

安顺证券投资基金 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2009 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 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	华安安顺封闭
基金主代码	500009
交易代码	500009
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 6 月 15 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
报告期末基金份额总额	30 亿份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999 年 6 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。 本基金主要投资于成长型上市公司，并兼顾对收益型上市公司及债券的投资，从而使投资者在承受一定风险的情况下，有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。
投资策略	本基金为平衡型基金，兼顾资本利得、红利及利息收入。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于债券的比例控制在基金资产净值的 20-50%，股票资产的比例控制在 40-80%，现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，60% 左右投资于具有良好成长性的上市公司股票，40% 左右投资于收益型上市公司股票，在此基础上各自上下浮动 10%。本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期 GDP 的增长率。本

	基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定，具有良好分红能力，预期每股收益高于市场平均水平，预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司 (简称“华安基金”)	交通银行股份有限公司 (简称“交通银行”)
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-50099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

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	1,499,978,799.31	-71,703,190.58	5,425,918,775.05
本期利润	2,542,287,673.67	-2,468,175,428.58	6,092,510,714.64
加权平均基金份额本期利润	0.8474	-0.8227	2.0308
本期基金份额净值增长率	77.62%	-38.22%	113.48%
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	0.6614	0.0919	1.4153
期末基金资产净值	5,818,093,253.31	3,275,805,579.64	9,433,981,008.22
期末基金份额净值	1.9394	1.0919	3.1447

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	16.56%	2.89%	-	-	-	-
过去六个月	19.75%	2.56%	-	-	-	-
过去一年	77.62%	2.72%	-	-	-	-
过去三年	134.25%	3.37%	-	-	-	-
过去五年	434.88%	3.03%	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今	734.06%	2.59%	-	-	-	-

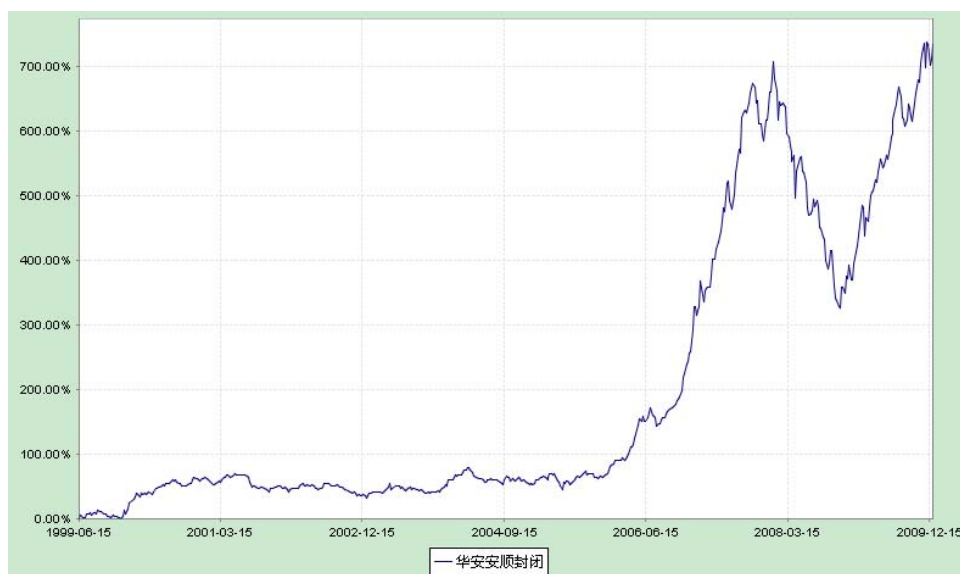
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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

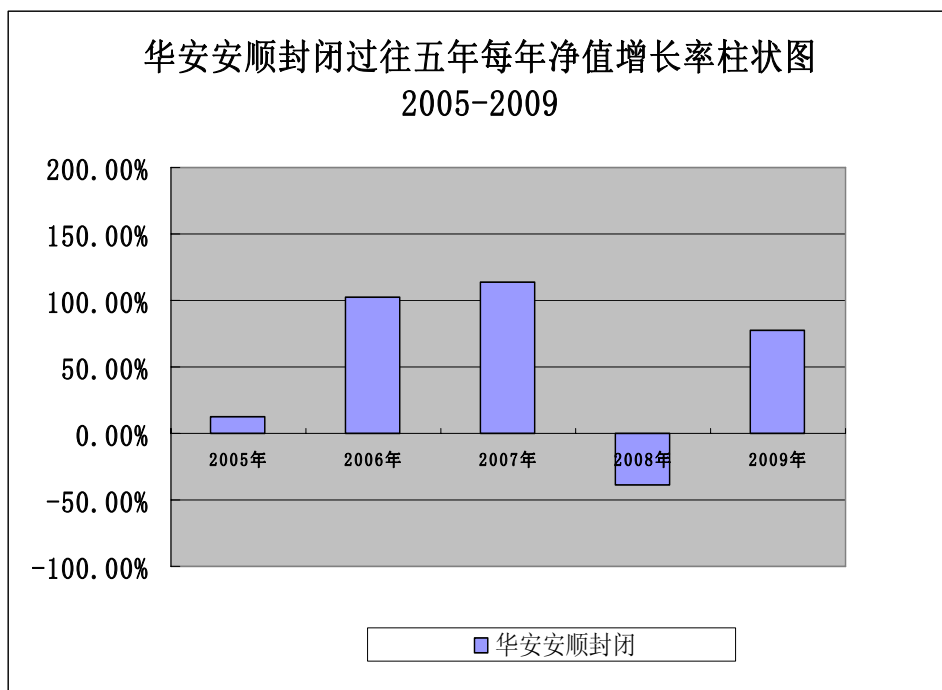
安顺证券投资基金

累计份额净值增长率历史走势图

（1999 年 6 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日）



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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	12.300	3,690,000,000.00	-	3,690,000,000.00	-
2007年	10.800	3,240,000,000.00	-	3,240,000,000.00	-
合计	23.100	6,930,000,000.00	-	6,930,000,000.00	-

§ 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	2003 年 9 月 18 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 月至今担任本基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。
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，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 日起担任本基金和华安宏利股票型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《安顺证券投资基金基金合同》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

按照华安策略优选股票和华安安顺封闭的基金合同，华安策略优选股票和华安安顺封闭都是混合型股票基金。09 年年度，华安策略优选股票净值增长率为 67.60%，华安安顺封闭的净值增长率为 77.62%，华安安顺封闭增长率高于华安策略优选股票 10.02 个百分点。产生较大差异的主要原因在于 8 月份市场出现大幅下跌前后对股票仓位控制上，期间华安策略优选股票基金的股票平均仓位比例为 90.99%，而华安安顺封闭的平均股票仓位为 75.5%。

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 年一开年，中国政府即开始出台了强力的经济刺激政策，包括 4 万亿投资和各大产业振兴计划，银行信贷投放达到历史天量，向实体经济注入了大量流动性。在政策的拉动下，加之自身的活力，中国经济快速回升，各行业业绩大幅改善。随着经济向好，政府也不断调整支持的方向，下半年，扶持政策重点从上半年的保增长转向调结构。A 股市场随着宏观经济的变化和政策调整方向反复向上。上半年市场热点集中于周期性行业，下半年则在稳定性行业，而新兴产业类个股不时表现出其强劲的上涨能力。总体而言，09 年的市场给予了投资人良好的回报，上证综指上涨 80%，深成指上涨 111%。

年初，我们判断经济最差的时候正在过去，连续的财政、货币扩张政策以及产业扶持政策有利于扭转业绩下滑趋势，因此提高了股票配置比例。由于政策的及时支持，中国经济回升势头稳健，为股市提供了坚实的支撑，基于这样的判断，我们在全年保持相对高的仓位，仅在三季度，出于对政策调整的判断，我们在仓位方面有一定的变化。

在操作中，根据政策扶持可能产生的投资机会，及之后经济复苏对产业拉动的变化路径，对投资组合进行相机调整。一季度，根据产业政策的导向，主要增加新能源的配置；二季度，随着各国信贷投入的不断投入，以及经济指标的实质性向好，增加资产、资源等板块的配置比例，同时在后期增加对防御类行业如医药、通讯的配置，使得基金表现在三季度相对平稳；四季度，我们认为调结构将成为政策指向的重点，而各类行业的估值水平已经上升，因此增加了对 TMT 行业的配置，同时也增加了低估值的大型蓝筹股的投资比例，但随后而来的流动性收紧使得配置于大型蓝筹股的收益率在四季度后半期表现不佳。

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 1.9394 元，本报告期份额净值增长率为 77.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2009 年全球都采用了扩张性的货币政策和财政政策，以期将经济拉出次贷危机的泥潭。到年底，各国的经济都实现了增长，中国 09 年四季度的 GDP 增速达到 10.7%，美国的四季度 GDP 季比折年率达到 5.7%。在这样的经济增长势头下，各国陆续开始退出扩张性的政策。1 月，中国开始调高存款准备金率，2 月，美联储提高贴现

率，而在此之前，澳大利亚等一些国家已经开始加息。市场担忧退出政策将导致资金不足，从而对股市产生负面影响。确实，国内09年的信贷大量投放在拉动经济的同时也产生一些副作用，如资产价格的大幅上升，因此在2010年，防通胀必然成为政府的一个政策出发点，从而收紧信贷投放。但同时可以看到，政府调控的速度超过市场的普遍预期，显示当前政府在政策调控上是具有一定前瞻性的。我们认为政策是经济的内生变量，而不是外生变量，在经济前景并非一片坦途的情况下，政策调控将会是相机抉择，而非只紧缩不放松，而且目前实体经济确实已经好转，从而支持企业的盈利增长，这是股价上涨的最根本动因，因此2010年的A股市场依然具备投资机会。只是相比2009年，结构性特点可能更加突出，我们将主要围绕新兴产业、经济结构调整等方向来寻找投资机会。

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

本报告期内本基金未进行收益分配。

2009 年度，将向全体持有人按每 10 份基金份额收益分配金额 6.00 元。红利发放的公告日：2010 年 3 月 26 日，权益登记日：2010 年 3 月 31 日，除息日：2010 年 4 月 1 日，红利发放日：2010 年 4 月 8 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

2009 年度，托管人在安顺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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年度，华安基金管理有限公司在安顺证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、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，符合基金合同的规定。

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

2009 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安顺证券投资基金的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 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，注册会计师马颖施、金毅签字出具了普华永道中天审字(2010)第 20106 号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安顺证券投资基金

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	5,373,411.23	153,730,181.85
结算备付金	36,612,401.73	4,923,933.95
存出保证金	1,921,236.66	713,666.89
交易性金融资产	5,742,161,328.86	3,202,410,784.91
其中：股票投资	4,569,540,010.46	2,516,398,610.41
基金投资	-	-
债券投资	1,172,621,318.40	686,012,174.50
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	33,232,767.23	2,719,152.09
应收利息	18,253,871.33	12,498,038.22
应收股利	-	-
应收申购款	-	-

递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	5,837,555,017.04	3,376,995,757.91
负债和所有者权益	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	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	4,907,349.93	92,130,784.23
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	7,316,503.63	4,217,457.13
应付托管费	1,219,417.30	702,909.50
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	4,842,592.87	3,110,127.41
应交税费	58,900.00	58,900.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,117,000.00	970,000.00
负债合计	19,461,763.73	101,190,178.27
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	2,818,093,253.31	275,805,579.64
所有者权益合计	5,818,093,253.31	3,275,805,579.64
负债和所有者权益总计	5,837,555,017.04	3,376,995,757.91

注：1、报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9394 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：安顺证券投资基金

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	2,656,959,409.18	-2,320,493,105.49
1. 利息收入	34,629,090.61	68,525,726.51
其中：存款利息收入	3,824,544.63	8,149,036.83

债券利息收入	30,772,473.81	60,238,506.60
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	32,072.17	138,183.08
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,579,988,427.18	7,403,122.86
其中：股票投资收益	1,557,778,651.76	-32,253,141.99
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,265,233.99	21,879,517.26
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	279,417.88
股利收益	25,475,009.41	17,497,329.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	1,042,308,874.36	-2,396,472,238.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	33,017.03	50,283.14
减：二、费用	114,671,735.51	147,682,323.09
1. 管理人报酬	71,169,908.07	75,784,267.88
2. 托管费	11,861,651.46	12,644,206.64
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	30,302,717.28	44,264,813.69
5. 利息支出	852,279.66	8,780,283.34
其中：卖出回购金融资产支出	852,279.66	8,780,283.34
6. 其他费用	485,179.04	6,208,751.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	2,542,287,673.67	-2,468,175,428.58
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	2,542,287,673.67	-2,468,175,428.58

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安顺证券投资基金

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）	3,000,000,000.00	275,805,579.64	3,275,805,579.64

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,542,287,673.67	2,542,287,673.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	3,000,000,000.00	2,818,093,253.31	5,818,093,253.31
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）	3,000,000,000.00	6,433,981,008.22	9,433,981,008.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,468,175,428.58	-2,468,175,428.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-3,690,000,000.00	-3,690,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	275,805,579.64	3,275,805,579.64

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	主管会计工作的负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安顺证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司、上海国际信托投资公司(后更名为上海国际信托有限公司)、山东证券有限责任公司(后更名为天同证券有限责任公司)和浙江证券有限责任公司(后更名为方正证券有限责任公司)四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安顺证券投资基金基金契约》(后更名为《安顺证券投资基金基金合同》)发起，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(1999)15 号文批准,于 1999 年 6 月 15 日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期 15 年,发行规模为 30 亿份基金份额。

本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1999)第 36 号文审核同意,于 1999 年 6 月 22 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字(1999)15 号文的有关规定,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。本基金投资组合中,投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的 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》、《安顺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

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[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个

人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》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。

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 本基金发起人
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金托管人
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东 本基金发起人
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
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)
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)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
方正证券有限责任公司(“方正证券”)	本基金发起人
天同证券有限责任公司(“天同证券”)	本基金发起人

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	71,169,908.07	75,784,267.88
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

7.4.8.2.2 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	11,861,651.46	12,644,206.64

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 $\times$ 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3 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
交通银行	29,844,585.62	-	-	-	-	-
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
交通银行	54,652,109.59	159,048,347.24	-	-	-	-

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	11,633,800.00	11,633,800.00
期间申购/买入总份额	-	-
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	11,633,800.00	11,633,800.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.39%	0.39%

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
上海国际信托有限 公司	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
方正证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
天同证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%

注：以上信息摘自中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的截至 2009 年 12 月 31 日安顺证券投资基金持有人名册。

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
交通银行	5,373,411.23	173,010.34	153,730,181.85	4,247,592.23

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

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，按约定利率计息。于 2009 年 12 月 31 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 12 月 31 日：同)。

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）和上年度可比期间内（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）均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	-
600239	云南城投	2009 年 4 月 14 日	预计 2010 年 4 月 12 日	非公开发行流通受限	15.18	22.79	7,000,000	106,260,000.00	159,530,000.00	-
600239	云南城投	2009 年 6 月 16 日	预计 2010 年 4 月 12 日	非公开发行转增部分	-	22.79	3,500,000	-	79,765,000.00	-

600770	综艺股份	2009 年 12 月 21 日	预计 2010 年 12 月 17 日	非公开发行流通受限	12.00	12.20	1,000,000	12,000,000.00	12,200,000.00	-
000887	中鼎股份	2009 年 2 月 12 日	2010 年 2 月 25 日	非公开发行流通受限	6.16	13.96	5,000,000	30,800,000.00	69,800,000.00	-
000887	中鼎股份	2009 年 6 月 12 日	2010 年 2 月 25 日	非公开发行送股部分	-	13.96	1,000,000	-	13,960,000.00	-
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	-
300037	新宙邦	2009 年 12 月 28 日	2010 年 1 月 8 日	网上新股认购	28.99	28.99	500	14,495.00	14,495.00	-
300041	回天胶业	2009 年 12 月 28 日	2010 年 1 月 8 日	网上新股认购	36.40	36.40	500	18,200.00	18,200.00	-

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。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。

7.4.9.2 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

截至本报告期末 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	4,569,540,010.46	78.28
	其中：股票	4,569,540,010.46	78.28
2	固定收益投资	1,172,621,318.40	20.09
	其中：债券	1,172,621,318.40	20.09
	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	41,985,812.96	0.72
6	其他各项资产	53,407,875.22	0.91
7	合计	5,837,555,017.04	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	63,117,713.10	1.08
B	采掘业	342,829,432.00	5.89
C	制造业	1,804,672,267.02	31.02
C0	食品、饮料	415,227,092.00	7.14
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	179,195,498.58	3.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,966,875.55	1.05
C5	电子	60,118,921.00	1.03
C6	金属、非金属	167,570,578.20	2.88
C7	机械、设备、仪表	626,740,625.86	10.77
C8	医药、生物制品	294,852,675.83	5.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	231,406,520.00	3.98
F	交通运输、仓储业	244,500.00	0.00
G	信息技术业	179,331,978.24	3.08
H	批发和零售贸易	108,974,057.11	1.87
I	金融、保险业	1,096,892,386.00	18.85
J	房地产业	340,396,922.64	5.85
K	社会服务业	156,399,546.31	2.69
L	传播与文化产业	53,858,061.04	0.93
M	综合类	191,416,627.00	3.29
	合计	4,569,540,010.46	78.54

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	600196	复星医药	14,999,909	293,548,219.13	5.05
2	600519	贵州茅台	1,599,000	271,542,180.00	4.67
3	600239	云南城投	10,500,000	239,295,000.00	4.11
4	600036	招商银行	13,199,900	238,258,195.00	4.10
5	601166	兴业银行	5,900,000	237,829,000.00	4.09
6	601318	中国平安	4,199,900	231,372,491.00	3.98
7	601668	中国建筑	48,990,000	231,232,800.00	3.97
8	601398	工商银行	40,000,000	217,600,000.00	3.74
9	601088	中国神华	6,190,000	215,535,800.00	3.70
10	600415	小商品城	3,999,900	178,915,527.00	3.08

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	600585	海螺水泥	393,158,413.36	12.00
2	600036	招商银行	350,945,570.60	10.71
3	600016	民生银行	312,772,423.20	9.55
4	601318	中国平安	312,634,481.41	9.54
5	601169	北京银行	302,081,229.59	9.22
6	601166	兴业银行	290,548,568.03	8.87
7	601668	中国建筑	286,891,648.37	8.76
8	601398	工商银行	285,692,462.81	8.72
9	002024	苏宁电器	245,774,912.71	7.50
10	600519	贵州茅台	244,826,495.13	7.47
11	601088	中国神华	240,805,891.75	7.35
12	600675	中华企业	233,387,431.13	7.12
13	000718	苏宁环球	211,761,651.96	6.46
14	000069	华侨城 A	197,895,167.52	6.04
15	600395	盘江股份	182,078,911.08	5.56
16	600166	福田汽车	181,431,020.43	5.54
17	600030	中信证券	175,442,396.09	5.36
18	600415	小商品城	174,966,383.37	5.34
19	600256	广汇股份	173,939,801.15	5.31

20	600123	兰花科创	163,377,910.19	4.99
21	600586	金晶科技	160,320,814.16	4.89
22	600588	用友软件	145,062,124.55	4.43
23	600196	复星医药	140,692,742.84	4.29
24	600050	中国联通	139,183,992.61	4.25
25	600875	东方电气	131,541,193.58	4.02
26	600195	中牧股份	130,878,046.36	4.00
27	600635	大众公用	120,875,955.73	3.69
28	000651	格力电器	119,452,156.19	3.65
29	600162	香江控股	113,625,670.69	3.47
30	601899	紫金矿业	113,592,657.78	3.47
31	600239	云南城投	106,260,000.00	3.24
32	600028	中国石化	104,864,650.59	3.20
33	600298	安琪酵母	103,244,744.69	3.15
34	600718	东软集团	99,174,335.27	3.03
35	600153	建发股份	93,203,815.80	2.85
36	600000	浦发银行	88,155,202.00	2.69
37	000800	一汽轿车	86,744,178.70	2.65
38	000001	深发展 A	86,476,226.47	2.64
39	601918	国投新集	80,576,192.21	2.46
40	002068	黑猫股份	79,934,257.97	2.44
41	600085	同仁堂	78,914,973.85	2.41
42	000792	盐湖钾肥	77,585,895.11	2.37
43	601857	中国石油	76,521,301.78	2.34
44	000698	沈阳化工	74,455,803.93	2.27
45	000656	ST 东 源	71,419,227.02	2.18
46	000090	深 天 健	71,124,626.53	2.17
47	002133	广宇集团	71,025,571.73	2.17
48	600887	*ST 伊利	69,618,131.42	2.13
49	002152	广电运通	69,421,396.18	2.12
50	601988	中国银行	67,539,713.77	2.06

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	600585	海螺水泥	341,760,093.08	10.43
2	600016	民生银行	322,547,080.74	9.85
3	601169	北京银行	312,070,645.71	9.53
4	601166	兴业银行	288,072,580.52	8.79

5	002024	苏宁电器	273,156,332.72	8.34
6	601088	中国神华	273,084,335.61	8.34
7	600036	招商银行	258,912,070.89	7.90
8	600030	中信证券	245,420,788.35	7.49
9	600675	中华企业	231,188,442.75	7.06
10	000698	沈阳化工	229,000,291.89	6.99
11	600256	广汇股份	208,775,295.49	6.37
12	600586	金晶科技	196,980,754.03	6.01
13	600395	盘江股份	188,902,285.46	5.77
14	601398	工商银行	184,412,924.63	5.63
15	600309	烟台万华	179,483,540.69	5.48
16	600895	张江高科	166,960,745.42	5.10
17	601318	中国平安	161,822,942.48	4.94
18	600050	中国联通	153,188,361.52	4.68
19	601899	紫金矿业	151,701,976.79	4.63
20	600875	东方电气	143,191,336.36	4.37
21	600000	浦发银行	138,624,449.04	4.23
22	600887	*ST 伊利	138,118,120.46	4.22
23	600635	大众公用	137,836,940.69	4.21
24	600519	贵州茅台	137,450,215.19	4.20
25	600195	中牧股份	137,330,151.22	4.19
26	600153	建发股份	134,931,181.00	4.12
27	000001	深发展 A	131,510,309.76	4.01
28	002202	金风科技	120,576,272.96	3.68
29	000792	盐湖钾肥	117,207,500.84	3.58
30	000983	西山煤电	115,924,139.76	3.54
31	600718	东软集团	111,923,409.92	3.42
32	600499	科达机电	111,079,395.75	3.39
33	601918	国投新集	103,200,290.30	3.15
34	002068	黑猫股份	100,383,738.72	3.06
35	600028	中国石化	99,400,951.23	3.03
36	601601	中国太保	98,233,225.64	3.00
37	600561	江西长运	92,024,736.59	2.81
38	600649	城投控股	91,714,487.65	2.80
39	600085	同仁堂	91,404,346.72	2.79
40	000800	一汽轿车	90,891,597.48	2.77
41	600475	华光股份	89,470,393.25	2.73
42	000090	深 天 健	88,759,268.28	2.71
43	600202	哈空调	85,628,937.45	2.61
44	000002	万 科 A	82,269,583.37	2.51
45	600315	上海家化	79,596,617.64	2.43

46	600266	北京城建	79,261,107.45	2.42
47	000651	格力电器	78,894,197.44	2.41
48	600820	隧道股份	78,535,015.04	2.40
49	601857	中国石油	78,102,367.83	2.38
50	600428	中远航运	77,477,340.62	2.37
51	600271	航天信息	75,479,964.83	2.30
52	002133	广宇集团	72,333,468.44	2.21
53	601988	中国银行	71,959,157.34	2.20
54	600522	中天科技	69,080,626.15	2.11
55	600426	华鲁恒升	68,827,049.37	2.10
56	600415	小商品城	68,345,635.58	2.09
57	600489	中金黄金	68,113,876.12	2.08
58	600166	福田汽车	66,224,617.20	2.02

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	9,598,705,874.17
卖出股票收入（成交）总额	10,160,354,496.16

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	176,029,118.40	3.03
2	央行票据	763,747,000.00	13.13
3	金融债券	232,845,200.00	4.00
	其中：政策性金融债	232,845,200.00	4.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,172,621,318.40	20.15

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	0901042	09 央票 42	1,400,000	137,564,000.00	2.36
2	0901036	09 央票 36	1,200,000	117,948,000.00	2.03
3	0801050	08 央票 50	1,000,000	102,930,000.00	1.77
4	0801044	08 央票 44	1,000,000	102,880,000.00	1.77
5	070401	07 农发 01	700,000	70,049,000.00	1.2

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	1,921,236.66
2	应收证券清算款	33,232,767.23
3	应收股利	—
4	应收利息	18,253,871.33
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	53,407,875.22

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债债券。

8.9.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公	占基金资产净值比	流通受限情况说明
----	------	------	----------	----------	----------

			允价值	例 (%)	
1	600239	云南城投	239, 295, 000. 00	4. 11	非公开发行股票未上市

§ 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
56, 122	53, 454. 97	1, 655, 086, 833. 00	55. 17%	1, 344, 913, 167. 00	44. 83%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	286, 641, 820. 00	9. 55%
2	中国人寿保险（集团）公司	282, 312, 920. 00	9. 41%
3	太平人寿保险有限公司	120, 110, 787. 00	4. 00%
4	宝钢集团有限公司	88, 989, 466. 00	2. 97%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	78, 625, 523. 00	2. 62%
6	嘉禾人寿保险股份有限公司	62, 477, 390. 00	2. 08%
7	新华人寿保险股份有限公司	59, 923, 929. 00	2. 00%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	55, 735, 335. 00	1. 86%
9	信诚人寿保险有限公司	37, 690, 537. 00	1. 26%
10	中国平安保险（集团）股份有限公司	35, 687, 116. 00	1. 19%

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 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、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘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 94,000 元。

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
高华证券有限责任公司	1	3,644,666,007.69	18.61%	3,097,945.99	18.79%	-
海通证券股份有限公司	1	2,062,925,712.59	10.53%	1,753,474.20	10.64%	-
中国国际金融有限公司	1	550,675,182.16	2.81%	468,073.28	2.84%	-
中信建投证券有限责任公司	2	2,105,573,257.78	10.75%	1,754,163.23	10.64%	-

招商证券股份有限公司	1	1,359,641,538.19	6.94%	1,104,716.94	6.70%	-
中信证券股份有限公司	2	1,844,997,274.04	9.42%	1,554,028.90	9.43%	-
东方证券股份有限公司	2	4,495,360,496.94	22.95%	3,767,067.31	22.85%	-
申银万国证券股份有限公司	2	1,456,338,401.15	7.44%	1,232,170.62	7.47%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	2,063,754,925.81	10.54%	1,754,179.00	10.64%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	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
高华证券有限责任公司	1	128,038,946.50	25.95%	340,000,000.00	22.65%
海通证券股份有限公司	1	64,765,321.70	13.13%	100,000,000.00	6.66%
中国国际金融有限公司	1	8,835,276.50	1.79%	78,000,000.00	5.20%
中信建投证券有限责任公司	2	27,593,804.50	5.59%	130,000,000.00	8.66%
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	26,261,998.80	5.32%	100,000,000.00	6.66%
东方证券股份有限公司	2	68,116,014.30	13.80%	-	-
申银万国证券股份有限公司	2	68,859,560.00	13.95%	500,000,000.00	33.30%
国泰君安证券股份有限公司	1	100,969,306.60	20.46%	253,300,000.00	16.87%

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

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. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

无。

华安基金管理有限公司
2010 年 3 月 29 日