# 华安中小盘成长股票型证券投资基金

## 2010 第一季度报告

2010年3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:二〇一〇年四月二十日**

### §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4月12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2010年1月1日起至3月31日止。

### §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 华安中小盘成长股票 |
| 基金主代码 | 040007 |
| 前端交易代码 | 040007 |
| 后端交易代码 | 041007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2007年4月10日 |
| 报告期末基金份额总额 | 8,905,890,494.57份 |
| 投资目标 | 主要投资于具有持续成长潜力的中小盘股票,在严格控制投资风险的前提下,实现基金资产的持续增值。 |
| 投资策略 | 主要依靠基金管理人的研究优势,将科学有效的选股方法与主动、灵活的投资操作风格贯穿于组合构建以及组合风险管理的全过程之中,在分析研判经济运行和行业景气变化的周期性,以及上市公司业绩成长性的基础上,积极把握备选股票的投资机会,为基金份额持有人获取较高的中长期资本增值。 |
| 业绩比较基准 | 40%×天相中盘成长指数+40%×天相小盘成长指数+20%×中债-国债总指数 |
| 风险收益特征 | 本基金是积极成长型股票基金,属于证券投资基金中的较高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 | 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(2010年1月1日-2010年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 200,341,934.71 |
| 2.本期利润 | -536,459,402.78 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0590 |
| 4.期末基金资产净值 | 10,494,395,414.28 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1784 |

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 | -4.71% | 1.07% | 0.94% | 1.08% | -5.65% | -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

华安中小盘成长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4月10日至2010年3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 | | |
| 沈雪峰 | 本基金的基金经理 | 2009-6-25 | - | 16年 | 经济学硕士,16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日起担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理,2009年6月25日起同时担任本基金的基金经理。 |

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 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《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》、《华安中小盘成长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",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,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 本报告期内基金投资策略和运作分析

一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

一季度,由于宏观调控提前到来和调控力度的超出预期,我们去年四季度预期的跨年度行情没有出现,本基金在季度初保持了较高仓位,期间虽有调整,但一季度仓位总体负责任。本基金在行业配置方面较为成功,仍然取得了正向超额贡献,主要表现在超配生物制药、技术硬件和设备,同时低配能源、金融等行业。我们超配的汽车及零配件表现不佳,同时也没有分享到交通运输行业上涨的贡献。

从组合结构分析,一季度配置的前十大股票组合中传统行业居多,且多数股票在2009年四季度有出色表现,今年一季度出现调整仍属合理,比如云南白药、恒瑞医药、西山煤电等等。对于我们从中长线角度选择的优质公司,我们相信其在未来将有更持续的表现。我们一季度也对新兴战略产业进行积极配置,但其整体市值在组合的占比较低,短期还尚未对组合业绩作出更大贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年3月31日,本基金份额净值为1.1784元,本报告期净值增长率-4.71%,同期业绩比较基准收益率为0.94%。

### §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 | 9,379,446,205.69 | 88.92 |
| | 其中:股票 | 9,379,446,205.69 | 88.92 |
| 2 | 固定收益投资 | 302,246,000.00 | 2.87 |
| | 其中:债券 | 302,246,000.00 | 2.87 |
| | 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 | 683,903,848.07 | 6.48 |
| 6 | 其他资产 | 182,570,053.35 | 1.73 |
| 7 | 合计 | 10,548,166,107.11 | 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 | 168,521,244.25 | 1.61 |
| B | 采掘业 | 685,818,027.84 | 6.54 |
| C | 制造业 | 4,901,347,820.87 | 46.70 |
| C0 | 食品、饮料 | 637,692,214.36 | 6.08 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 34,073,553.00 | 0.32 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 3,414,826.76 | 0.03 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 369,671,909.62 | 3.52 |
| C5 | 电子 | 316,401,338.92 | 3.01 |
| C6 | 金属、非金属 | 576,784,810.44 | 5.50 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,595,094,124.91 | 15.20 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,365,160,369.16 | 13.01 |
| C99 | 其他制造业 | 3,054,673.70 | 0.03 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 94,643,585.98 | 0.90 |
| G | 信息技术业 | 784,160,582.72 | 7.47 |
| H | 批发和零售贸易 | 395,362,859.20 | 3.77 |
| I | 金融、保险业 | 1,366,396,818.66 | 13.02 |
| J | 房地产业 | 542,730,595.64 | 5.17 |
| K | 社会服务业 | 63,570,000.00 | 0.61 |
| L | 传播与文化产业 | 63,970,926.91 | 0.61 |
| M | 综合类 | 312,923,743.62 | 2.98 |
| | 合计 | 9,379,446,205.69 | 89.38 |

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 | 601166 | 兴业银行 | 17,068,904 | 630,183,935.68 | 6.00 |
| 2 | 000983 | 西山煤电 | 11,024,448 | 389,163,014.40 | 3.71 |
| 3 | 002022 | 科华生物 | 14,000,000 | 345,800,000.00 | 3.30 |
| 4 | 000538 | 云南白药 | 5,656,093 | 312,442,577.32 | 2.98 |
| 5 | 600276 | 恒瑞医药 | 7,490,000 | 293,682,900.00 | 2.80 |
| 6 | 600519 | 贵州茅台 | 1,834,113 | 291,183,779.88 | 2.77 |
| 7 | 000895 | 双汇发展 | 5,450,000 | 275,116,000.00 | 2.62 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 5,933,782 | 262,035,813.12 | 2.50 |
| 9 | 000527 | 美的电器 | 11,300,752 | 253,588,874.88 | 2.42 |
| 10 | 600325 | 华发股份 | 14,005,787 | 233,616,527.16 | 2.23 |

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 | 302,246,000.00 | 2.88 |
| 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 | 302,246,000.00 | 2.88 |

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 | 0801017 | 08央票17 | 1,000,000 | 102,280,000.00 | 0.97 |
| 2 | 0901028 | 09央票28 | 1,000,000 | 98,440,000.00 | 0.94 |
| 3 | 0801020 | 08央票20 | 800,000 | 81,856,000.00 | 0.78 |
| 4 | 0901038 | 09央票38 | 200,000 | 19,670,000.00 | 0.19 |

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

截止本报告期末,本基金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

截止本报告期末,本基金未持有权证。

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,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 本基金投资的前十名股票中,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 | 6,814,296.53 |
| 2 | 应收证券清算款 | 171,735,580.95 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,479,197.06 |
| 5 | 应收申购款 | 1,540,978.81 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 182,570,053.35 |

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截止本报告期末,本基金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

前十名股票无流通受限情况。

### §6 开放式基金份额变动

单位:份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 9,219,215,856.49 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 105,585,263.09 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 418,910,625.01 |
| 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 | 8,905,890,494.57 |

### §7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安中小盘成长股票型证券投资基金基金合同》

2、《华安中小盘成长股票型证券投资基金招募说明书》

3、《华安中小盘成长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**
**二〇一〇年四月二十日**

# 华安策略优选股票型证券投资基金

## 2010 第一季度报告

2010年3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:二〇一〇年四月二十日**

### §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4月19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2010年1月1日起至3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 |
| 前端交易代码 | 040008 |
| 后端交易代码 | 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 | 17,211,986,971.47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<br>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。<br>② 股票投资策略<br>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。<br>③ 债券投资策略<br>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。<br>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(2010年1月1日-2010年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 277,611,239.74 |
| 2.本期利润 | -1,000,914,747.23 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0575 |
| 4.期末基金资产净值 | 13,305,828,379.89 |
| 5.期末基金份额净值 | 0.7731 |

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 | -6.83% | 1.17% | -3.92% | 1.04% | -2.91% | 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2010年3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 | - | 9年 | 经济学硕士,持有基金从业资格证书,9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 | 2010-3-19 | 7年 | 经济学硕士,CFA,CPA,7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月至2010年3月担任本基金的基金经理,2008年4月至2010年3月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",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,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

按照华安策略优选股票和华安安顺封闭的基金合同,华安策略优选股票和华安安顺封闭都是混合型股票基金。2010年第一季度,华安策略优选股票净值增长率为-6.83%,华安安顺封闭的净值增长率为-2.47%,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

鉴于经济基本面不可能在短时间内给出明确的信号,短期内政策面和资金面成为左右市场的主要因素,但从较长视野看,经济复苏是大概率事件,仅仅是何时复苏的问题,因此,市场不具备深幅调整的基础。行业配置方面,我们认为无论从防守的角度还是进攻的角度,以煤炭和银行为代表的价值类股票都已经积聚了相当的优势。另外,"低碳环保"、"消费升级"、"资产重组"等相关领域也存在好的投资标的。鉴于创业板及其他中小企业估值过高,而区域概念中大多缺乏业绩支撑,本基金对其持谨慎态度。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年3月31日,本基金份额净值为0.7731元,本报告期份额净值增长率为-6.83%,同期业绩比较基准增长率为-3.92%。

### §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 | 11,371,434,134.37 | 85.16 |
| | 其中:股票 | 11,371,434,134.37 | 85.16 |
| 2 | 固定收益投资 | 437,866,000.00 | 3.28 |
| | 其中:债券 | 437,866,000.00 | 3.28 |
| | 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 | 1,532,162,351.98 | 11.47 |
| 6 | 其他资产 | 10,804,559.84 | 0.08 |
| 7 | 合计 | 13,352,267,046.19 | 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 | 5,680,000.00 | 0.04 |
| B | 采掘业 | 1,309,746,882.35 | 9.84 |
| C | 制造业 | 5,144,705,943.03 | 38.67 |
| C0 | 食品、饮料 | 776,755,045.36 | 5.84 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 10,766,819.70 | 0.08 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 72,536,362.44 | 0.55 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 566,105,784.00 | 4.25 |
| C5 | 电子 | 6,215,000.00 | 0.05 |
| C6 | 金属、非金属 | 1,008,114,606.20 | 7.58 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,583,562,891.26 | 11.90 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,120,649,434.07 | 8.42 |
| C99 | 其他制造业 | - | - |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 13,578,153.12 | 0.10 |
| E | 建筑业 | 519,538,887.36 | 3.90 |
| F | 交通运输、仓储业 | 183,253,405.00 | 1.38 |
| G | 信息技术业 | 427,235,433.01 | 3.21 |
| H | 批发和零售贸易 | 452,961,447.52 | 3.40 |
| I | 金融、保险业 | 2,519,894,819.26 | 18.94 |
| J | 房地产业 | 492,743,815.00 | 3.70 |
| K | 社会服务业 | 216,527,988.66 | 1.63 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 85,567,360.06 | 0.64 |
| | 合计 | 11,371,434,134.37 | 85.46 |

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 | 600036 | 招商银行 | 39,360,000 | 640,780,800.00 | 4.82 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 4,007,871 | 636,289,599.96 | 4.78 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 12,000,000 | 604,800,000.00 | 4.55 |
| 4 | 601169 | 北京银行 | 30,000,000 | 501,600,000.00 | 3.77 |
| 5 | 601166 | 兴业银行 | 13,580,759 | 501,401,622.28 | 3.77 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 11,129,907 | 436,403,653.47 | 3.28 |
| 7 | 002024 | 苏宁电器 | 17,000,000 | 319,430,000.00 | 2.40 |
| 8 | 600585 | 海螺水泥 | 6,800,000 | 300,288,000.00 | 2.26 |
| 9 | 600123 | 兰花科创 | 7,000,000 | 281,120,000.00 | 2.11 |
| 10 | 600970 | 中材国际 | 6,726,216 | 241,874,727.36 | 1.82 |

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 | 196,690,000.00 | 1.48 |
| 3 | 金融债券 | 241,176,000.00 | 1.81 |
| | 其中:政策性金融债 | 241,176,000.00 | 1.81 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 437,866,000.00 | 3.29 |

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 | 241,176,000.00 | 1.81 |
| 2 | 0901038 | 09央票38 | 1,000,000 | 98,350,000.00 | 0.74 |
| 3 | 0901044 | 09央票44 | 1,000,000 | 98,340,000.00 | 0.74 |

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,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 本基金投资的前十名股票中,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 | 4,287,025.05 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,584,489.35 |
| 5 | 应收申购款 | 933,045.44 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 10,804,559.84 |

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 | 17,627,212,320.55 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 55,315,700.09 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 470,541,049.17 |
| 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 | 17,211,986,971.47 |

### §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**
**二〇一〇年四月二十日**

# 安信证券投资基金

## 2010 第一季度报告

2010年3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:二〇一〇年四月二十日**

### §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4月12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2010年1月1日起至3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(2010年1月1日-2010年3月31日) |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 78,301,220.81 |
| 2.本期利润 | -32,586,648.94 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.0163 |
| 4.期末基金资产净值 | 3,317,887,824.71 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.6589 |

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 | -0.97% | 2.13% | - | - | - | - |

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

安信证券投资基金
累计份额净值增长率历史走势图
(1998年6月22日至2010年3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 | | |
| 陈俏宇 | 本基金的基金经理 | 2008-2-13 | - | 14年 | 工商管理硕士,中国注册会计师协会非执业会员,14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",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,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。2010年第一季度,三基金净值增长率分别为:华安中小盘成长股票-4.71%、华安创新混合-3.26%、华安安信封闭-0.97%,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

一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

进入2010年,政策上我们看到的是更为确定的经济转型方向,尽管我们疑惑部分政策的实效,但是我们从没有怀疑过转变经济增长模式的必要性。整体经济正走在平稳复苏的过程中,但来自于全球重建竞争格局的潜在压力更大,因此转型的紧迫性反而有所加强。股指期货作为完善市场交易机制的一部分,不会简单的给某部分行业或公司带来长期的估值溢价,我们相信溢价来自于其中的部分稳定增长型公司。同时,我们也乐于将溢价给予新兴产业中具备相对清晰竞争格局和核心竞争力的持续增长型公司,以及在战略性行业中具有外延式增长机会的公司。基于上述的理解,本基金在报告期内除保留了金融保险行业的配置外,强化了医药、信息技术和军工等行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年3月31日,本基金份额净值为1.6589元,本报告期份额净值增长率为-0.97%,同期上证综指下跌5.13%,深圳成指下跌8.80%。

### §5 投资组合报告

5.1 报告期末基金