华安创新证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09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
报告送出日期:二〇〇九年十月二十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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	11,250,954,296.64份	
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	
风险收益特征	无。	
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	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)
1.本期已实现收益	559,053,241.89
2.本期利润	-289,393,502.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0254
4.期末基金资产净值	7,683,031,476.62
5.期末基金份额净值	0.683

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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3个月	-3.80%	1.82%	-3.51%	1.80%	-0.29%	0.02%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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9月30日)

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
汪光成	本基金的基金经理	2009-3-27	-	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。

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 公平交易专项说明

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《帐户》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《帐户》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、基金安信封闭。09年第三季度,三基金净值增长率分别为:华安中小盘成长股票0.11%、华安创新混合-3.80%、华安安信封闭0.82%,三基金的业绩增长率差异未超过5%。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本季度没有出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2009年第3季度,宏观经济继续向好,但国家货币政策出现微调,受此影响,市场在矛盾之中出现了大幅度的波动,在经历了7月份的继续上涨之后,8月份出现了较大幅度的下跌,9月份则呈现出盘整格局。在此期间,周期性行业调整幅度比较大,而防御性行业如食品饮料、医药、商业等调整幅度较小,部分股票甚至出现上涨。

本报告期内,本基金继续围绕经济复苏展开布局,重点配置在金融、地产和资源类行业,由于对政策微调造成的投资者情绪变化估计不足,股票仓位下降幅度不大,且组合结构主要以周期性股票为主,因此在市场回调过程中净值下跌比较明显。

展望4季度,全球经济出现了明显的好转,而国内宏观经济复苏特征明显,我们认为,虽然目前国内宏观经济政策出现了微调,但宏观经济向好的局面并不会发生变化,市场将在业绩和预期之间经受考验,那些业绩出现实质性转折或预期向好的周期性行业,将再次获得超额收益。不过,主板市场IPO和再融资的规模、创业板的上市力度等,可能成为影响未来市场走势的一个重要因素。

基于上述判断,本基金在配置上仍然侧重于金融、房地产、资源类行业和可选消费品(如家电和汽车)等,而在个股选择上则考虑业绩变化趋势、资源属性和估值水平等。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,339,145,125.59	69.28
	其中:股票	5,339,145,125.59	69.28
2	固定收益投资	1,699,785,974.90	22.06
	其中:债券	1,699,785,974.90	22.06
	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	617,586,352.52	8.01
6	其他资产	50,435,659.68	0.65
7	合计	7,706,953,112.69	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	18,201,049.08	0.24
B	采掘业	289,502,095.78	3.77
C	制造业	2,345,197,227.94	30.52
C0	食品、饮料	145,711,762.63	1.90
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	133,845,377.82	1.74
C4	石油、化学、塑胶、塑料	264,005,180.76	3.44
C5	电子	94,003,419.00	1.22
C6	金属、非金属	675,420,918.80	8.79
C7	机械、设备、仪表	846,763,926.19	11.02
C8	医药、生物制品	166,114,207.14	2.16
C99	其他制造业	19,332,435.60	0.25
D	电力、煤气及水的生产和供应业	422,610,000.00	5.50
E	建筑业	149,889,174.56	1.95
F	交通运输、仓储业	97,185,852.27	1.26
G	信息技术业	194,627,195.85	2.53
H	批发和零售贸易	100,701,366.84	1.31
I	金融、保险业	1,249,729,670.19	16.27
J	房地产业	332,283,815.63	4.32
K	社会服务业	70,311,780.00	0.92
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	68,905,897.45	0.90
	合计	5,339,145,125.59	69.49

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600000	浦发银行	21,540,219	423,265,303.35	5.51
2	600016	民生银行	37,678,263	253,951,492.62	3.31
3	600585	海螺水泥	5,499,933	236,662,116.99	3.08
4	601318	中国平安	4,500,000	228,150,000.00	2.97
5	000651	格力电器	10,000,000	218,000,000.00	2.84
6	600649	城投控股	17,000,000	188,530,000.00	2.45
7	600675	中华企业	13,000,000	182,390,000.00	2.37
8	600030	中信证券	7,010,000	175,320,100.00	2.28
9	601169	北京银行	9,000,000	155,070,000.00	2.02
10	600067	冠城大通	11,000,000	145,310,000.00	1.89

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	86,943,500.30	1.13
2	央行票据	1,105,185,000.00	14.38
3	金融债券	505,535,000.00	6.58
	其中:政策性金融债	505,535,000.00	6.58
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	2,122,474.60	0.03
7	其他	-	-
8	合计	1,699,785,974.90	22.12

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0801035	08央票35	3,000,000	310,710,000.00	4.04
2	0801005	08央票05	3,000,000	309,780,000.00	4.03
3	070227	07国开27	1,200,000	127,896,000.00	1.66
4	0901042	09央票42	1,300,000	127,764,000.00	1.66
5	0901047	09央票47	1,200,000	119,604,000.00	1.56

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,915,760.84
2	应收证券清算款	12,367,688.22
3	应收股利	-
4	应收利息	33,813,288.19
5	应收申购款	1,338,922.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	50,435,659.68

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	11,618,730,514.90
报告期期间基金总申购份额	91,947,347.47
报告期期间基金总赎回份额	459,723,565.73
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	11,250,954,296.64

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安创新证券投资基金基金合同》

2、《华安创新证券投资基金招募说明书》

3、《华安创新证券投资基金托管协议》

7.2 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。

7.3 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

二〇〇九年十月二十八日

华安核心优选股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09月30日

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇〇九年十月二十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年10月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安核心股票	
交易代码	040011(前端)	041011(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年10月22日	
报告期末基金份额总额	261,310,150.71份	
投资目标	本基金采取"核心-卫星"股票投资策略,通过"核心"资产-沪深300指数成份股的投资力求获取股票市场整体增长的收益,通过"卫星"资产-非沪深300指数成份股的投资力求获取超额收益。	
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持,使其更为科学和客观。	
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=80%×沪深300指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)
1.本期已实现收益	81,115,014.90
2.本期利润	13,191,785.60
3.加权平均基金份额本期利润	0.0461
4.期末基金资产净值	366,150,677.75
5.期末基金份额净值	1.4012

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	1.40%	1.82%	-4.02%	1.94%	5.42%	-0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额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

华安核心优选股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2008年10月22日至2009年9月30日)

注:1.本基金于2008年10月22日成立。截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2.根据《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》规定,本基金已自基金合同生效日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分(二)投资范围、(六)投资限制的有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
陈俏宇	本基金的基金经理	2008-10-22	-	13年	工商管理硕士,中国注册会计师协会非执业会员,13年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限公司行业部工作。2003年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、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助理,2007年3月至2008年2月担任安顺证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金的基金经理,2008年2月起担任安信证券投资基金的基金经理,2008年10月22日起同时担任本基金的基金经理。

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《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》、《华安核心优选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 公平交易专项说明

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《帐户》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《帐户》参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范,执行情况良好,未出现异常情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照华安宏利股票与华安核心股票的基金合同,华安宏利基金和华安核心都属于价值型基金,09年第三季度,华安宏利股票与华安核心股票的净值增长率分别为0.04%与1.40%。二基金的差异不大。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本季度没有出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

本报告期内沪深两市表现为先扬后抑的走势,沪深300指数9月末报收于3004.8点,单季跌幅为5.11%。年内此轮调整主要压力来自于市场对充裕流动性现象有可能发生变化的担忧,以及对上市公司盈利改善过于乐观泡沫的挤压。此期间内业绩确定性较高,或估值具相对优势的板块表现较好,其中不乏防御性行业,而前期表现较好的部分行业,如房地产、证券、银行等调整幅度相对较大。

基于对市场的判断,本基金在报告期内对股票仓位有所调整,同时在行业配置方面亦采取了相对防御的操作策略,其中核心类资产主要仍配置在具有估值相对优势的金融行业,卫星类资产则主要集中于医疗服务、食品饮料和化工等行业。虽然在两类资产中,我们采取了相同的防御策略,但实际的配置效果却差异较大,卫星类资产表现明显优于核心类资产。

本基金认为核心和卫星类资产阶段性表现的差异正反映了市场在调整初期对流动性的担忧,以及经济恢复斜率平缓后的预期修正,而未来这两重因素对市场的影响将会明显减弱。在经济复苏趋势得到确认的前提下,投资者的亢奋情绪反而有所平复,未来市场将更理性地接受与评估中观与微观数据,并做出方向性的选择。而在此之前,个股选择的意义明显提升。

基于上述判断,本基金下阶段在核心和卫星两类资产的配置中均将着眼于个股选择,其中核心类资产将更倾向于同一行业中的公司差异化分析,采取集中个股的操作策略;卫星类资产则仍坚持从经济转型入手,以寻找成长性公司为主。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	301,587,820.25	81.49
	其中:股票	301,587,820.25	81.49
2	固定收益投资	372,836.80	0.10
	其中:债券	372,836.80	0.10
	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	67,748,535.48	18.31
6	其他资产	363,005.07	0.10
7	合计	370,072,197.60	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	22,822,840.00	6.23
C	制造业	143,434,056.60	39.17
C0	食品、饮料	32,323,249.50	8.83
C1	纺织、服装、皮毛	6,936,332.10	1.89
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	23,301,255.00	6.36
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	19,581,182.20	5.35
C7	机械、设备、仪表	25,828,800.00	7.05
C8	医药、生物制品	35,463,237.80	9.69
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	7,911,000.00	2.16
F	交通运输、仓储业	6,720,000.00	1.84
G	信息技术业	17,975,090.00	4.91
H	批发和零售贸易	4,959,372.00	1.35
I	金融、保险业	62,357,910.00	17.03
J	房地产业	12,043,729.06	3.29
K	社会服务业	11,780.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	23,352,042.59	6.38
	合计	301,587,820.25	82.37

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601169	北京银行	890,000	15,334,700.00	4.19
2	600195	中牧股份	740,050	14,053,549.50	3.84
3	600196	复星医药	850,000	13,540,500.00	3.70
4	600415	小商品城	315,420	12,490,632.00	3.41
5	601666	平煤股份	459,000	12,007,440.00	3.28
6	601318	中国平安	230,300	11,676,210.00	3.19
7	601328	交通银行	1,300,000	10,829,000.00	2.96
8	600585	海螺水泥	250,000	10,757,500.00	2.94
9	600036	招商银行	700,000	10,346,000.00	2.83
10	600570	恒生电子	644,200	8,986,590.00	2.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
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	372,836.80	0.10
7	其他	-	-
8	合计	372,836.80	0.10

5.5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110006	龙盛转债	2,580	315,018.00	0.09
2	110007	博汇转债	520	57,818.80	0.02

5.6 报告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。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	46,887.05
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	117,000.00
4	应收利息	10,892.37
5	应收申购款	188,225.65
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	363,005.07

5.8.4 报告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。

5.8.5 报告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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	416,679,468.45
报告期期间基金总申购份额	59,349,972.87
报告期期间基金总赎回份额	214,719,290.61
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	261,310,150.71

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安核心优选股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安核心优选股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安核心优选股票型证券投资基金托管协议》

7.2 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。

7.3 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

二〇〇九年十月二十八日

华安强化收益债券型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年09月30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
报告送出日期:二〇〇九年十月二十八日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2009年10月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安强化收益债券	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009年4月13日	
报告期末基金份额总额	1,532,616,516.03份	
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下,通过增强信用产品的投资,以获取资产的长期增值。	
投资策略	本基金将以宏观经济、市场利率研究主导固定收益资产投资,在控制风险和保持资产流动性的前提下,获取债券市场平均收益;同时在严格的信用评估和利差分析基础上,通过投资于有一定信用风险、具有较高收益率的信用类债券,以获取超越市场平均水平的收益;此外,本基金还将通过积极的新股申购和个股精选来增强基金资产的收益。	
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%	
风险收益特征	本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种,其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金,高于货币市场基金,属于证券投资基金中的中低等风险和中低等收益品种。	
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	
下属两级基金的基金简称	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
下属两级基金的交易代码	040012	040013
报告期末下属两级基金的份额总额	746,978,544.29份	785,637,971.74份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2009年7月1日-2009年9月30日)	
	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
1.本期已实现收益	1,964,096.44	2,944,176.93
2.本期利润	-8,348,404.47	-9,750,321.88
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0114	-0.0107
4.期末基金资产净值	746,981,828.34	784,042,743.55
5.期末基金份额净值	1.000	0.998

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

1.华安强化收益债券A:

阶段	净值增长率①	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	-0.89%	0.40%	-1.21%	0.28%	0.32%	0.12%

2.华安强化收益债券B:

阶段	净值增长率①	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	-0.99%	0.40%	-1.21%	0.28%	0.22%	0.12%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

华安强化收益债券型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2009年4月13日至2009年9月30日)

1.华安强化收益债券A:

注:1.本基金于2009年4月13日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2.根据《华安强债收益债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓截止日为2009年10月13日。截至本报告期末,本基金的投资组合比例已符合基金合同第十一部分 基金的投资中投资范围、投资限制的有关约定。

2.华安强化收益债券B:

注:1.本基金于2009年4月13日成立,截止本报告期末,本基金成立不满一年。

2.根据《华安强债收益债券型证券投资基金基金合同》规定,本基金建仓截止日为2009年10月13日。截至本报告期末,本基金的投资组合比例已符合基金合同第十一部分 基金的投资中投资范围、投资限制的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
黄勤	本基金的基金经理,固定收益部负责人	2009-4-13	-	8年	经济学硕士,持有基金从业人员资格证书,12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,2007年5月起担任华安现金富利基金的基金经理,2009年4月13日起同时担任本基金的基金经理。
周丽萍	本基金的基金经理	2009-4-13	-	8年	硕士,特许金融分析师(CFA),金融风险管理师(FRM),8年证券、基金从业经历。曾在世纪证券资产管理部,研究所从事固定收益投资和研究工作。2005年8月加入华安基金管理公司,曾任研究发展部研究员,固定收益部债券投资经理,2009年4月13日起担任本基金的基金经理。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规及《华安强化收益债券型证券投资基金基金合同》、《华安强化收益债券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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度