华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金

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
报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日

2009 第四季度报告

§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	华安中国A股增强指数
基金主代码	040002
前端基金主代码	040002
后端基金主代码	041002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2002年11月8日
报告期末基金份额总额	5,991,712,872.20份
投资目标	运用增强性指数化投资方法，通过控制股票投资组合相对MSCI中国A股指数有限度的偏离，力求基金收益率适度超越本基金比较基准，并在谋求基金资产长期增值的基础上，择机实现一定的收益和分配。
投资策略	(1)资产配置：本基金投资于股票的目标比例为基金资产净值的95%。本基金在目前中国证券市场缺少限藏风险工具的情况下，可以根据开放式基金运作的实际需求和市场的实际情况，适当调整基金资产分配比例。 (2)股票投资：本基金以MSCI中国A股指数成分股构成及其权重等指标为基础，通过复制和有限度的增强管理方法，构造指数化投资组合。在投资组合建立后，基金经理定期检验该组合与比较基准的跟踪偏离度，适时对投资组合进行调整，使跟踪偏离度控制在限定的范围内。此外，本基金还将积极参与一级市场的新股申购、股票增发等。 (3)其它投资：本基金将审慎投资于经中国证监会批准的其它金融工具，减少基金资产的风险并提高基金的收益。
业绩比较基准	95%×MSCI中国A股指数收益率＋5%×金融同业存款利率
风险收益特征	本基金为增强型指数基金，通过承担证券市场的系统性风险，来获取市场的平均回报，属于中等风险、中等收益的投资产品。
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	255,426,717.28
2.本期利润	923,217,896.54
3.加权平均基金份额本期利润	0.1471
4.期末基金资产净值	5,733,841,768.20
5.期末基金份额净值	0.957

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。

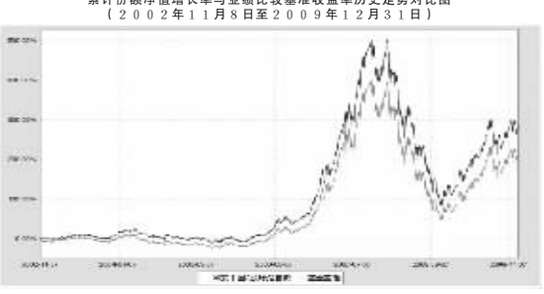
3.2 基金净值表现

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	16.99%	1.61%	18.18%	1.65%	-1.19%	-0.04%

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MSCI中国A股指数增强型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2002年11月8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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
许之彦	本基金的基金经理、金融工程部负责人	2008-4-25	-	6年	理学博士，6年证券、基金从业经验，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，2008年4月起担任本基金的基金经理，2009年9月起同时担任上证180交易型开放式指数证券投资基金及华安上证180ETF联接基金的基金经理。
刘璎	本基金的基金经理	2008-4-25	-	8年	管理学硕士，8年证券从业经历。曾在交通银行工作，2001年加入华安基金管理有限公司，历任市场部高级投资顾问、专户理财部客户主管，上证180交易型开放式指数证券投资基金经理助理。2007年3月起担任上证180交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2008年4月起同时担任本基金的基金经理。
牛勇	本基金的基金经理助理	2009-7-3	-	5年	复旦大学经济学硕士，FRM(金融风险管理师)，5年证券金融从业经历，曾在泰康人寿保险股份有限公司从事研究工作。2008年5月加入华安基金管理有限公司后任金融工程部高级金融工程师，2009年7月起担任本基金的基金经理助理。

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MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》、《华安MSCI中国A股指数增强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

本基金为增强型指数基金，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

四季度国内宏观经济继续强劲复苏的态势，市场的流动性仍保持充裕，但受地产调控政策以及涨幅较高行业调整影响，市场在期间呈现震荡向上的走势，其中有色地产代表的周期性行业落后市场，哥本哈根会议未能给新能源板块带来超预期表现，在坚持拟合MSCI中国A股指数下，基金在本季度适度低配了有色、地产行业，但超配的新能源未带来显著超额收益。

2010年，新增信贷规模仍将维持高位且投放节奏趋于合理控制，企业利润水平将继续恢复增长，央行为应对通胀将采取一定举措，在调控通胀政策与基本面向好的制约对抗中，一季度市场还将维持震荡格局。从中期来看，国内宏观经济增长的担忧基本解除，仍然有望持续较高增长。全球经济复苏和海外需求增长也有助于国内企业利润的回升。我们对上市公司在2010年获得超过20%的净利润增长比较有信心。对2010年全年的市场表现，我们相对乐观。

一季度，本基金的增强将侧重在受益于消费刺激政策、结构调整政策的行业，并考虑受益于通涨的行业，选择行业中业绩良好的个股适度增强配置。根据MSCI公司对MSCI China A指数编制规则的调整，本基金在11月底对成份股进行了调整操作。作为MSCI中国A股增强型指数基金的管理人，我们继续坚持被动投资的原则，在充分拟合指数的前提下，通过适度增强策略，勤勉尽责，为投资者获得长期稳定的回报。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内华安中国A股增强指数基金份额净值增长率为16.99%，同期业绩比较基准增长率为18.18%，基金净值表现落后比较基准1.19%，截至2009年12月31日，本基金过去30个交易日日均跟踪偏离度为0.10%(按照基金合同和招募说明书规定)。

§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	5,423,216,952.13	93.97
	其中：股票	5,423,216,952.13	93.97
2	固定收益投资	98,340,000.00	1.70
	其中：债券	98,340,000.00	1.70
	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	222,446,775.60	3.85
6	其他资产	27,370,579.76	0.47
7	合计	5,771,374,307.49	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资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	31,135.00	0.00
C0	食品、饮料	16,640.00	0.00
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	14,495.00	0.00
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
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	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	76,020.00	0.00
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	107,155.00	0.00

5.2.2 指数投资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	27,086,442.25	0.47
B	采掘业	512,253,844.78	8.93
C	制造业	1,964,742,164.40	34.27
C0	食品、饮料	231,180,384.77	4.03
C1	纺织、服装、皮毛	46,197,939.20	0.81
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	36,789,437.60	0.64
C4	石油、化学、塑胶、塑料	147,234,295.01	2.57
C5	电子	26,566,332.32	0.46
C6	金属、非金属	469,988,224.29	8.20
C7	机械、设备、仪表	743,435,262.91	12.97
C8	医药、生物制品	238,888,993.12	4.17
C99	其他制造业	24,461,295.18	0.43
D	电力、煤气及水的生产和供应业	174,142,095.21	3.04
E	建筑业	165,384,220.44	2.88
F	交通运输、仓储业	269,141,165.40	4.69
G	信息技术业	229,495,411.19	4.00
H	批发和零售贸易	221,222,001.33	3.86
I	金融、保险业	1,308,126,751.96	22.81
J	房地产业	343,459,399.95	5.99
K	社会服务业	65,791,175.40	1.15
L	传播与文化产业	21,171,069.56	0.37
M	综合类	121,094,055.26	2.11
	合计	5,423,109,797.13	94.58

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积极投资与指数投资的各前五名股票明细

5.3.1积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.00
2	300037	新宙邦	500	14,495.00	0.00
3	002329	皇氏乳业	500	10,050.00	0.00
4	002330	得利斯	500	6,590.00	0.00

5.3.2指数投资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	10,420,353	188,087,371.65	3.28
2	601318	中国平安	3,353,400	184,738,806.00	3.22
3	600030	中信证券	4,629,312	147,073,242.24	2.57
4	600000	浦发银行	5,865,237	127,216,990.53	2.22
5	601328	交通银行	12,524,544	117,104,486.40	2.04
6	600519	贵州茅台	673,977	114,454,774.14	2.00
7	601166	兴业银行	2,683,147	108,157,655.57	1.89
8	600016	民生银行	12,365,627	97,812,109.57	1.71
9	000002	万科A	7,983,591	86,302,618.71	1.51
10	601088	中国神华	2,051,990	71,450,291.80	1.25

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	-	-
2	央行票据	98,340,000.00	1.72
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	98,340,000.00	1.72

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	0901030	09央票30	1,000,000	98,340,000.00	1.72

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	1,274,503.49
2	应收证券清算款	12,125,887.19
3	应收股利	-
4	应收利息	774,213.86
5	应收申购款	13,195,975.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,370,579.76

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。

5.8.5.1报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.8.5.2报告期末积极投资前五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	601117	中国化学	76,020.00	0.00	网上申购中签
2	300037	新宙邦	14,495.00	0.00	网上申购中签
3	002329	皇氏乳业	10,050.00	0.00	网上申购中签
4	002330	得利斯	6,590.00	0.00	网上申购中签

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	6,570,830,454.01
报告期期间基金总申购份额	1,566,486,887.83
报告期期间基金总赎回份额	2,145,604,469.64
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	5,991,712,872.20

§7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

1、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金合同》

2、《华安MSCI中国A股指数增强型证券投资基金招募说明书》

3、《华安MSCI中国A股指数增强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

华安中小盘成长股票型证券投资基金

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
报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日

2009 第四季度报告

§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	华安中小盘成长股票
基金主代码	040007
前端基金主代码	040007
后端基金主代码	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	9,219,215,856.49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，积极把握各选股票的投资机会，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(2009年10月1日-2009年12月31日)
1.本期已实现收益	441,017,785.24
2.本期利润	1,853,948,348.65
3.加权平均基金份额本期利润	0.1907
4.期末基金资产净值	11,401,600,104.05
5.期末基金份额净值	1.2367

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。

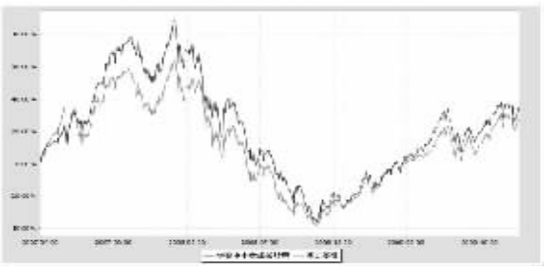
3.2 基金净值表现

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	17.45%	1.53%	19.75%	1.50%	-2.30%	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历史走势对比图
(2007年4月10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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
沈雪峰	本基金的基金经理	2009-6-25	-	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"，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

三季度上证综指从最高3478点下跌至2669点，最大跌幅达到23%，我们判断中国宏观经济在未来半年将进入低通胀高增长的黄金阶段，A股暴跌之后也将出现修复性上涨，坚定看好四季度行情，本基金国庆节后开始迅速加仓并保持了较高仓位运作。除了重仓个股选择有超额贡献外，本基金在行业配置方面的超额贡献也比较突出。四季度超配了生物医药和汽车行业，银行则做了大幅低配，只是在耐用消费品和券商股的低配没有分享到该板块上涨的超额收益。

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1.2367元，本报告期净值增长率17.45%，同期业绩比较基准收益率为19.75%。

§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	10,564,552,431.66	90.69
	其中：股票	10,564,552,431.66	90.69
2	固定收益投资	302,820,000.00	2.60
	其中：债券	302,820,000.00	2.60
	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	762,528,277.49	6.55
6	其他资产	18,951,477.29	0.16
7	合计	11,648,852,186.44	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	185,736,730.31	1.63
B	采掘业	1,418,914,838.83	12.44
C	制造业	5,968,664,553.47	52.35
C0	食品,饮料	654,894,139.83	5.74
C1	纺织,服装,皮毛	-	-
C2	木材,家具	-	-
C3	造纸,印刷	38,271,229.44	0.34
C4	石油,化学,塑胶,塑料	454,072,033.40	3.98
C5	电子	71,671,715.93	0.63
C6	金属,非金属	1,531,516,212.44	13.43
C7	机械,设备,仪表	1,755,765,431.62	15.40
C8	医药,生物制品	1,462,473,790.81	12.83
C99	其他制造业	-	-
D	电力,煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	173,944,519.96	1.53
F	交通运输,仓储业	142,480,000.00	1.25
G	信息技术业	216,416,938.69	1.90
H	批发和零售贸易	260,406,691.97	2.28
I	金融,保险业	1,388,478,502.98	12.18
J	房地产业	493,629,617.78	4.33
K	社会服务业	4,370,863.44	0.04
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	311,509,174.23	2.73
	合计	10,564,552,431.66	92.66

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	600660	福耀玻璃	33,500,000	500,490,000.00	4.39
2	600585	海螺水泥	8,600,645	428,828,159.70	3.76
3	000983	西山煤电	10,501,652	418,910,898.28	3.67
4	002022	科华生物	18,609,055	407,352,213.95	3.57
5	000538	云南白药	6,700,000	404,680,000.00	3.55
6	601318	中国平安	6,800,000	374,612,000.00	3.29
7	601166	兴业银行	9,000,000	362,790,000.00	3.18
8	600066	宇通客车	17,904,945	357,919,850.55	3.14
9	600276	恒瑞医药	6,403,903	336,204,907.50	2.95
10	600519	贵州茅台	1,905,460	323,585,217.20	2.84

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	302,820,000.00	2.66
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	302,820,000.00	2.66

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	102,650,000.00	0.90
2	0901028	09央票28	1,000,000	98,370,000.00	0.86
3	0801020	08央票20	800,000	82,144,000.00	0.72
4	0901038	09央票38	200,000	19,656,000.00	0.17

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	8,574,231.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	8,173,809.65
5	应收申购款	2,203,436.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,951,477.29

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	10,228,787,264.49
报告期期间基金总申购份额	271,664,005.79
报告期期间基金总赎回份额	1,281,235,413.79
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	9,219,215,856.49

§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
二〇一〇年一月二十一日

华安强化收益债券型证券投资基金

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
报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日

2009 第四季度报告

§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	华安强化收益债券
基金主代码	040012
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年4月13日
报告期末基金份额总额	1,046,557,085.79份
投资目标	在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过增强信用产品的投资，以获取资产的长期增值。
投资策略	本基金将以宏观经济、市场利率研究主导固定收益资产投资，在控制风险和保持资产流动性的前提下，获取债券市场平均收益；同时在严格的信用评估和利差分析基础上，通过投资于有一定信用风险、具有较高收益率的信用类债券，以获取超越市场平均水平的收益；此外，本基金还将通过积极的新股申购和个股精选来增强基金资产的收益。
业绩比较基准	中国债券综合指数收益率×90%+中证红利指数收益率×10%
风险收益特征	本基金属于具有中低风险收益特征的基金品种，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金，属于证券投资基金中的中低等风险和中低等收益品种。
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
下属两级基金的基金简称	华安强化收益债券A　　华安强化收益债券B
下属两级基金的交易代码	040012　　040013
报告期末下属两级基金的份额总额	655,268,738.17份　　391,288,347.62份

§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)	
	华安强化收益债券A	华安强化收益债券B
1.本期已实现收益	15,868,681.94	11,049,394.55
2.本期利润	38,500,513.70	34,500,531.43
3.加权平均基金份额本期利润	0.0539	0.0606
4.期末基金资产净值	683,956,299.83	407,155,651.08
5.期末基金份额净值	1.044	1.041

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