

信息披露

华安宝利配置证券投资基金

2009 第四季度报告

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

基金管理人及基金托管人承诺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。

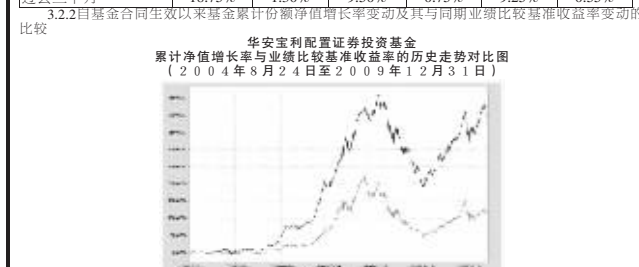
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所列财务数据未经审计。

本报告自2009年10月11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
基金代码	040004
前端基金代码	040004
后端基金代码	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收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定价和定性的分析，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%



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

基金管理人及基金托管人承诺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。

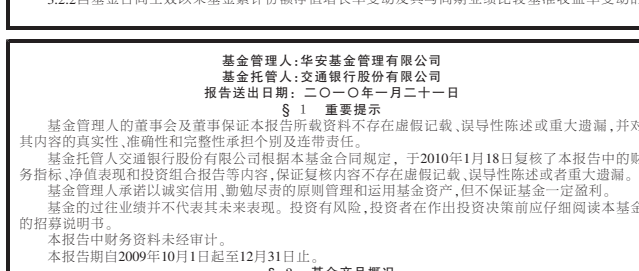
基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资者有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中所列财务数据未经审计。

本报告自2009年10月11日起至12月31日止。

§ 2 基金产品概况	
基金简称	华安信封固
基金代码	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，本基金的投资资产不低于基金资产总额的80%。其中投资于股票的比例控制在基金资产净值的20-50%，股票资产中的比例控制在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

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						
1.本期已实现收益	报告期(2009年10月1日—2009年12月31日) 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					
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	14.99%	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

2009 第四季度报告



12

安信证券投资基金公司
累计份额净值增长率历史走势图

(1998年6月22日至2009年12月31日)

The chart displays the cumulative share net value growth rate of Axi Investment Management Co., Ltd. from June 22, 1998, to December 31, 2009. The Y-axis represents the cumulative share net value growth rate, ranging from 0.00% to 120.00% in 10.00% increments. The X-axis represents time, with major ticks for 1998.6.22, 2000.6.22, 2002.6.22, 2004.6.22, 2006.6.22, 2008.6.22, and 2009.12.31. The line shows a relatively flat trend until 2006, followed by a sharp rise to a peak of approximately 115% in early 2008. This is followed by a sharp decline to about 60% in mid-2008, and then a recovery to approximately 100% by the end of 2009.

日期	累计份额净值增长率 (%)
1998.6.22	0.00
2000.6.22	2.00
2002.6.22	3.00
2004.6.22	4.00
2006.6.22	5.00
2008.6.22	115.00
2009.12.31	100.00

数据来源：安信基金

4.1 基金经理(或基金经理)简历				
姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
陈宇	本基金的基金经理	2008-2-13	13年	<p>工商管理硕士，中国注册会计师协会执业会员，13年证券从业经历。毕业于上海南方国际证券公司发行部，申报万国证券投资类从业资格，上海南方国际证券有限公司发行部任职，2003年加入平安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员，专户理财部基金经理助理，2007年5月2008年2月担任安颐证券投资基金基金经理，2008年2月担任安泰证券投资基金基金经理，2008年10月12日起同时担任安泰基金之选优策略证券投资基金的基金经理。</p>

<p>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。</p> <p>2. 证券从业年限是指从事证券行业(证券从业人员资格管理办法)的相关规定。</p> <p>3. 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况及(安信证券投资私募基金合同)有关基金法律法规的约定，本报告期内无，如违反则应说明原因和运用资金情况，在不存在违规的前提下，为基金份额持有人谋取最大利益，不存在违反或未履行基金合同承诺的情况。</p> <p>4. 基金交易说明</p> <p>4.3.1 公平交易制度的执行情况</p> <p>公司旗下不同基金、投资组合等账户对同一证券进行交易的业务，均纳入(交易金额≥公平交易制度)进行公平交易。</p> <p>4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间是否存在利益冲突，利益冲突的情况及处理措施</p> <p>公司交易公平交易公平交易管理办法(交易所所属)规定不同基金、账户买卖同一证券的公允价值分配规则(时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡)，并在此原则下执行(买卖同一证券)公平交易系统控制，不同基金、账户间买卖同一证券完全通过系统进行比较并执行分配，实现公平交易。</p> <p>4.3.3 异常交易行为的专项说明</p> <p>对于异常交易，公司规定(交易金额≥公平交易制度)同一(账户)之间以及(基金)账户与(新设账户)和(申购与赎回业务)账户进行其他交易，并视情况及时，未出现异常交易。</p> <p>4.3.4 本投资组合与(关联方)存在(大额)关联交易的投资，关联交易的投资和投资金额，占投资总量的比例</p> <p>华安(以上)成长投资(投资)的有(三个)基金，华安(中)成长(长期股票)，华安(新)混合，基金(基金)信时，05年第(四)季度，二基金净值增幅(分别为)：华安(中)成长(长期股票)17.45%，华安(新)混合14.06%，华安(信)时(长期)14.99%，基金净值增幅(均)未(若)</p>
--

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
2	其中：股票	3,675,690,304.48	73.97
3	固定收益投资	851,074,473.67	17.13
4	其中：债券	851,074,473.67	17.13
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
9	银行存款和结算备付金合计	397,772,373.11	8.00
10	其他资产	44,592,556.97	0.90
11	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			
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	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
D	食品、饮料	206,024,449.32	4.32
E	纺织、服装、皮毛	68,569,490.84	1.44
F	木材、家具	-	-
G	造纸、印刷	128,707,326.61	2.70
H	石油、化学、塑胶、塑料	1,879,598.83	0.04
I	电子	2,169,417.50	0.05
J	金属、非金属	409,946,802.33	8.59
K	机械、设备、仪表	395,944,241.24	8.30
L	医药、生物制品	191,449,736.68	4.01
M	其他制造业	-	-
N	电力、煤气及水的生产和供应业	69,385,610.78	1.45
O	建筑业	75,996,020.00	1.58
P	交通运输、仓储业	143,325,800.00	3.00
Q	信息技术业	183,457,671.70	3.84
R	批发和零售贸易	99,781,180.24	2.09
S	金融、保险业	836,766,634.24	17.54
T	房地产业	246,938,164.52	5.18
U	社会服务业	28,579,263.15	0.60
V	传播与文化产业	3,074,535.81	0.06
W	综合类	30,070,000.00	0.63
X	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						7.03
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	2.65	
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

投资基金

四季 度 报 告

5.5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况		§ 5 投资组合报告		
序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)	
1	权益投资	2,609,025,174.93	76.81	
	其中:股票	2,609,025,174.93	76.81	
2	固定收益投资	698,128,693.80	20.55	
	其中:债券	698,128,693.80	20.55	
	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	72,339,928.22	2.13	
6	其他资产	17,441,682.42	0.51	
7	合计	3,396,935,479.37	100.00	
5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合		上表金额单位:人民币元		

代码	行业类别	公允价值(元)	公允价值占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	--	--
B	采掘业	186,617,060.04	5.57
C	制造业	1,234,928,967.21	36.86
D	食品、饮料	91,937,658.47	2.74
C1	纺织、服装、皮毛	--	--
C2	木材、家具	--	--
C3	造纸、印刷	72,525,900.00	2.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	133,497,702.17	3.96
C5	电子	--	--
C6	金属、非金属	167,850,591.80	5.01
C7	机械、设备、仪表	417,970,515.94	12.47
C8	医药、生物制品	351,146,198.83	10.48
C9	其他制造业	--	--
D	电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E	建筑业	9,440,000.00	0.28
F	交通运输、仓储业	40,843,000.00	1.22
G	信息技术业	337,006,056.58	10.06
H	批发和零售贸易	79,175,550.48	2.36
I	金融、保险业	502,472,386.69	15.00
J	房地产业	102,555,000.00	3.06
K	社会服务业	1,941,767.46	0.06
L	传播与文化产业	24,237,000.00	0.72
M	综合类	89,808,786.50	2.68
	合计	2,609,025,174.93	77.87

§ 5 投资组合报告					
5.1 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	8,500,000	164,390,000.00	4.91
2	600036	招商银行	7,576,053	136,747,756.65	4.08
3	601096	复星医药	6,017,799	117,768,326.43	3.51
4	000651	格力电器	3,650,000	105,631,000.00	3.15
5	600239	云南城投	4,500,000	102,555,500.00	3.06
6	601318	中国平安	1,850,000	101,916,500.00	3.04
7	600570	恒生电子	4,751,661	99,832,397.61	2.92
8	600588	用友软件	2,329,958	91,276,838.28	2.78
9	600585	海螺水泥	1,580,000	78,778,788.00	2.35
10	002024	苏宁电器	3,783,116	78,613,150.48	2.35

真型证券投资基金

四季度报告

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	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	-	-
5	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	675,123,312.19	4.58
7	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