

安信证券投资基金

[2012] 第一季度报告

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：二〇一二年四月二十二日

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2012年4月20日复核了本报告中的财务数据、净值表现和投资组合报告等内容，保证基金内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金经理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。

本报告期自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安信证封闭
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1月12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收益。
投资策略	本基金为成长基金，本基金的资产投资不低于基金资产总额的80%，其中投资于国内的行业比例限制在20%-50%，股票投资的比例限制在45%-50%，现金比例根据运营情况调整，在股票投资中，70%投资于具有良好成长性的上市公司的股票。 本基金的投资目标是主要指发展股票投资良好，在同行业的上市公司中具有较好的盈利能力，财务状况良好，能持续较高的业绩增长，预期收入或利润增长率高于同行业CDP增长的上市公司的股票。
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

单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -88,635,759.06

2.本期利润 -23,880,513.43

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0119

4.期末基金份额净值 1,799,918,110.83

5.期末基金资产净值 9,000,000.00

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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。
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 本基金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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 -1.30% 2.17% - -

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计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与业绩比较基准收益的历史走势对比图
(1998年6月2日至2012年3月31日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

陈新华 本基金的基金经理 2008-2-13 - 16年 工商管理硕士，中国注册会计师协会会员、16年证券、基金从业经验。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司研究所工作。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、基金经理助理、基金经理、研究发展部研究员、专户理财投资经理、安顺基金经理、投资基金基金经理和华安利丰基金经理。2007年3月加入华安基金管理有限公司，曾任华安利丰基金经理。2008年3月起担任华安稳健配置债券型基金基金经理。2008年10月起担任华安安心回报债券型基金基金经理。2011年1月起担任华安增利货币基金基金经理。2011年6月起担任华安增利货币基金基金经理。

4.2 报告期内本基金遵守法律法规情况说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守有关法律法规及《股权投资基金法》等有关规定，勤勉尽责地履行诚实信用、谨慎勤勉的职责，严格控制和运用基金资产，对控制风险的前提下，为基金份额持有人最大限度地避免在违法操作或违规发行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易制度的执行情况说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，开放式基金、开放式基金、专户理财产品及其他投资基金资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面均遵循公开公平原则，通过内部的MSDN群、发送邮件、登录公司网站、发送电子邮件等方式确保各投资组合经理之间公平交易信息的共享。

在投资环节，公司各投资组合经理根据投资风格的风格和投资策略，制定严格的操作执行决策规则，以保证各投资组合交易的公平性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，通过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

4.3.2 不公平交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部等部门制定了《私募基金、专户理财、股票、债券、回购等投资品种在证券一级市场中购、不同投资组合间最近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场的第三方信息，如：持仓的债券信息，定期对各投资组合与交易对手之间进行交易的价格公平性进行审查，对不同投资组合最近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.3 公开公平交易制度的执行情况良好。

4.4 报告期内本基金的交易策略和业绩表现说明

本基金报告期内财务资料未经过审计。

本基金自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -38,672,874.55

2.本期利润 56,579,872.46

3.加权平均基金份额本期利润 0.0189

4.期末基金份额净值 2,894,462,314.50

5.期末基金资产净值 9,064,984.00

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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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。

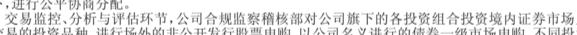
3.2.1 本基金报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 净值增长率① 净值增长率② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 1.99% 1.91% - -

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计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与业绩比较基准收益的历史走势对比图
(1998年6月1日至2012年3月31日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

陈新华 本基金的基金经理 2008-2-13 - 16年 工商管理硕士，中国注册会计师协会会员、16年证券、基金从业经验。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司研究所工作。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、基金经理助理、基金经理、研究发展部研究员、专户理财投资经理、安顺基金经理和华安利丰基金经理。2007年3月加入华安基金管理有限公司，曾任华安利丰基金经理。2008年3月起担任华安稳健配置债券型基金基金经理。2008年10月起担任华安安心回报债券型基金基金经理。2011年1月起担任华安增利货币基金基金经理。2011年6月起担任华安增利货币基金基金经理。

4.2 报告期内本基金遵守法律法规情况说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守有关法律法规及《股权投资基金法》等有关规定，勤勉尽责地履行诚实信用、谨慎勤勉的职责，严格控制和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人最大限度地避免在违法操作或违规发行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易制度的执行情况说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，开放式基金、开放式基金、专户理财产品及其他投资基金资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面均遵循公开公平原则，通过内部的MSDN群、发送邮件、登录公司网站、发送电子邮件等方式确保各投资组合经理之间公平交易信息的共享。

在投资环节，公司各投资组合经理根据投资风格的风格和投资策略，制定严格的操作执行决策规则，以保证各投资组合交易的公平性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，通过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

4.3.2 不公平交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部等部门制定了《私募基金、专户理财、股票、债券、回购等投资品种在证券一级市场中购、不同投资组合间最近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场的第三方信息，如：持仓的债券信息，定期对各投资组合与交易对手之间进行交易的价格公平性进行审查，对不同投资组合最近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.3 公开公平交易制度的执行情况良好。

4.4 报告期内本基金的交易策略和业绩表现说明

本基金报告期内财务资料未经过审计。

本基金自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

主要财务指标 报告期(2012年1月1日-2012年3月31日)

1.本期已实现收益 -38,672,874.55

2.本期利润 56,579,872.46

3.加权平均基金份额本期利润 0.0189

4.期末基金份额净值 2,894,462,314.50

5.期末基金资产净值 9,064,984.00

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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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。

3.2.1 本基金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② 业绩比较基准收益率③ 业绩比较基准收益率④

过去三个月 1.99% 1.91% - -

3.2.2 基金合同生效以来基金份额累计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与业绩比较基准收益的历史走势对比图
(1998年6月1日至2012年3月31日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

陈新华 本基金的基金经理 2008-2-13 - 16年 工商管理硕士，中国注册会计师协会会员、16年证券、基金从业经验。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司研究所工作。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、基金经理助理、基金经理、研究发展部研究员、专户理财投资经理、安顺基金经理。2007年3月加入华安基金管理有限公司，曾任华安利丰基金经理。2008年3月起担任华安稳健配置债券型基金基金经理。2008年10月起担任华安安心回报债券型基金基金经理。2011年1月起担任华安增利货币基金基金经理。2011年6月起担任华安增利货币基金基金经理。

4.2 报告期内本基金遵守法律法规情况说明

本基金报告期内，基金管理人严格遵守有关法律法规及《股权投资基金法》等有关规定，勤勉尽责地履行诚实信用、谨慎勤勉的职责，严格控制和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人最大限度地避免在违法操作或违规发行基金合同承诺的情形。

4.3 公平交易制度的执行情况说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，开放式基金、开放式基金、专户理财产品及其他投资基金资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面均遵循公开公平原则，通过内部的MSDN群、发送邮件、登录公司网站、发送电子邮件等方式确保各投资组合经理之间公平交易信息的共享。

在投资环节，公司各投资组合经理根据投资风格的风格和投资策略，制定严格的操作执行决策规则，以保证各投资组合交易的公平性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，通过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

4.3.2 不公平交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部等部门制定了《私募基金、专户理财、股票、债券、回购等投资品种在证券一级市场中购、不同投资组合间最近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控；风险管理部根据市场的第三方信息，如：持仓的债券信息，定期对各投资组合与交易对手之间进行交易的价格公平性进行审查，对不同投资组合最近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.3 公开公平交易制度的执行情况良好。

4.4 报告期内本基金的交易策略和业绩表现说明

本基金报告期内财务资料未经过审计。

本基金自2012年1月1日起至3月31日止。

§ 2 基金产品概况

主要财务指标 报告期