华安创新证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
送出日期:2009年8月28日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极追求投资收益的稳定增长为目标,以诚信原则及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。
投资策略	本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。 这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。 高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域,包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。 传统产业类型的上市公司中,如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新,具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。 本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素:公司创新能力强,主营业务市场空间大,财务状况良好,具有相当竞争优势等。 本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产,如国债和现金,从而保持基金资产良好的流动性。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-68888917
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-50099	95559
传真		021-68863414	021-58408842

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	上海市浦东南路360号新上海国际大厦38楼

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	-196,617,217.33
本期利润	2,116,734,674.13
加权平均基金份额本期利润	0.1668
本期基金份额净值增长率	30.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2660
期末基金资产净值	8,247,744,702.21
期末基金份额净值	0.710

注:

1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.65%	0.76%	10.57%	0.89%	-4.92%	-0.13%
过去三个月	12.34%	1.04%	18.90%	1.14%	-6.56%	-0.10%
过去六个月	30.51%	1.18%	53.64%	1.45%	-23.13%	-0.27%
过去一年	5.03%	1.38%	11.41%	1.90%	-6.38%	-0.52%
过去三年	109.70%	1.53%	99.57%	1.81%	10.13%	-0.28%
自基金合同生效起至今	269.36%	1.18%	94.26%	1.39%	175.10%	-0.21%

注:

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

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

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

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

华安创新证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2001年9月21日至2009年6月30日)

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立,是国内首批基金管理公司之一,注册资本1.5亿元人民币,公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气(集团)总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资(集团)有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和上海沸点投资发展有限公司。

截至2009年6月30日,公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭2只封闭式证券投资基金,华安创新股票、华安中国A股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安国际配置(QDII)等12只开放式基金,管理资产规模达到790.62亿人民币、0.972亿美元。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘新勇	本基金的基金经理	2003年9月18日	2009年3月27日	12年	硕士,持有基金从业人员资格证书,12年证券从业经历。曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999年5月加入华安基金管理有限公司后,曾任研究发展部高级研究员,2002年11月至2003年9月担任华安上证180指数增强型证券投资基金(后更名为华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金)的基金经理,2003年9月至2009年3月担任本基金的基金经理,2007年4月至2008年2月期间曾担任安信证券投资基金的基金经理。
汪光成	本基金的基金经理	2009年3月27日	-	7年	管理学博士,持有基金从业资格证书,7年证券、基金行业从业经历, 2002年1月加入华安基金管理有限公司后,曾先后在战略策划部、研究发展部从事数量分析和行业研究工作。2008年2月-2009年3月担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2009年3月27日起担任本基金的基金经理。

注:此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安创新证券投资基金基金合同》、《华安创新证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在控制风险的前提下,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

华安旗下以成长为投资风格的有3个基金:华安中小盘成长股票、华安创新混合、基金安信封闭。09年上半年,三基金净值增长率分别为:华安中小盘成长股票56.75%、华安创新混合30.51%、华安安信封闭36.24%,华安中小盘成长股票的增长率高于华安创新混合和华安安信封闭。股票仓位的差异是三基金业绩差异较大的主要原因。。上半年内,华安中小盘成长股票、华安创新混合和华安安信封闭的股票仓位的比例平均仓位为77.68%、60.72%与70.60%,华安中小盘成长股票的平均持仓比例明显要高于另外两个基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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

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

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2009年下半年,国内经济复苏特征明显,刺激市场上涨的三大因素货币流动性、政策和复苏预期依然存在,市场将可能围绕经济或行业复苏不断演绎结构性行情,但市场同时也将在业绩和预期之间经受考验,而在持续宽松的货币政策下,通胀预期开始出现,国家政策可能出现一些微调,虽然对宏观经济运行趋势影响不大,但可能对投资者情绪产生重要影响。在这些因素的作用下,我们判断市场仍然将保持强势特征,但震荡可能会加剧。

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化:

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响:

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述:

(1)公司方面

公司建立基金估值委员会,组成人员包括:首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部负责人、金融工程部负责人、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括:证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时,负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值;同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历:

姓名	职务	工作经历
王国卫	首席投资官	研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作,1998年加入华安基金管理公司,曾任基金安信的基金经理、华安180指数增强型基金、基金安久的基金经理,投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。
尚志民	基金投资部总经理	工商管理硕士,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员,基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理,现任基金安顺、华安宏利的基金经理,基金投资部总经理。
宋磊	研究发展部总经理	工学硕士,曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作,2000年2月加入华安基金管理公司,在基金研究发展部从事化工行业研究,现任研究发展部总经理。
黄勤	固定收益部负责人	经济学硕士,13年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004年8月加入华安基金管理公司,曾任固定收益部债券投资经理,现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。
许之彦	金融工程部负责人	理学博士,曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,现任华安中国A股基金经理,金融工程部负责人。
朱永红	基金运营部总经理	经济学学士,ACCA英国特许公认会计师公会会员,CPA中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000年10月加入华安基金管理公司,现任基金运营部总经理。

(2)托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任,并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3)会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度:

本基金的基金经理未参与基金的估值。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突:

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息:

无。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期由于基金投资当期亏损,不进行收益分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:华安创新证券投资基金

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资 产:			
银行存款		135,669,462.49	530,257,164.25
结算备付金		191,076,639.39	5,539,093.77
存出保证金		2,790,529.31	1,648,908.58
交易性金融资产		7,956,592,687.87	6,707,670,478.69
其中:股票投资		5,960,016,558.67	3,461,207,558.39
基金投资		-	-
债券投资		1,996,576,129.20	3,246,462,920.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		17,171,430.19	-
应收利息		34,842,410.90	60,821,381.21
应收股利		2,664,314.96	-
应收申购款		1,763,835.90	671,760.49
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,342,571,311.01	7,306,608,786.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30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		64,691,714.71	140,490,958.66
应付赎回款		10,256,652.41	1,585,468.38
应付管理人报酬		10,129,808.55	9,190,284.95
应付托管费		1,688,301.41	1,531,714.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,886,264.71	4,015,842.86
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		1,173,867.01	1,021,589.75
负债合计		94,826,608.80	157,835,858.74
所有者权益:			
实收基金		2,703,637,907.91	3,059,772,856.80
未分配利润		5,544,106,794.30	4,089,000,071.45
所有者权益合计		8,247,744,702.21	7,148,772,928.25
负债和所有者权益总计		8,342,571,311.01	7,306,608,786.99

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

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

6.2 利润表

会计主体:华安创新证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年6月30日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日
一、收入		2,211,424,682.53	-4,254,868,396.67
1.利息收入		49,042,138.91	60,404,257.77
其中:存款利息收入		3,643,712.16	6,741,186.10
债券利息收入		45,398,426.75	53,663,071.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-152,157,986.00	-1,562,057,262.60
其中:股票投资收益		-220,697,846.48	-1,588,105,471.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益		35,777,058.90	1,512,893.81
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	136,199.42
股利收益		32,762,801.58	24,399,115.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		2,313,351,891.46	-2,757,143,461.81
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,188,638.16	3,928,069.97
二、费用(以"-"号填列)		-94,690,008.40	-151,867,724.50
1.管理人报酬		-59,142,149.00	-88,849,823.00
2.托管费		-9,857,024.78	-14,808,303.83
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-25,453,095.61	-39,166,465.42
5.利息支出		-	-8,793,518.62
其中:卖出回购金融资产支出		-	-8,793,518.62
6.其他费用		-237,739.01	-249,613.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		2,116,734,674.13	-4,406,736,121.17
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		2,116,734,674.13	-4,406,736,121.17

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

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安创新证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,059,772,856.80	4,089,000,071.45	7,148,772,928.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,116,734,674.13	2,116,734,674.13
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-356,134,948.89	-661,627,951.28	-1,017,762,900.17
其中:1.基金申购款	34,319,124.21	58,562,410.87	92,881,535.08
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-390,454,073.10	-720,190,362.15	-1,110,644,435.25
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,703,637,907.91	5,544,106,794.30	8,247,744,702.21
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,364,097,609.57	11,051,219,465.26	14,415,317,074.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,406,736,121.17	-4,406,736,121.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(减少以"-"号填列)	-231,715,079.40	-675,538,588.30	-907,253,667.70
其中:1.基金申购款	75,516,809.71	180,199,663.57	255,716,473.28
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-307,231,889.11	-855,738,251.87	-1,162,970,140.98
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	3,132,382,530.17	5,968,944,755.79	9,101,327,285.96

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安创新证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2001]第33号《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华安创新证券投资基金基金契约》(后更名为《华安创新证券投资基金基金合同》)发起,并于2001年9月21日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币5,000,001,124.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2001)第84号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安创新证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金的股票、债券投资比例不低于基金资产总值的80%;投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的20%。本基金的业绩比较基准为中信标普300指数收益率×75%+中信标普国债指数收益率×25%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2009年8月27日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>(试行)》等问题的通知、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安创新证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2009年6月30日的财务状况以及2009上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期半年度报告一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》及其他相关税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a)以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(b)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(c)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定即20%代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(d)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(e)卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司("华安基金公司")	基金管理人 基金销售机构 基金注册登记机构
交通银行股份有限公司("交通银行")	基金托管人 基金代销机构

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

本报告期通过关联人交易单元的股票成交量:无。

上年度可比期间通过关联人交易单元的股票成交量:无

6.4.7.1.2 权证交易

本报告期通过关联人交易单元的权证成交量:无。

上年度可比期间通过关联人交易单元的权证成交量:无。

6.4.7.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期应支付关联方的佣金:无。

上年度可比期间应支付关联方的佣金:无。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

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

注:支付基金管理人华安基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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

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

日基金托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

本期(2009年1月1日至2009年6月30日)						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行	110,094,346.58	71,580,426.44	-	-	-	-
上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)						
银行间市场交易的各关联方名称	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	297,480,000.00	99,892,538.46	-	-	785,600,000.00	417,121.32

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)	上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)
期初持有的基金份额	15,260,320.32	-
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	7,196,909.85	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	22,457,230.17	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.19%	-

注:1、基金管理人华安基金管理有限公司在本半年度运用固有资金4,200,000.00元经代销机 构购入本基金7,196,909.85份基金份额,申购费25,049.70元,申购费率0.6%

2、申购含红利再投资、转换转入份额,赎回含转换转出份额

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况:无。

上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况:无。

6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期(2009年1月1日至2009年6月30日)		上年度可比期间(2008年1月1日至2008年6月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	135,669,462.49	1,132,827.43	796,737,523.59	4,419,088.59

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

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.8 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
600239	云南城投	2009年4月14日	2010年4月12日	非公开发行	15.18	13.34	5,000,000	75,900,000.00	66,700,000.00
600239	云南城投	2009年6月16日	2010年4月12日	非公开发行送股转增部分	-	13.34	2,500,000	-	33,350,000.00

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金无持有的暂时停牌股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末2009年6月30日止,本基金无正回购余额。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,960,016,558.67	71.44
	其中:股票	5,960,016,558.67	71.44
2	固定收益投资	1,996,576,129.20	23.93
	其中:债券	1,996,576,129.20	23.93
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	326,746,101.88	3.92
6	其他资产	59,232,521.26	0.71
7	合计	8,342,571,311.01	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	524,095,957.53	6.35
C	制造业	1,743,718,025.12	21.14
C0	食品、饮料	124,597,902.00	1.51
C1	纺织、服装、皮毛	34,000,000.00	0.41
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	86,972,294.46	1.05
C4	石油、化学、塑胶、塑料	119,382,511.45	1.45
C5	电子	76,593,442.99	0.93
C6	金属、非金属	228,977,089.27	2.78
C7	机械、设备、仪表	758,454,194.54	9.20
C8	医药、生物制品	258,985,349.91	3.14
C99	其他制造业	55,755,240.50	0.68
D	电力、煤气及水的生产和供应业	313,441,482.21	3.80
E	建筑业	35,028,879.02	0.42
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	303,255,776.60	3.68
H	批发和零售贸易	354,473,173.85	4.30
I	金融、保险业	1,851,383,841.76	22.45
J	房地产业	541,999,375.52	6.57
K	社会服务业	24,300,000.00	0.29
L	传播与文化产业	127,705,654.32	1.55
M	综合类	140,614,392.74	1.70
	合计	5,960,016,558.67	72.26

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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	600000	浦发银行	26,911,907	619,512,099.14	7.51
2	600016	民生银行	48,000,000	380,160,000.00	4.61
3	601318	中国平安	5,500,000	272,030,000.00	3.30
4	601169	北京银行	14,000,000	227,640,000.00	2.76
5	002024	苏宁电器	14,069,666	226,099,532.62	2.74
6	000651	格力电器	10,425,000	217,882,500.00	2.64
7	600196	复星医药	14,099,959	204,308,405.91	2.48
8	601899	紫金矿业	20,000,000	204,000,000.00	2.47
9	600675	中华企业	11,700,000	186,732,000.00	2.26
10	601168	西部矿业	11,000,000	167,640,000.00	2.03

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网站的半年度报告正文

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	299,825,151.29	4.19
2	600000	浦发银行	297,855,599.15	4.17
3	601899	紫金矿业	260,776,335.58	3.65
4	600030	中信证券	222,665,140.20	3.11
5	601168	西部矿业	211,362,640.19	2.96
6	601318	中国平安	185,660,068.61	2.60
7	600196	复星医药	178,645,469.46	2.50
8	601699	潞安环能	141,828,150.06	1.98
9	600005	武钢股份	139,249,897.51	1.95
10	601169	北京银行	138,934,962.39	1.94
11	601939	建设银行	138,782,751.06	1.94
12	002202	金风科技	123,088,067.69	1.72
13	601601	中国太保	122,240,373.61	1.71
14	600309	烟台万华	121,954,422.24	1.71
15	600675	中华企业	118,210,307.26	1.65
16	600635	大众公用	111,130,727.04	1.55
17	600795	国电电力	106,221,715.12	1.49
18	601918	国投新集	105,178,019.45	1.47
19	600028	中国石化	105,096,992.53	1.47
20	600089	特变电工	100,701,073.67	1.41

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600030	中信证券	320,194,360.00	4.48
2	600036	招商银行	299,401,431.09	4.19
3	600309	烟台万华	214,056,121.56	2.99
4	601088	中国神华	206,130,726.42	2.88
5	000002	万 科A	194,716,108.22	2.72
6	600519	贵州茅台	182,193,734.55	2.55
7	601939	建设银行	169,810,197.04	2.38
8	601398	工商银行	166,359,677.03	2.33
9	600089	特变电工	164,259,296.00	2.30
10	600028	中国石化	161,887,274.62	2.26
11	000983	西山煤电	161,034,073.71	2.25
12	601699	潞安环能	154,772,597.74	2.17
13	600000	浦发银行	140,595,402.35	1.97
14	600858	银座股份	136,979,253.91	1.92
15	600048	保利地产	134,348,235.05	1.88
16	601601	中国太保	131,716,752.45	1.84
17	600439	瑞贝卡	123,840,770.14	1.73
18	601899	紫金矿业	121,184,771.40	1.70
19	002022	科华生物	113,516,578.05	1.59
20	600426	华鲁恒升	109,574,928.93	1.53

注:本项的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

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

注:本项的"买入金额"(或"买入股票成本")、"卖出金额"(或"卖出股票收入")均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	154,205,129.20	1.87
2	央行票据	1,198,619,000.00	14.53
3	金融债券	643,752,000.00	7.81
	其中:政策性金融债	643,752,000.00	7.81
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,996,576,129.20	24.21

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801035	08央票35	3,000,000	314,490,000.00	3.81
2	0801005	08央票05	3,000,000	313,170,000.00	3.80
3	070227	07国开27	1,200,000	131,484,000.00	1.59
4	0801044	08央票44	1,200,000	125,940,000.00	1.53
5	080216	08国开16	1,000,000	106,080,000.00	1.29

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的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。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

7.9.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

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

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
549,684	21,137.11	376,541,102.56	3.24%	11,242,189,412.34	96.76%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	-	168,369.71	0.0014%
	合计	168,369.71	0.0014%

§9 开放式基金份额变动

单位:份

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

注:申购含红利再投资、转换转入份额,赎回含转换转出份额

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1.基金管理人的专门基金托管部门的重大人事变动:

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

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

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

2. 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动:无。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金改聘为其审计的会计师事务所情况:无。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 股票交易

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方证券股份有限公司	1	304,200,661.44	1.83%	247,164.92	1.76%	-
广发证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2	2,508,890,055.77	15.08%	2,121,479.11	15.14%	-
国信证券有限责任公司	1	286,919,288.07	1.72%	233,124.31	1.66%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	1,616,286,235.45	9.72%	1,313,249.78	9.37%	-
申银万国证券股份有限公司	2	2,265,397,216.37	13.62%	1,925,573.07	13.74%	-
中国银河证券股份有限公司	1	2,739,461,253.29	16.47%	2,328,523.58	16.62%	-
招商证券股份有限公司	1	580,328,302.99	3.49%	493,279.59	3.52%	-
中国国际金融有限公司	1	5,418,172,421.28	32.57%	4,605,421.53	32.87%	-
联合证券有限责任公司	1	917,236,894.33	5.51%	745,264.04	5.32%	-
合计	13	16,636,892,328.99	100.00%	14,013,079.93	100.00%	

10.7.2 债券、权证交易

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方证券股份有限公司	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-
国信证券有限责任公司	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	5,310,000.00	4.23%	-	-
申银万国证券股份有限公司	62,804,481.30	50.00%	-	-
中国银河证券股份有限公司	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	1,275,589.00	1.02%	-	-
中国国际金融有限公司	56,213,264.50	44.75%	-	-
联合证券有限责任公司	-	-	-	-
合计	125,603,334.80	100.00%	-	-

注:

1、券商专用交易单元选择标准:

基金管理人负责选择证券经营机构,选用其交易单元供本基金证券买卖专用,选择标准为:

(1)内部管理规范、严谨;具备健全的内控制度,并能满足基金运作高度保密的要求;

(2)研究实力较强,有固定的研究机构和专门研究人员,能够针对本基金业务需要,提供高质量的研究报告和较为全面的服务;

(3)具有战略规划和定位,能够积极推动多边业务合作,最大限度地调动整体资源,为基金投资赢取机会;

(4)其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序:

(1)对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部/市场部分别牵头并组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》,对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2)填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部或基金投资部/市场部汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果,择优选出拟新增单元,填写《新增交易单元申请审核表》,对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3)候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或基金投资部/市场部提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核,并签署审批意见。

(4)协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元使用协议》,并通知基金托管人。

3、本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

华安基金管理有限公司
2009年8月28日