华安宏利股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年一月二十一日

§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2010年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安宏利股票
基金主代码	040005
前端基金主代码	040005
后端基金主代码	041005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年9月6日
报告期末基金份额总额	5,507,885,070.97份
投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益,以及分红所带来的红利收益,实现基金资产的稳定增值。
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=中信标普300指数收益率×90%+同业存款利率×10%
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。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的稳定增值。
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10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	705,140,454.97
2.本期利润	1,888,673,097.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.3491
4.期末基金资产净值	14,544,303,777.30
5.期末基金份额净值	2.6406

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	14.55%	1.45%	17.50%	1.58%	-2.95%	-0.13%

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

华安宏利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

(2006年9月6日至2009年12月31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		
尚志民	本基金的基金经理基金投资部总经理	2006-9-6	-	12年	工商管理硕士,12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月至今担任安顺证券投资基金的基金经理,2006年9月起同时担任本基金的基金经理。
陆从珍	本基金的基金经理助理	2009-5-16	-	9年	经济学硕士,9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日起担任本基金和安顺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《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》、《华安宏利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(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

按照华安宏利股票与华安核心股票的基金合同,华安宏利股票和华安核心股票都属于价值型基金,09年第四季度,华安宏利股票与华安核心股票的净值增长率分别为14.55%与18.44%,二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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

我们认为三季度的调整使市场原先过高的预期得以修正,而宏观经济向好的事实没有改变,这是支持市场的最重要因素,同时海外经济也在逐步恢复过程中,有利于中国经济进一步恢复。相比海外市场,A股的估值也不高。因此,在四季度,宏利一直保持较高仓位操作。我们判断在货币政策从超常宽松到正常化的过程中,企业盈利成长能力对股价的支持更加重要,同时,新兴产业的相关政策也将使相关行业未来发展空间得到扩展,因此宏利在期间增加了电讯服务、软件、建筑工程、地产的配置,并在相关公司大幅上涨后减少了电力设备、消费品的配置。考虑基金规模,宏利主要配置在大中盘股。这种配置特征,在上半季度表现相对较好,但后半季度由于政府对房地产的调控,加之政策紧缩的趋势加强,地产和大盘股拖累了组合的表现。

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2.6406元,报告期内,每10份基金份额派发现金红利2.3元,加上分红,本报告期份额净值增长率为14.55%,同期上证综指上涨17.91%,深圳成指上涨22.25%,中标300上涨19.42%。

§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	13,637,362,296.28	92.04
	其中:股票	13,637,362,296.28	92.04
2	固定收益投资	752,238,000.00	5.08
	其中:债券	752,238,000.00	5.08
	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	318,847,520.06	2.15
6	其他资产	107,576,517.20	0.73
7	合计	14,816,024,333.54	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	52,673,577.45	0.36
B	采掘业	1,042,303,281.39	7.17
C	制造业	4,551,033,799.07	31.29
C0	食品、饮料	962,183,223.70	6.62
C1	纺织、服装、皮毛	936,000.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	383,054,981.83	2.63
C4	石油、化学、塑胶、塑料	282,616,638.00	1.94
C5	电子	1,907,855.50	0.01
C6	金属、非金属	597,245,329.20	4.11
C7	机械、设备、仪表	1,535,649,962.50	10.56
C8	医药、生物制品	721,374,133.12	4.96
C99	其他制造业	66,065,675.22	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	121,300.00	0.00
E	建筑业	878,478,064.88	6.04
F	交通运输、仓储业	2,794,795.00	0.02
G	信息技术业	1,121,123,027.75	7.71
H	批发和零售贸易	820,488,852.36	5.64
I	金融、保险业	3,411,695,285.02	23.46
J	房地产业	721,357,342.32	4.96
K	社会服务业	379,870,362.79	2.61
L	传播与文化产业	107,718,922.80	0.74
M	综合类	547,703,685.45	3.77
	合计	13,637,362,296.28	93.76

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	601318	中国平安	14,199,000	782,222,910.00	5.38
2	600196	复星医药	36,699,906	718,217,160.42	4.94
3	601166	兴业银行	17,499,000	705,384,690.00	4.85
4	600519	贵州茅台	3,990,000	677,581,800.00	4.66
5	601398	工商银行	119,999,910	652,799,510.40	4.49
6	601088	中国神华	18,199,900	633,720,518.00	4.36
7	601668	中国建筑	132,999,929	627,759,664.88	4.32
8	002024	苏宁电器	30,000,000	623,400,000.00	4.29
9	600588	用友软件	20,475,321	566,347,378.86	3.89
10	600036	招商银行	30,999,998	559,549,963.90	3.85

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	20,458,000.00	0.14
2	央行票据	731,780,000.00	5.03
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	752,238,000.00	5.17

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	0901044	09央票44	4,500,000	442,125,000.00	3.04
2	0901049	09央票49	1,300,000	129,571,000.00	0.89
3	0701095	07央票95	700,000	70,945,000.00	0.49
4	0901055	09央票55	500,000	49,835,000.00	0.34
5	0901042	09央票42	400,000	39,304,000.00	0.27

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	204,269.22
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,134,785.42
5	应收申购款	103,237,462.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,576,517.20

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	5,154,857,355.89
报告期期间基金总申购份额	864,776,561.85
报告期期间基金总赎回份额	511,748,846.77
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	5,507,885,070.97

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安宏利股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安宏利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

二〇一〇年一月二十一日

华安创新证券投资基金

2009 第四季度报告

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:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年一月二十一日

§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2010年1月18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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安创新混合
基金主代码	040001
前端基金主代码	040001
后端基金主代码	041001
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	10,860,249,471.07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10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	240,172,120.90
2.本期利润	1,084,957,796.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0981
4.期末基金资产净值	8,463,989,977.86
5.期末基金份额净值	0.779

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	14.06%	1.34%	14.70%	1.31%	-0.64%	0.03%

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12月31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。

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(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、基金安信封闭。09年第四季度,三基金净值增长率分别为:华安中小盘成长股票17.45%、华安创新混合14.06%、华安安信封闭14.99%,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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场在三季度经历了相对较大的幅度调整以后,考虑到经济复苏的前景比较明朗,市场估值水平并不算高,本基金判断市场将出现结构性震荡上行的局面,因此在报告期内保持较高的股票配置比例。在配置方向上,主要围绕通胀预期和国家消费刺激政策为主线进行布局,并考虑个股的估值水平和资源特征,组合结构除了以金融类股票作为基本配置外,其他主要配置在房地产、汽车、家电、医药、有色金属、信息技术等行业。在风格特征方面,考虑到基金规模,以大中型股票为主。这种配置特征,在前半季度效果较好,但后半季度由于房地产政策的变化和大盘股的疲弱表现,效果很一般。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2009年12月31日,本基金单位净值为0.779元,本报告期份额净值增长率为14.06%,同期上证综指上涨17.91%,深圳成指上涨22.25%,中标300上涨19.42%。

§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	6,304,166,885.23	74.04
	其中:股票	6,304,166,885.23	74.04
2	固定收益投资	1,769,445,206.10	20.78
	其中:债券	1,769,445,206.10	20.78
	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	405,961,623.13	4.77
6	其他资产	35,328,976.11	0.41
7	合计	8,514,902,690.57	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	35,613,980.22	0.42
B	采掘业	548,412,871.70	6.48
C	制造业	2,583,757,446.30	30.53
C0	食品、饮料	51,023,200.96	0.60
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	329,052,000.00	3.89
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	719,246,773.28	8.50
C7	机械、设备、仪表	954,871,482.46	11.28
C8	医药、生物制品	529,563,989.60	6.26
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	214,710,000.00	2.54
E	建筑业	85,036,020.00	1.00
F	交通运输、仓储业	90,350,000.00	1.07
G	信息技术业	376,947,176.88	4.45
H	批发和零售贸易	218,252,312.00	2.58
I	金融、保险业	1,455,502,743.76	17.20
J	房地产业	442,735,029.00	5.23
K	社会服务业	186,767,609.61	2.21
L	传播与文化产业	66,081,695.76	0.78
M	综合类	-	-
	合计	6,304,166,885.23	74.48

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	20,000,000	433,800,000.00	5.13
2	000651	格力电器	10,500,000	303,870,000.00	3.59
3	601169	北京银行	12,000,000	232,080,000.00	2.74
4	601318	中国平安	4,200,000	231,378,000.00	2.73
5	600585	海螺水泥	4,516,498	225,192,590.28	2.66
6	002022	科华生物	10,000,000	218,900,000.00	2.59
7	600649	城投控股	17,000,000	214,710,000.00	2.54
8	600675	中华企业	13,500,000	198,990,000.00	2.35
9	601088	中国神华	5,500,000	191,510,000.00	2.26
10	600030	中信证券	6,000,000	190,620,000.00	2.25

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	86,561,206.10	1.02
2	央行票据	1,060,357,000.00	12.53
3	金融债券	622,527,000.00	7.36
	其中:政策性金融债	622,527,000.00	7.36
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,769,445,206.10	20.91

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	0801005	08央票05	3,000,000	307,560,000.00	3.63
2	0901055	09央票55	3,000,000	299,010,000.00	3.53
3	0901042	09央票42	1,300,000	127,738,000.00	1.51
4	070227	07国开27	1,200,000	126,972,000.00	1.50
5	090218	09国开18	1,200,000	119,988,000.00	1.42

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	4,619,397.83
2	应收证券清算款	2,447,505.38
3	应收股利	-
4	应收利息	27,894,951.51
5	应收申购款	367,121.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,328,976.11

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	11,250,954,296.64
报告期期间基金总申购份额	54,774,921.21
报告期期间基金总赎回份额	445,479,746.78
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	10,860,249,471.07

§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

二〇一〇年一月二十一日

华安核心优选股票型证券投资基金

2009 第四季度报告

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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年一月二十一日

§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2010年1月15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10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	华安核心股票
基金主代码	040011
前端基金主代码	040011
后端基金主代码	041011
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	315,934,646.58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10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	26,664,444.16
2.本期利润	66,261,979.66
3.加权平均基金份额本期利润	0.2506
4.期末基金资产净值	524,323,484.51
5.期末基金份额净值	1.6596

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	18.44%	1.42%	15.31%	1.41%	3.13%	0.01%

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12月31日)

注:1、本基金于2008年10月22日成立。截止本报告期末,本基金距建仓结束不满一年。

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。

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(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

按照华安宏利股票与华安核心股票的基金合同,华安宏利股票和华安核心股票都属于价值型基金,09年第四季度,华安宏利股票与华安核心股票的净值增长率分别为14.55%与18.44%,二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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场经过三季度的调整,投资者预期经修正后回归理性。本基金判断市场由此将进入上行期,但受制于估值困惑将伴随着宽幅震荡,因此报告期内股票仓位相对灵活。基于对流动性预期发生转变的判断,本基金认为风格转换的时机尚未成熟。相反,哥本哈根会议的无果暗示了经济转型的压力,近期政府的各项政策也指明了转型的方向和决心,因此本基金暂时仍将配置重点放在受益于经济转型的行业或公司,主要包括增长性确定的医药企业,产业整合存必要性的,以军工为代表的先进制造业,以及受益于城镇化的二三线地产股等。报告期末,适当增加了金融行业的配置比例。

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1.6596元,本报告期份额净值增长率为18.44%,同期业绩比较基准增长率为15.31%。

§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	463,885,122.23	82.63
	其中:股票	463,885,122.23	82.63
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	42,448,541.12	7.56
6	其他资产	55,043,522.67	9.81
7	合计	561,377,186.02	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	27,222,500.00	5.19
C	制造业	209,724,115.85	40.00
C0	食品、饮料	12,448,450.00	2.37
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,177,800.00	3.09
C4	石油、化学、塑胶、塑料	20,297,100.00	3.87
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	38,120,030.80	7.27
C7	机械、设备、仪表	61,553,094.85	11.74
C8	医药、生物制品	61,127,640.20	11.66
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,904,000.00	1.13
E	建筑业	15,473,600.00	2.95
F	交通运输、仓储业	8,690,000.00	1.66
G	信息技术业	60,573,378.20	11.55
H	批发和零售贸易	15,256,182.34	2.91
I	金融、保险业	101,508,750.00	19.36
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	76,020.00	0.01
L	传播与文化产业	4,847,400.00	0.92
M	综合类	14,609,175.84	2.79
	合计	463,885,122.23	88.47

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	1,200,000	23,208,000.00	4.43
2	601318	中国平安	405,000	22,311,450.00	4.26
3	600036	招商银行	1,180,000	21,299,000.00	4.06
4	600316	洪都航空	508,675	16,943,964.25	3.23
5	600570	恒生电子	800,800	16,824,808.00	3.21
6	600196	复星医药	850,000	16,634,500.00	3.17
7	000718	苏宁环球	1,180,000	16,177,800.00	3.09
8	000651	格力电器	551,340	15,955,779.60	3.04
9	601666	平煤股份	459,000	14,688,000.00	2.80
10	600415	小商品城	326,608	14,609,175.84	2.79

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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	32,319.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,672.88
5	应收申购款	55,002,529.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	55,043,522.67

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	261,310,150.71
报告期期间基金总申购份额	91,840,095.83
报告期期间基金总赎回份额	37,215,599.96
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	315,934,646.58

§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

二〇一〇年一月二十一日