

华安策略优选股票型证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9月30日

注:根据《华安策略优选股票型证券投资基金合同》规定,本基金已自基金合同生效之日起6个月内使基金的资产组合比例符合基金合同“第二部分:投资范围、投资策略”的有关规定。

4.1 基金经理

基金经理 魏金保 任本基金的基金经理期间 2008-2-13 至今 证券从业年限 8年 说明 经济学博士,持有基金从业资格,8年证券、基金行业从业经历。曾任平安证券有限公司,天同证券有限公司,2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员,2008年2月起担任本基金的基金经理。

5.1 报告期末基金资产组合情况

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 11,345,219,746.78 85.89 其中:股票 11,345,219,746.78 85.89 其中:债券 402,280,474.60 3.05 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:买入返售金融资产 -- -- 5 银行存款和结算备付金合计 1,448,526,334.23 10.97 6 其他资产 13,624,691.73 0.10 7 合计 13,209,651,247.34 100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 1,359,328,114.59 10.41 C 制造业 4,800,135,693.54 37.45 C0 食品、饮料 426,386,777.63 3.27 C1 纺织、服装、皮毛 52,916,430.24 0.41 C2 木材、家具 -- -- C3 造纸、印刷 10,875,000.00 0.08 C4 石油、化学、塑胶、塑料 472,406,082.55 3.62 C5 电子 -- -- C6 金属、非金属 1,206,201,679.66 9.10 C7 机械、设备、仪表 1,658,666,706.36 12.70 C8 医药、生物制品 962,083,017.10 7.37 C9 其他制造业 -- -- D 电力、煤气及水的生产和供应业 81,176,310.70 0.62 E 建筑业 314,962,962.64 2.41 F 交通运输、仓储业 -- -- G 信息技术业 -- -- H 批发和零售贸易 309,234,000.00 2.36 I 金融、保险业 -- -- J 房地产业 630,395,000.00 4.83 K 社会服务业 -- -- L 传播与文化产业 -- -- M 综合类 148,000,000.00 1.13 合计 11,345,219,746.78 86.89

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

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 601318 中国平安 13,000,000 659,100,000.00 5.05 2 601169 北京银行 28,000,000 482,440,000.00 3.69 3 600036 招商银行 28,000,000 413,840,000.00 3.17 4 601166 兴业银行 12,000,000 403,517,900.00 3.11 5 600855 海澜之家 9,413,905 400,080,312.15 3.10 6 601088 中国神华 13,000,000 394,680,000.00 3.02 7 600276 恒顺医药 8,312,343 347,622,184.26 2.66 8 600519 贵州茅台 1,847,105 304,513,730.30 2.33 9 600123 兰花科创 8,000,000 275,840,000.00 2.11 10 600016 民生银行 38,204,250 257,903,087.00 1.98

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、基金托管人及基金销售机构在本报告中披露的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。

基金概况 基金名称 华安策略优选股票 代码 041008 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2007年8月2日 报告期末基金份额总额 18,311,550,237.34份 投资目标 以追求超额收益为主,配合多种投资策略,在充分控制风险的前提下分享中国经济成长带来的投资收益,实现基金资产的长期稳定增值。

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 859,470,080.58 2.本期利润 -520,798,313.84 3.加权平均基金份额本期利润 -0.0270 4.期末基金资产净值 13,056,681,459.16 5.期末基金份额净值 0.7130

3.1 主要财务指标 3.2 基金业绩比较基准 3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益的比较 3.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 859,470,080.58 2.本期利润 -520,798,313.84 3.加权平均基金份额本期利润 -0.0270 4.期末基金资产净值 13,056,681,459.16 5.期末基金份额净值 0.7130

3.2 基金业绩比较基准 3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益的比较 3.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

3.1 主要财务指标 3.2 基金业绩比较基准 3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益的比较 3.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

3.2 基金业绩比较基准 3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益的比较 3.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

基金概况 基金名称 华安策略优选股票 代码 041008 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2007年8月2日 报告期末基金份额总额 18,311,550,237.34份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 859,470,080.58 2.本期利润 -520,798,313.84 3.加权平均基金份额本期利润 -0.0270 4.期末基金资产净值 13,056,681,459.16 5.期末基金份额净值 0.7130

3.1 主要财务指标 3.2 基金业绩比较基准 3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益的比较 3.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 859,470,080.58 2.本期利润 -520,798,313.84 3.加权平均基金份额本期利润 -0.0270 4.期末基金资产净值 13,056,681,459.16 5.期末基金份额净值 0.7130

3.2 基金业绩比较基准 3.3 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益的比较 3.4 基金业绩比较基准与同期业绩比较基准收益变动的比较

3.1 主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 859,470,080.58 2.本期利润 -520,798,313.84 3.加权平均基金份额本期利润 -0.0270 4.期末基金资产净值 13,056,681,459.16 5.期末基金份额净值 0.7130

华安宝利配置证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9月30日

基金经理 魏金保 任本基金的基金经理期间 2008-4-25 至今 证券从业年限 6年 说明 经济学博士,CFA,CPA,6年基金行业从业经历。2004年6月加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部高级研究员,2008年4月起担任华安宝利配置证券投资基金基金经理,2008年4月起担任华安策略优选股票型证券投资基金基金经理。

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 13,879,998.00 0.34 B 采掘业 243,546,857.15 6.02 C 制造业 1,160,145,895.42 28.70 C0 食品、饮料 137,125,044.28 3.39 C1 纺织、服装、皮毛 8,408,279.65 -- C2 木材、家具 -- -- C3 造纸、印刷 77,504,998.56 1.92 C4 石油、化学、塑胶、塑料 198,038,509.28 4.90 C5 电子 34,031,616.15 0.84 C6 金属、非金属 88,025,107.13 2.18 C7 机械、设备、仪表 434,925,930.32 10.76 C8 医药、生物制品 182,086,408.45 4.50 C9 其他制造业 -- -- D 电力、煤气及水的生产和供应业 6,600,000.00 0.16 E 建筑业 52,886,083.64 1.31 F 交通运输、仓储业 213,791,121.96 5.29 G 信息技术业 -- -- H 批发和零售贸易 50,825,146.82 1.26 I 金融、保险业 664,818,920.98 16.69 J 房地产业 282,513,561.92 6.99 K 社会服务业 -- -- L 传播与文化产业 -- -- M 综合类 -- -- 合计 2,822,569,044.24 69.83

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

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 600016 民生银行 30,756,150 207,296,451.00 5.13 2 600036 招商银行 12,723,138 188,047,979.64 4.65 3 601318 中国平安 3,312,546 167,946,082.20 4.15 4 600162 香港控股 13,953,685 102,699,121.60 2.54 5 600239 云铝股份 6,000,000 99,000,000.00 2.45 6 601166 兴业银行 2,900,000 97,991,000.00 2.42 7 600428 中远控股 10,516,956 97,387,012.56 2.41 8 600028 中国石化 6,500,000 96,050,000.00 2.38 9 601088 中国神华 2,600,000 78,306,000.00 1.95 10 600519 贵州茅台 450,898 74,335,044.28 1.84

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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 国债券 222,331,236.50 4.45 2 央行票据 571,635,000.00 11.45 3 金融债券 233,395,200.00 4.68 其中:政策性金融债 233,395,200.00 4.68 4 企业债券 -- -- 5 企业短期融资券 -- -- 6 可转债 -- -- 7 其他 -- -- 8 合计 1,027,361,436.50 20.58

安顺证券投资基金

2009 第三季度报告

2009年9月30日

基金经理 高洪波 任本基金的基金经理期间 2008-1-18 至今 证券从业年限 12年 说明 工商管理硕士,12年证券、基金行业从业经历。曾在上海证券有限责任公司,2001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,1999年6月至2001年9月担任华安安顺证券投资基金的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安安顺证券投资基金的基金经理,2003年9月至2009年9月担任华安安顺证券投资基金的基金经理。

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 52,271,762.40 1.05 B 采掘业 288,611,345.24 5.78 C 制造业 1,768,555,443.33 35.43 C0 食品、饮料 410,204,877.20 8.22 C1 纺织、服装、皮毛 -- -- C2 木材、家具 -- -- C3 造纸、印刷 38,092,748.16 0.76 C4 石油、化学、塑胶、塑料 245,404,181.59 4.92 C5 电子 79,853,392.96 1.60 C6 金属、非金属 219,402,976.99 4.40 C7 机械、设备、仪表 536,735,705.63 10.75 C8 医药、生物制品 238,822,160.63 4.79 C9 其他制造业 -- -- D 电力、煤气及水的生产和供应业 765,000.00 0.02 E 建筑业 37,015,338.72 0.74 F 交通运输、仓储业 1,404,500.00 0.03 G 信息技术业 73,437,599.69 1.47 H 批发和零售贸易 188,088,188.50 3.77 I 金融、保险业 904,167,176.40 18.11 J 房地产业 472,381,654.87 9.46 K 社会服务业 -- -- L 传播与文化产业 -- -- M 综合类 83,862,588.08 1.68 合计 3,890,113,207.05 77.93

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

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 600519 贵州茅台 1,500,000 247,290,000.00 4.95 2 600196 豫园股份 14,666,609 233,639,081.37 4.68 3 600036 招商银行 15,159,970 223,655,660.00 4.50 4 601318 中国平安 4,199,900 214,934,000.00 4.27 5 600855 海澜之家 4,449,933 191,480,619.99 3.84 6 600239 云铝股份 10,500,000 173,355,000.00 3.47 7 601169 北京银行 9,999,900 172,298,277.00 3.45 8 601166 兴业银行 5,000,000 168,900,000.00 3.38 9 601088 中国神华 5,199,919 157,869,540.84 3.16 10 002024 苏宁电器 9,299,800 152,423,722.00 3.05

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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 国债券 173,355,000.00 3.47 非公开发行股 2.00

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 国债券 -- -- 2 央行票据 385,506,000.00 2.95 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 16,774,474.60 0.13 7 其他 -- -- 8 合计 402,280,474.60 3.08

报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 0801047 08央票47 2,000,000 207,360,000.00 1.59 2 0901039 09央票39 500,000 49,835,000.00 0.38 3 0901041 09央票41 500,000 49,835,000.00 0.38 4 0901035 09央票35 400,000 39,668,000.00 0.31 5 0801112 08央票112 400,000 38,608,000.00 0.30

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。 报告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。 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也不存在受到公开谴责、处罚的情况。 5.8.2 本基金投资的前十名证券中,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

投资组合报告附注 单位:份 报告期末基金资产总额 19,058,546,639.15 报告期末权益类资产总额 193,619,721.78 报告期末债券类资产总额 940,616,123.59 报告期末基金资产净值 18,311,550,237.34

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。 5.9 开放式基金份额变动 单位:份 报告期末基金份额总额 19,058,546,639.15 报告期末权益类基金份额 193,619,721.78 报告期末债券类基金份额 940,616,123.59 报告期末基金资产净值 18,311,550,237.34

7.1 备查文件目录 1.《华安策略优选股票型证券投资基金合同》 2.《华安策略优选股票型证券投资基金招募说明书》 3.《华安策略优选股票型证券投资基金托管协议》 7.2 存放地点 基金管理人或基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站http://www.huainan.com.cn. 7.3 查阅方式 投资者可登录基金管理人互联网网站查询,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

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

基金概况 基金名称 华安宝利配置混合 代码 041004 基金运作方式 契约型开放式 基金合同生效日 2004年8月24日 报告期末基金份额总额 4,355,019,116.25份

主要财务指标 单位:人民币元 报告期 2009年7月1日至2009年9月30日 1.本期已实现收益 313,792,935.76 2.本期利润 -67,586,220.97 3.加权平均基金份额本期利润 -0.1363 4.期末基金资产净值 4,042,310,202.04 5.期末基金份额净值 0.9278

7.1 备查文件目录 1.《华安宝利配置证券投资基金合同》 2.《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》 3.《华安宝利配置证券投资基金托管协议》 7.2 存放地点 基金管理人或基金托管人的办公场所,并登载于基金管理人互联网网站http://www.huainan.com.cn. 7.3 查阅方式 投资者可登录基金管理人互联网网站查询,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