999	三九医药	172,589,080.46	2.15
41	600016	民生银行	170,791,436.54	2.13
42	000898	鞍钢股份	169,253,797.58	2.11
43	000060	中金岭南	160,865,264.05	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	600030	中信证券	730,120,677.51	9.10
2	601166	兴业银行	727,388,311.72	9.06
3	601088	中国神华	707,376,040.72	8.81
4	600383	金地集团	581,098,072.69	7.24
5	600997	开滦股份	513,559,693.33	6.40
6	601186	中国铁建	450,919,818.58	5.62
7	600000	浦发银行	425,599,795.46	5.30
8	000157	中联重科	419,131,865.49	5.22
9	000983	西山煤电	410,664,176.00	5.12
10	600028	中国石化	386,543,418.45	4.82
11	002024	苏宁电器	381,311,939.22	4.75
12	000667	名流置业	378,503,154.67	4.72
13	000402	金融街	376,302,602.06	4.69
14	600036	招商银行	367,621,063.74	4.58
15	601939	建设银行	363,956,163.33	4.54
16	600005	武钢股份	348,086,570.23	4.34
17	000651	格力电器	336,335,319.61	4.19
18	600015	华夏银行	331,768,780.32	4.13
19	000002	万科A	331,637,911.28	4.13
20	601318	中国平安	328,959,007.64	4.10
21	600900	长江电力	322,106,099.66	4.01
22	600048	保利地产	310,777,252.37	3.87
23	000422	湖北宣化	310,003,628.64	3.86
24	000898	鞍钢股份	297,789,021.66	3.71
25	600309	烟台万华	293,590,472.36	3.66
26	601601	中国太保	278,148,603.35	3.47
27	600550	天威保变	278,137,766.91	3.47
28	600348	国阳新能	276,997,811.90	3.45
29	600428	中远航运	266,427,864.20	3.32
30	600016	民生银行	254,638,584.40	3.17
31	000338	潍柴动力	249,292,039.40	3.11
32	600837	海通证券	248,694,386.54	3.10
33	600585	海螺水泥	237,495,767.68	2.96
34	601628	中国人寿	236,360,196.88	2.95
35	000423	东阿阿胶	230,238,353.35	2.87

36	000568	泸州老窖	217,821,658.75	2.71
37	601328	交通银行	215,976,113.28	2.69
38	002007	华兰生物	208,363,156.12	2.60
39	601390	中国中铁	205,103,540.72	2.56
40	600026	中海发展	201,477,986.03	2.51
41	002202	金风科技	195,649,127.84	2.44
42	601919	中国远洋	193,090,736.04	2.41
43	000001	深发展 A	192,156,059.54	2.39
44	600269	赣粤高速	186,269,814.99	2.32
45	600019	宝钢股份	184,502,075.41	2.30
46	600308	华泰股份	181,035,160.57	2.26
47	600519	贵州茅台	179,777,058.92	2.24
48	000858	五 粮 液	163,544,389.06	2.04
49	600849	上海医药	163,493,537.95	2.04

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	23,332,275,872.46
卖出股票收入（成交）总额	25,616,804,867.56

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	-	-
2	央行票据	302,820,000.00	2.66
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	302,820,000.00	2.66

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	0801017	08 央票 17	1,000,000	102,650,000.00	0.90
2	0901028	09 央票 28	1,000,000	98,370,000.00	0.86
3	0801020	08 央票 20	800,000	82,144,000.00	0.72
4	0901038	09 央票 38	200,000	19,656,000.00	0.17

8.7 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。

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 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	8,574,231.37
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	8,173,809.65
5	应收申购款	2,203,436.27
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,951,477.29

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

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
538,620	17,116.36	356,983,218.70	3.87%	8,862,232,637.79	96.13%

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	289,430.25	0.0031%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年4月10日）基金份额总额	500,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	11,959,558,350.79
本报告期基金总申购份额	1,034,580,618.62
减：本报告期基金总赎回份额	3,774,923,112.92
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,219,215,856.49

注：总申购份额含转换入份额。总赎回份额含转换出份额。

§ 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 6 月 25 日，本基金管理人发布关于基金经理调整的公告，刘光华先生不再担任华安中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理，聘任沈雪峰女士为华安中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理。

(4) 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。

(5) 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、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：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。

报告年度支付给聘任会计师事务所的报酬情况：160,000.00 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。

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	
长城证券有限责任公司	1	2,666,077,340.32	5.47%	2,266,159.86	5.55%	
国泰君安证券股份有限公司	1	58,055,861.13	0.12%	47,170.71	0.12%	
上海证券有限责任公司	1	1,160,391,056.35	2.38%	986,331.85	2.42%	
兴业证券股份有限公司	1	842,371,958.07	1.73%	716,010.39	1.76%	
中国银河证券股份有限公司	1	5,061,385,617.76	10.39%	4,302,157.23	10.55%	
招商证券股份有限公司	1	1,509,044,507.63	3.10%	1,226,110.96	3.01%	
中银国际证券有限责任公司	1	307,545,509.03	0.63%	249,884.11	0.61%	
国信证券股份有限公司	1	7,608,235,763.09	15.62%	6,466,983.53	15.85%	
联合证券有限责任公司	1	7,127,953,890.57	14.64%	5,791,530.19	14.20%	
中国建银投资证券有限责任公司	2	6,790,995,994.48	13.95%	5,517,727.63	13.52%	
中信证券股份有限公司	1	—	—	—	—	
国金证券股份有限公司	1	4,923,414,831.72	10.11%	4,184,885.53	10.26%	
北京高华证券有限责任公司	1	87,393,279.39	0.18%	71,006.61	0.17%	

中国国际金融有限公司	1	2,722,745,775.12	5.59%	2,314,293.74	5.67%	
国都证券有限责任公司	1	5,045,543,316.24	10.36%	4,288,692.10	10.51%	
东北证券股份有限公司	1	577,391,785.83	1.19%	490,782.46	1.20%	
齐鲁证券有限公司	1	137,268,881.38	0.28%	116,676.82	0.29%	
世纪证券有限责任公司	1	1,411,477,707.17	2.90%	1,199,752.37	2.94%	
华融证券股份有限公司	1	660,837,367.16	1.36%	561,705.05	1.38%	
广发华福证券有限责任公司	1	-	-	-	-	

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	债券交易		回购交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
长城证券有限责任公司	2,509,304.00	36.05%	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
上海证券有限责任公司	-	-	100,000,000.00	16.67%
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	500,000,000.00	83.33%
招商证券股份有限公司	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-
联合证券有限责任公司	-	-	-	-
中国建银投资证券有限责任公司	-	-	-	-

中信证券股份 有限公司	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	4,451,415.10	63.95%	-	-
北京高华证券 有限责任公司	-	-	-	-
中国国际金融 有限公司	-	-	-	-
国都证券有限 责任公司	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-
齐鲁证券有限 公司	-	-	-	-
世纪证券有限 责任公司	-	-	-	-
华融证券股份 有限公司	-	-	-	-
广发华福证券 有限责任公司	-	-	-	-

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，本基金交易单元变更情况如下：

新增齐鲁证券有限公司上海交易单元1个。

新增世纪证券有限责任公司上海交易单元1个。

新增华融证券股份有限公司上海交易单元1个。

新增广发华福证券有限责任公司上海交易单元1个。

11.8 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	关于旗下部分基金参加中国农业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、公司网站	[2009-1-6]
2	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、公司网站	[2009-1-6]
3	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、公司网站	[2009-1-9]
4	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、公司网站	[2009-1-9]
5	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、公司网站	[2009-1-20]
6	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、公司网站	[2009-1-21]
7	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、公司网站	[2009-1-21]
8	关于新增上海农村商业银行行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、公司网站	[2009-2-5]
9	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、公司网站	[2009-2-14]
10	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、公司网站	[2009-2-25]
11	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、公司网站	[2009-2-26]
12	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、公司网站	[2009-3-26]
13	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、公司网站	[2009-3-26]
14	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、公司网站	[2009-3-31]
15	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、公司网站	[2009-3-31]

16	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、公司网站	[2009-4-16]
17	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、公司网站	[2009-5-7]
18	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、公司网站	[2009-5-15]
19	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、公司网站	[2009-5-19]
20	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、公司网站	[2009-5-20]
21	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、公司网站	[2009-6-2]
22	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、公司网站	[2009-6-9]
23	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、公司网站	[2009-6-10]
24	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、公司网站	[2009-7-1]
25	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、公司网站	[2009-7-8]
26	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、公司网站	[2009-7-20]
27	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、公司网站	[2009-7-21]
28	关于在中国农业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、公司网站	[2009-7-23]
29	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、公司网站	[2009-8-3]
30	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、公司网站	[2009-8-6]
31	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、公司网站	[2009-8-6]
32	关于运用自有资金进行开放式基金投资的公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-8-20]
33	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、公司网站	[2009-8-22]
34	关于运用自有资金进行开放式基金投资的补充公告	上海证券报、证券时报、 中国证券报、公司网站	[2009-9-1]
35	关于新增信达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、公司网站	[2009-9-3]
36	关于参加中国农业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、公司网站	[2009-9-4]

37	关于旗下基金投资创业板股票和可转换债券的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2009-9-24]
38	关于新增方正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、公司网站	[2009-9-28]
39	关于新增浙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、公司网站	[2009-10-15]
40	经公司股东会会议审议通过，并经中国证监会证监许可[2009]1087 号文核准，本公司原股东上海沸点投资发展有限公司将其持有的本公司 20%股权全部转让给国泰君安投资管理股份有限公司。 此次变更后本公司的股东及持股比例为：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、国泰君安投资管理股份有限公司分别持有本公司 20%的股权。	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2009-11-04]
41	关于基金电子直销平台支持投资者开立多个“交易账户”的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2009-12-1]
42	关于华安中小盘成长股票型证券投资基金、华安策略优选股票型证券投资基金参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动、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、公司网站	[2009-12-2]
43	关于新增中国银行股份有限公司为华安中小盘成长股票型证券投资基金、华安策略优选股票型证券投资基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2009-12-2]
44	关于新增东兴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、公司网站	[2009-12-4]
45	关于新增华融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、公司网站	[2009-12-4]
46	关于新增华宝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、公司网站	[2009-12-9]
47	关于旗下部分基金参与广发银行网上银行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、公司网站	[2009-12-23]
48	关于新增上海银行股份有限公司为华安现金富利投资基金、华安中小盘成长股票型证券投资基金代销机构的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2009-12-29]
49	关于旗下部分基金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、公司网站	[2009-12-31]
50	关于华安旗下部分基金参与农业银行延长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、公司网站	[2009-12-31]
51	关于旗下部分基金参加中国工商银行	上海证券报、证券时报、	[2010-1-4]

	“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、公司网站	
52	关于新增广发华福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、公司网站	[2010-1-14]
53	关于参加广发华福证券有限责任公司网上交易费率优惠活动的公告	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2010-1-14]
54	关于旗下部分基金参加深圳发展银行定期定额申购费率优惠、网上银行及电话银行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、公司网站	[2010-1-18]
55	关于电子直销平台开通“华安-交行网上直销”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、公司网站	[2010-1-18]
56	关于新增万联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、公司网站	[2010-3-15]

§ 12 备查文件目录

- 1、《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》
- 2、《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安中小盘成长股票型证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安中小盘成长股票型证券投资基金设立的文件；
- 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；
- 9、上述文件的存放地点和查阅方式如下：
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
2010 年 3 月 29 日