华安创新证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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:二〇一〇年十月二十七日

§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10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
基金主代码	040001
前端交易代码	040001
后端交易代码	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	10,325,494,772.02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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	149,269,901.77
2.本期利润	1,097,549,137.40
3.加权平均基金份额本期利润	0.1036
4.期末基金资产净值	7,573,451,829.05
5.期末基金份额净值	0.733

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	16.35%	1.01%	11.37%	0.98%	4.98%	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2010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	-	8年	管理学博士,持有基金从业资格证书,8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",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年第三季度,三基金净值增长率分别为:华安中小盘成长股票16.64%、华安创新混合16.35%、华安安信封闭16.33%,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

第三季度,A股市场在对下半年经济的悲观预期下完成了筑底的过程。而在宏观调控和经济转型压力加大的背景下,市场也表现出明显的结构性特征,新经济和传统行业、中小市值和大市值股票的表现差异很大。但是,随着行情的发展,中小市值股票的高估值与成长性之间匹配的矛盾越来越突出,估值风险逐步积聚;此外海外经济的复苏缓慢使得主要经济体继续实行宽松货币政策的预期加强,短期对资源和资产价格有较大的刺激,周期性行业有较强的反弹动能。

本报告期内,本基金对继续对战略新兴产业、医药、消费等板块进行重点配置。对于受益流动性宽松的上游资源品行业进行了重点增持。同时也增加低估值的汽车,工程机械等行业的配置。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年9月30日,本基金份额净值为0.733元,本报告期份额净值增长率为16.35%,同期业绩比较基准增长率为11.37%。

§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	5,428,714,461.87	71.31
	其中:股票	5,428,714,461.87	71.31
2	固定收益投资	1,742,340,372.40	22.89
	其中:债券	1,742,340,372.40	22.89
	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	397,442,240.21	5.22
6	其他各项资产	44,597,531.28	0.59
7	合计	7,613,094,605.76	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	137,280,914.91	1.81
B	采掘业	256,643,302.00	3.39
C	制造业	3,025,924,432.00	39.95
C0	食品、饮料	122,762,808.35	1.62
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	79,116,000.00	1.04
C5	电子	126,106,217.53	1.67
C6	金属、非金属	298,496,264.40	3.94
C7	机械、设备、仪表	1,473,563,858.50	19.46
C8	医药、生物制品	909,758,873.82	12.01
C99	其他制造业	16,120,409.40	0.21
D	电力、煤气及水的生产和供应业	197,151,325.17	2.60
E	建筑业	160,605,000.00	2.12
F	交通运输、仓储业	224,683,191.34	2.97
G	信息技术业	636,685,549.20	8.41
H	批发和零售贸易	324,893,948.64	4.29
I	金融、保险业	9,701,477.01	0.13
J	房地产业	154,657,321.60	2.04
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	300,488,000.00	3.97
	合计	5,428,714,461.87	71.68

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	000581	威孚高科	8,180,000	200,819,000.00	2.65
2	002152	广电运通	4,300,000	187,050,000.00	2.47
3	600166	福田汽车	8,800,000	179,344,000.00	2.37
4	600570	恒生电子	10,600,000	172,674,000.00	2.28
5	600970	中材国际	4,500,000	160,605,000.00	2.12
6	002277	友阿股份	6,000,000	154,020,000.00	2.03
7	601607	上海医药	6,535,590	146,070,436.50	1.93
8	600770	综艺股份	7,800,000	142,272,000.00	1.88
9	600079	人福医药	5,800,000	131,196,000.00	1.73
10	002202	金风科技	5,800,000	111,708,000.00	1.47

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	152,691,372.40	2.02
2	央行票据	1,059,786,000.00	13.99
3	金融债券	529,863,000.00	7.00
	其中:政策性金融债	529,863,000.00	7.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,742,340,372.40	23.01

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	302,070,000.00	3.99
2	0801017	08央票17	2,000,000	201,840,000.00	2.67
3	0801053	08央票53	1,500,000	152,205,000.00	2.01
4	070227	07国开27	1,200,000	128,916,000.00	1.70
5	0801035	08央票35	1,200,000	121,440,000.00	1.60

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,497,846.98
2	应收证券清算款	3,402,869.84
3	应收股利	-
4	应收利息	38,189,804.38
5	应收申购款	507,010.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,597,531.28

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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	10,668,899,211.53
本报告期基金总申购份额	35,283,101.28
减:本报告期基金总赎回份额	378,687,540.79
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,325,494,772.02

§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
二〇一〇年十月二十七日

安信证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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:二〇一〇年十月二十七日

§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10月22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7月1日起至9月30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
交易代码	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7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	-2,973,665.17
2.本期利润	356,552,409.97
3.加权平均基金份额本期利润	0.1783
4.期末基金资产净值	2,540,505,141.69
5.期末基金份额净值	1.2703

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	16.33%	2.26%	-	-	-	-

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		
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,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。

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 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年第三季度,三基金净值增长率分别为:华安中小盘成长股票16.64%、华安创新混合16.35%、华安安信封闭16.33%,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

本报告期没有出现异常交易。

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

三季度A股市场走出了探底回升行情,与其说是市场打消了对经济二次探底的担忧疑虑,不如说是整体估值回落至较低水平带来的反弹。我们在此期间逐步提高了股票仓位,而在行业配置方面仍以医药和信息技术为主,同时增加了食品饮料和汽车等行业的比重,但对强周期性行业依旧较谨慎,未参与在此期间的地产等行业的反弹。相对保守的操作令组合绩效在此阶段表现中庸。

整体上组合依旧延续了成长即防御的投资思路及风格,这主要是基于我们对中期经济趋势的判断。我们认为包括中国在内的全球经济的增速会有所放缓,取而代之的是追求更平稳,更健康的发展模式。因此从中长期我们依然更看好与社会发展和民众生活更和谐更美好的相关行业,我们相信这其中会产生出一批有特色的公司,以其稳定成长性来消化目前相对市场均值水平较高的估值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年9月30日,本基金份额净值为1.2703元,本报告期份额净值增长率为16.33%,同期上证综指上涨10.73%,深圳成指上涨22.18%。

§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	1,940,545,267.98	76.08
	其中:股票	1,940,545,267.98	76.08
2	固定收益投资	513,089,234.60	20.12
	其中:债券	513,089,234.60	20.12
	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	74,890,517.28	2.94
6	其他各项资产	22,201,736.00	0.87
7	合计	2,550,726,755.86	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	-	-
C	制造业	1,166,220,785.25	45.91
C0	食品、饮料	129,695,974.84	5.11
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	2,888,000.00	0.11
C4	石油、化学、塑胶、塑料	102,120,162.21	4.02
C5	电子	77,895,893.62	3.07
C6	金属、非金属	28,440,000.00	1.12
C7	机械、设备、仪表	367,117,903.70	14.45
C8	医药、生物制品	443,691,850.88	17.46
C99	其他制造业	14,371,000.00	0.57
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,477,500.00	1.63
F	交通运输、仓储业	23,898,776.00	0.94
G	信息技术业	332,319,534.37	13.08
H	批发和零售贸易	97,324,127.94	3.83
I	金融、保险业	221,206,694.42	8.71
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	17,960,850.00	0.71
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	40,137,000.00	1.58
	合计	1,940,545,267.98	76.38

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	601318	中国平安	2,121,908	112,227,714.12	4.42
2	600570	恒生电子	6,370,000	103,767,300.00	4.08
3	002007	华兰生物	1,650,000	84,150,000.00	3.31
4	600316	洪都航空	1,191,150	73,803,654.00	2.91
5	002024	苏宁电器	4,500,000	71,865,000.00	2.83
6	600298	安琪酵母	1,751,018	67,729,376.24	2.67
7	600196	复星医药	4,550,000	62,653,500.00	2.47
8	600588	用友软件	2,308,339	59,785,980.10	2.35
9	600216	浙江医药	1,850,100	59,295,705.00	2.33
10	002038	双鹭药业	1,250,000	58,675,000.00	2.31

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	123,299,234.60	4.85
2	央行票据	91,038,000.00	3.58
3	金融债券	298,752,000.00	11.76
	其中:政策性金融债	298,752,000.00	11.76
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	513,089,234.60	20.20

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	080216	08国开16	600,000	64,860,000.00	2.55
2	080202	08国开02	500,000	52,435,000.00	2.06
3	0801044	08央票44	500,000	50,670,000.00	1.99
4	070219	07国开19	500,000	50,380,000.00	1.98
5	070220	07国开20	500,000	50,095,000.00	1.97

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,088,756.10
2	应收证券清算款	13,159,289.54
3	应收股利	-
4	应收利息	7,135,912.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	817,777.58
8	其他	-
9	合计	22,201,736.00

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

截止本报告期末,本基金前十名股票不存在流通受限情况。

§6 基金管理人运用固有资金投资本封闭式基金情况

单位:份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	28,538,470
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	28,538,470
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份额比例(%)	1.43

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《安信证券投资基金基金合同》

2、《安信证券投资基金招募说明书》

3、《安信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
二〇一〇年十月二十七日

华安宝利配置证券投资基金

2010 第三季度报告

2010年9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:二〇一〇年十月二十七日

§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10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7月1日起至9月30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
前端交易代码	040004
后端交易代码	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	3,776,657,304.74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(2010年7月1日-2010年9月30日)
1.本期已实现收益	37,483,906.89
2.本期利润	598,023,733.26
3.加权平均基金份额本期利润	0.1479
4.期末基金资产净值	4,067,420,207.76
5.期末基金份额净值	1.077

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	15.93%	1.02%	6.24%	0.48%	9.69%	0.54%

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2010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		
陆从珍	本基金的基金经理	2010-4-21	-	10年	经济学硕士,10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日起至2010年4月21日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助理,2010年4月21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。

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",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

按照华安宝利配置混合与华安动态灵活配置混合的基金合同,二基金属于配置型基金,2010年第三季度,二基金净值增长率分别为:华安宝利配置混合15.93%、华安动态灵活配置混合13.98%,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

本报告期没有出现异常交易。

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

6月底,上证综指跌至2400点左右,我们认为考虑A股公司2009年25%的实际盈利增长以及2010年预期的20%盈利增长,A股市场估值水平已经跌至2008年上证1664点的水平,而宏观经济与企业盈利能力则远远优于当初,因此判断市场下跌空间已经很小,机会大于风险,从而开始加仓,并在7月份上半月将仓位提升至较高水平,此后,在整个3季度一直维持高仓位操作。诚如基金二季报中提到的,我们开始加仓的股票以绩优蓝筹股为主,一些个股为基金带来了良好的收益,如食品饮料和医药类公司,但也有一些公司如银行等未能创造良好收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年9月30日,本基金份额净值为1.077元,本报告期份额净值增长率为15.93%,同期上证综指上涨10.73%,深圳成指上涨22.18%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望四季度,日本降息以及美国的宽松货币政策将进一步强化通胀预期,有利于相关行业公司表现,其他可关注的主题还包括人民币升值,十二五规划等,市场机会仍将不断出现。但面对不断扩大的市场规模,A股市场也有一定的资金压力,整体市场可能仍然呈现结构性特点。我们的主要策略将是选择有估值安全边际的公司,以获取良好收益。

§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	2,970,177,114.49	67.47
	其中:股票	2,970,177,114.49	67.47
2	固定收益投资	1,025,053,971.03	23.29
	其中:债券	1,025,053,971.03	23.29
	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	352,049,358.99	8.00
6	其他各项资产	54,795,083.51	1.24
7	合计	4,402,075,528.02	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	75,572,000.00	1.86
B	采掘业	153,763,363.20	3.78
C	制造业	1,717,046,935.19	42.21
C0	食品、饮料	291,766,000.00	7.17
C1	纺织、服装、皮毛	62,830,047.50	1.54
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	16,164,000.00	0.40
C4	石油、化学、塑胶、塑料	172,208,000.00	4.23
C5	电子	124,946,460.67	3.07
C6	金属、非金属	201,321,972.25	4.95
C7	机械、设备、仪表	281,986,347.10	6.93
C8	医药、生物制品	565,824,107.67	13.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	17,798,000.00	0.44
E	建筑业	57,104,000.00	1.40
F	交通运输、仓储业	41,508,575.84	1.02
G	信息技术业	282,752,963.12	6.95
H	批发和零售贸易	181,585,583.42	4.46
I	金融、保险业	340,388,789.72	8.37
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	102,656,904.00	2.52
	合计	2,970,177,114.49	73.02

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	000858	五 粮 液	7,100,000	243,743,000.00	5.99
2	601318	中国平安	4,250,368	224,801,963.52	5.53
3	601607	上海医药	9,800,000	219,030,000.00	5.38
4	000630	铜陵有色	8,000,000	145,520,000.00	3.58
5	600028	中国石化	15,055,776	123,457,363.20	3.04
6	600572	康恩贝	5,550,000	97,569,000.00	2.40
7	002024	苏宁电器	5,793,086	92,515,583.42	2.27
8	600770	综艺股份	4,567,100	78,830,904.00	1.94
9	000998	隆平高科	2,800,000	75,572,000.00	1.86
10	600570	恒生电子	4,634,065	75,488,918.85	1.86

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	121,185,000.00	2.98
3	金融债券	182,832,000.00	4.50
	其中:政策性金融债	182,832,000.00	4.50
4	企业债券	358,200,271.00	8.81
5	企业短期融资券	130,324,000.00	3.20
6	可转债	232,512,700.03	5.72
7	其他	-	-
8	合计	1,025,053,971.03	25.20

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	113001	中行转债	1,100,000	115,786,000.00	2.85
2	113002	工行转债	664,870	74,219,438.10	1.82
3	0801035	08央票35	700,000	70,840,000.00	1.74
4	126002	06中化债	560,000	53,928,000.00	1.33
5	122033	09富力债	500,000	52,900,000.00	1.30

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 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,989,488.08
2	应收证券清算款	35,907,426.90
3	应收股利	-
4	应收利息	13,771,215.72
5	应收申购款	3,126,952.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	54,795,083.51

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	125709	唐钢转债	27,859,000.73	0.68
2	110007	博汇转债	6,149,000.00	0.15

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	600770	综艺股份	33,831,000.00	0.83	非公开发行

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	4,065,277,714.55
本报告期基金总申购份额	94,947,375.44
减:本报告期基金总赎回份额	383,567,785.25
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,776,657,304.74

§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
二〇一〇年十月二十七日