华安策略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: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	华安策略优选股票
基金主代码	040008
前端基金主代码	040008
后端基金主代码	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	17,627,212,320.55份
投资目标	以优选股票为主,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收益,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	① 资产配置策略 本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,并利用公司研究开发的数量模型工具,分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征,确定合适的资产配置比例。 ② 股票投资策略 本基金的股票投资策略将采用“自下而上”和“自上而下”相结合的方法,通过综合运用多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票。在构建投资组合时主要以“自下而上”的优选成长策略为主,辅以“自上而下”的主题优选策略、逆势操作策略,优选具有良好投资潜力的个股,力求基金资产的中长期稳定增值。 ③ 债券投资策略 本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。 ④ 权证、资产支持证券和其他衍生工具投资策略。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数收益率+20%×中信标普国债指数收益率
风险收益特征	本基金是股票型基金,属于证券投资基金中的较高预期风险和较高预期收益品种,其预期风险收益水平高于混合型基金、债券基金和货币市场基金。
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	374,310,495.51
2.本期利润	2,132,510,035.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.1186
4.期末基金资产净值	14,627,669,405.86
5.期末基金份额净值	0.8298

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	16.38%	1.59%	14.16%	1.40%	2.22%	0.19%

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

华安策略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
(2007年8月2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		
张伟	本基金的基金经理	2008-2-13	-	8年	经济学硕士,持有基金从业资格证书,8年证券、基金行业从业经历。曾在平安证券有限公司、天同证券有限公司任职,2004年6月加入华安基金管理公司,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。
邓跃辉	本基金的基金经理	2008-2-13	-	6年	经济学硕士,CFA,CPA,6年基金行业从业经历。2003年4月加入华安基金管理公司,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,2008年4月起同时担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理。

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《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》、《华安策略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

按照华安优选股票和华安安顺封闭的基金合同,华安优选和华安安顺封闭都是混合型股票基金。09年第四季度,华安优选股票净值增长率为16.38%,华安安顺封闭的值增长率为16.56%,二者基金的业绩增长率相当。

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

在经历了三季度的深幅调整后,四季度A股市场维持了震荡上行的走势。尽管指数涨幅不大,没有突破8月初的高点,但是行业和风格方面的分化日趋加大。除了金融地产钢铁有色煤炭石化等六个行业外,其他大部分行业和股票都已达到4000点以上,甚至更高。投资者对国内外宽松货币政策退出的预期越来越强烈,压制了这些大行业及市场整体的表现。

本基金认为在经济向好的趋势下,市场风格将转到这些对经济比较敏感,估值低的大行业。随着国外经济的复苏,将继中国之后成为支撑上游资源品的最大因素,我们增持了煤炭有色石化等上游行业,此外,考虑到政府在调结构方面的决心,我们增持了医药、汽车等消费类行业。

不过,我们看到在12月份政府表明了遏制房价上涨的态度,房地产股票应声大跌。这是否会影响到相关行业及整个市场的运行,我们将密切关注。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

四季度本基金净值上涨16.38%。

§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	13,523,688,723.72	91.70
	其中:股票	13,523,688,723.72	91.70
2	固定收益投资	477,694,000.00	3.24
	其中:债券	477,694,000.00	3.24
	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	675,123,312.19	4.58
6	其他资产	71,484,255.11	0.48
7	合计	14,747,990,291.02	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	7,975,733.93	0.05
B	采掘业	2,115,334,571.29	14.46
C	制造业	5,787,965,532.38	39.57
C0	食品、饮料	510,197,106.54	3.49
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	130,798,911.69	0.89
C4	石油、化学、塑胶、塑料	581,195,000.00	3.97
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	1,774,401,241.19	12.13
C7	机械、设备、仪表	1,646,855,388.59	11.26
C8	医药、生物制品	1,144,517,884.37	7.82
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	511,017,726.45	3.49
F	交通运输、仓储业	10,550,000.00	0.07
G	信息技术业	377,041,440.00	2.58
H	批发和零售贸易	531,997,838.85	3.64
I	金融、保险业	3,265,202,278.90	22.32
J	房地产业	485,558,000.00	3.32
K	社会服务业	164,535,000.00	1.12
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	266,510,601.92	1.82
	合计	13,523,688,723.72	92.45

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	17,000,000	936,530,000.00	6.40
2	601169	北京银行	32,328,688	625,236,825.92	4.27
3	601166	兴业银行	13,580,759	547,440,395.29	3.74
4	600036	招商银行	30,000,000	541,500,000.00	3.70
5	600276	恒瑞医药	8,893,406	466,903,815.00	3.19
6	600519	贵州茅台	2,701,842	458,826,808.44	3.14
7	600585	海螺水泥	9,140,804	455,760,487.44	3.12
8	600028	中国石化	27,004,007	380,486,458.63	2.60
9	000898	鞍钢股份	21,800,120	348,801,920.00	2.38
10	601088	中国神华	10,000,000	348,200,000.00	2.38

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	236,398,000.00	1.62
3	金融债券	241,296,000.00	1.65
	其中:政策性金融债	241,296,000.00	1.65
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	477,694,000.00	3.27

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	050413	05农发13	2,400,000	241,296,000.00	1.65
2	0901038	09央票38	1,000,000	98,280,000.00	0.67
3	0901044	09央票44	1,000,000	98,250,000.00	0.67
4	0901049	09央票49	400,000	39,868,000.00	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	6,219,157.91
2	应收证券清算款	61,703,822.63
3	应收股利	-
4	应收利息	2,896,544.87
5	应收申购款	664,729.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,484,255.11

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	18,311,550,237.34
报告期期间基金总申购份额	101,525,637.01
报告期期间基金总赎回份额	785,863,553.80
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	17,627,212,320.55

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1、《华安策略优选股票型证券投资基金基金合同》
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

华安宝利配置证券投资基金

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	华安宝利配置混合
基金主代码	040004
前端基金主代码	040004
后端基金主代码	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	4,331,460,220.77份
投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会,灵活配置资产,并充分提高基金资产的使用效率,在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析,采用积极的投资组合策略,保留可控制的风险,规避或降低无法控制的风险,发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	35%×天相转债指数收益率+30%×天相280指数收益率+30%×天相国债全价指数收益率+5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等),但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为:利率风险、政策风险、经济周期风险、信用风险、再投资风险、上市公司经营风险、新产品创新带来的风险、购买力风险、流动性风险、现金管理风险、技术风险、管理风险、巨额赎回风险等。
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	426,870,251.03
2.本期利润	760,950,071.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.1749
4.期末基金资产净值	4,771,627,751.49
5.期末基金份额净值	1.102

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	18.75%	1.30%	9.50%	0.75%	9.25%	0.55%

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

华安宝利配置证券投资基金
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
(2004年8月24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		
邓跃辉	本基金的基金经理	2008-4-25	-	6年	经济学硕士,CFA,CPA,6年基金行业从业经历。2003年4月加入华安基金管理公司,曾任研究发展部高级研究员,2008年2月起担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理,2008年4月起同时任本基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理	2008-10-11	-	15年	经济学硕士,15年证券、基金行业从业经历。历任安徽省国际信托投资公司投资银行部业务主办、股票自营部投资经理;华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员;亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长;华富基金管理公司资深研究员、投研部副总监等职。2006年6月21日至2007年10月27日任华富货币市场基金基金经理,2007年5月12日至2008年5月17日同时任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。2008年6月重新加入华安基金管理公司,并于2008年10月11日任本基金的基金经理,2009年6月25日起同时担任华安中小盘成长股票基金的基金经理。

注:1.此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。
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《华安宝利配置型证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置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

按照华安宝利配置混合的基金合同,华安宝利配置混合属于配置型基金,其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前,华安旗下基金没有与本基金风格相同的基金。

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

2009年四季度,全球刺激政策仍在继续,经济复苏步伐稳健,海外股市屡创新高,对中国而言,经济基本面强劲,宏观数据日益靓丽,A股经过三季度的调整,投资价值逐步显现,我们对四季度行情较为乐观。

国庆节后,本基金果断加仓并一直维持较高仓位运作,在10月底短短高点做了一次较大幅度减仓,随后在调整的底部果断加回,从波段操作上看比较成功;报告期内,本基金加大了汽车、软件及零售板块的配置力度,对银行继续低配并不断减持,获得了一定的超额收益,当然,对有色和化工行业减持至低配也没有分享到这些板块上涨带来的超额收益。

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1.102,本报告期净值增长率18.75%,同期业绩比较基准收益率为9.50%。

§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	3,675,690,304.48	73.97
	其中:股票	3,675,690,304.48	73.97
2	固定收益投资	851,074,473.67	17.13
	其中:债券	851,074,473.67	17.13
	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	397,772,373.11	8.00
6	其他资产	44,592,556.97	0.90
7	合计	4,969,129,708.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	195,229,203.75	4.09
B	采掘业	358,795,148.14	7.52
C	制造业	1,404,691,063.35	29.44
C0	食品、饮料	206,024,449.32	4.32
C1	纺织、服装、皮毛	68,569,490.84	1.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	128,707,326.61	2.70
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,879,598.83	0.04
C5	电子	2,169,417.50	0.05
C6	金属、非金属	409,946,802.33	8.59
C7	机械、设备、仪表	395,944,241.24	8.30
C8	医药、生物制品	191,449,736.68	4.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	69,385,610.78	1.45
E	建筑业	75,596,020.00	1.58
F	交通运输、仓储业	143,325,808.80	3.00
G	信息技术业	183,457,671.70	3.84
H	批发和零售贸易	99,781,180.24	2.09
I	金融、保险业	836,766,634.24	17.54
J	房地产业	246,938,164.52	5.18
K	社会服务业	28,579,263.15	0.60
L	传播与文化产业	3,074,535.81	0.06
M	综合类	30,070,000.00	0.63
	合计	3,675,690,304.48	77.03

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	601788	光大证券	8,515,209	217,308,133.68	4.55
2	600598	北大荒	12,801,915	195,229,203.75	4.09
3	601318	中国平安	2,820,000	155,353,800.00	3.26
4	600036	招商银行	8,600,000	155,230,000.00	3.25
5	600028	中国石化	10,500,078	147,946,099.02	3.10
6	600585	海螺水泥	2,951,453	147,159,446.58	3.08
7	600239	云南城投	6,000,000	136,740,000.00	2.87
8	600519	贵州茅台	770,000	130,761,400.00	2.74
9	002022	科华生物	5,741,216	125,675,218.24	2.63
10	601166	兴业银行	2,483,880	100,125,202.80	2.10

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	69,796,537.50	1.46
2	央行票据	208,935,000.00	4.38
3	金融债券	110,700,000.00	2.32
	其中:政策性金融债	110,700,000.00	2.32
4	企业债券	229,188,344.30	4.80
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	232,454,591.87	4.87
7	其他	-	-
8	合计	851,074,473.67	17.84

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	0901036	09央票36	1,000,000	98,290,000.00	2.06
2	126002	06中化债	560,000	51,497,600.00	1.08
3	0801005	08央票05	500,000	51,260,000.00	1.07
4	060202	06国开02	500,000	50,055,000.00	1.05
5	110003	新钢转债	350,000	48,153,000.00	1.01

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	4,713,203.60
2	应收证券清算款	30,003,619.69
3	应收股利	-
4	应收利息	8,177,822.52
5	应收申购款	1,697,911.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,592,556.97

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110003	新钢转债	48,153,000.00	1.01
2	110598	大荒转债	39,353,268.80	0.82
3	125709	唐钢转债	22,219,194.69	0.47
4	125960	锡业转债	21,051,800.00	0.44
5	110567	山鹰转债	9,819,600.00	0.21
6	110078	澄星转债	3,067,414.70	0.06

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600239	云南城投	136,740,000.00	2.87	非公开发行股票

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	4,355,019,116.25
报告期期间基金总申购份额	385,106,100.12
报告期期间基金总赎回份额	408,664,995.60
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	4,331,460,220.77

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录
1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
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

安信证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。

基金托管人中国工商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	华安安信封闭
基金主代码	500003
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998年6月22日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
投资目标	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险,确保基金资产的安全,并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金为成长型基金,本基金的证券资产将不低于基金资产总额的80%,其中投资于国债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45-80%.现金比例根据运作情况调整。在股票资产中,70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。 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增长率的上市公司股票。
业绩比较基准	无
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	中国工商银行股份有限公司

§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	213,387,571.76
2.本期利润	436,789,323.75
3.加权平均基金份额本期利润	0.2184
4.期末基金资产净值	3,350,474,473.65
5.期末基金份额净值	1.6752

注: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	14.99%	2.94%	-	-	-	-

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

安信证券投资基金
累计净值增长率历史走势图
(1998年6月22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		
陈倩宇	本基金的基金经理	2008-2-13	-	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、华安宏利基金经理,2008年2月起担任本基金的基金经理,2008年10月22日起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。

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 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《安信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 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