

安顺证券投资基金 2009 年年度报告

2009 年 12 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

送出日期：2010 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

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 2009 年 3 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	37
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
8.6 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	44
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	44
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	44
8.9 投资组合报告附注	44
§ 9 基金份额持有人信息	45
§ 10 重大事件揭示	45
§ 11 备查文件目录	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	安顺证券投资基金
基金简称	华安安顺封闭
基金主代码	500009
交易代码	500009
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999 年 6 月 15 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
报告期末基金份额总额	30 亿份
基金合同存续期	15 年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999 年 6 月 22 日

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金的投资目标是为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。</p> <p>本基金主要投资于成长型上市公司，并兼顾对收益型上市公司及债券的投资，从而使投资者在承受一定风险的情况下，有可能享受到较高的资本利得和稳定的收益。</p>
投资策略	<p>本基金为平衡型基金，兼顾资本利得、红利及利息收入。本基金的证券资产将不低于基金资产总额的 80%，其中投资于债券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 40-80%，现金等货币性资产比例根据市场和运作情况调整。在股票资产中，60% 左右投资于具有良好成长性的上市公司股票，40% 左右投资于收益型上市公司股票，在此基础上各自上下浮动 10%。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</p>

	润增长率不低于同期 GDP 的增长率。本基金界定的收益型股票主要指经营状况良好、利润来源稳定，具有良好分红能力，预期每股收益高于市场平均水平，预期市盈率低于市场平均水平的上市公司的股票。
--	---

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司 (简称“华安基金”)	交通银行股份有限公司 (简称“交通银行”)
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		40088-50099	95559
传真		021-68863414	021-62701216
注册地址		上海市浦东南路 360 号 新上海国际大厦 38 楼	上海市银城中路 188 号
办公地址		上海市浦东南路 360 号新 上海国际大厦 2 楼、37 楼、 38 楼	上海市银城中路 188 号
邮政编码		200120	200120
法定代表人		俞妙根	胡怀邦

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司上海分公司	上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	1,499,978,799.31	-71,703,190.58	5,425,918,775.05
本期利润	2,542,287,673.67	-2,468,175,428.58	6,092,510,714.64
加权平均基金份额本期利润	0.8474	-0.8227	2.0308
本期加权平均净值利润率	53.25%	-48.60%	71.89%
本期基金份额净值增长率	77.62%	-38.22%	113.48%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配利润	1,984,291,687.71	275,805,579.64	4,246,016,078.98
期末可供分配基金份额利润	0.6614	0.0919	1.4153
期末基金资产净值	5,818,093,253.31	3,275,805,579.64	9,433,981,008.22
期末基金份额净值	1.9394	1.0919	3.1447
3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
基金份额累计净值增长率	734.06%	369.62%	660.15%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	16.56%	2.89%	-	-	-	-
过去六个月	19.75%	2.56%	-	-	-	-
过去一年	77.62%	2.72%	-	-	-	-
过去三年	134.25%	3.37%	-	-	-	-
过去五年	434.88%	3.03%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	734.06%	2.59%	-	-	-	-

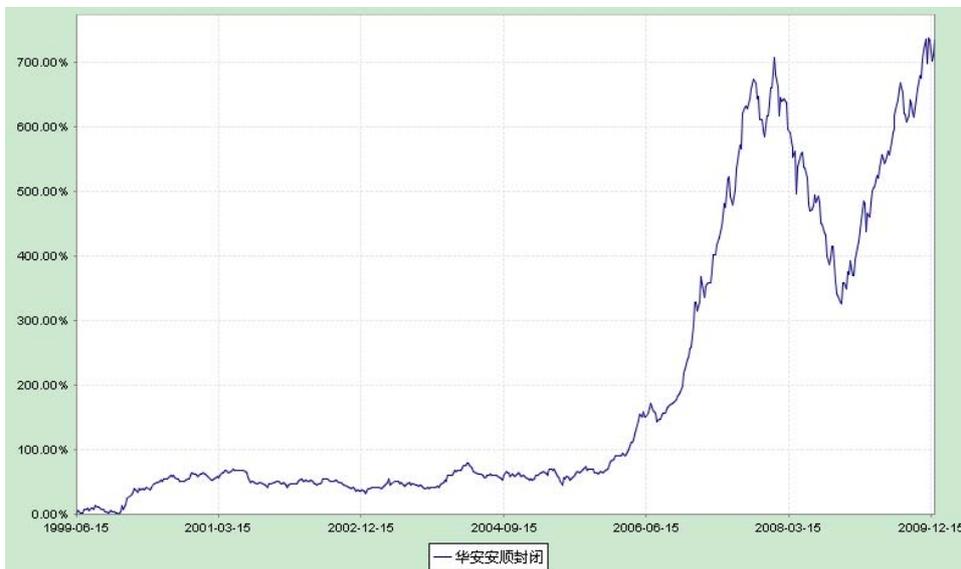
注：本基金合同中并没有规定业绩比较基准。

3.2.2 自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

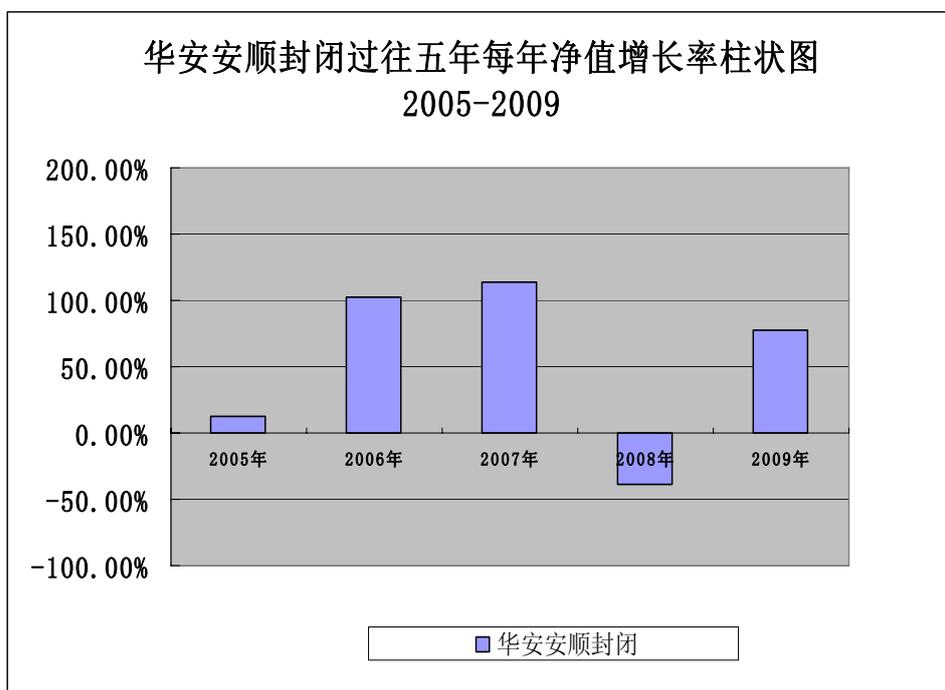
安顺证券投资基金

累计份额净值增长率历史走势图

(1999 年 6 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注

2009年	-	-	-	-	-
2008年	12.300	3,690,000,000.00	-	3,690,000,000.00	-
2007年	10.800	3,240,000,000.00	-	3,240,000,000.00	-
合计	23.100	6,930,000,000.00	-	6,930,000,000.00	-

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20号文批准于1998年6月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本1.5亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至2009年12月31日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭2只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安宝利配置混合、华安现金富利货币、华安上证180ETF、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安稳定收益债券、华安核心股票、华安强化收益债券、华安动态灵活配置混合、华安上证180ETF联接、华安国际配置(QDII)等14只开放式基金，管理资产规模达到930.18亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
尚志民	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2003年9月18日	-	13年	工商管理硕士，13年证券、基金从业经验，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，1999年6月至2001年9月担任安顺证券投资基金的基金经理，2000年7月至2001年9月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理，2001年9月至2003年9月担任华安创新证券

					投资基金的基金经理，2003 年 9 月至今担任本基金的基金经理，2006 年 9 月起同时担任华安宏利股票型证券投资基金的基金经理。
汪光成	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	2009 年 3 月 27 日	8 年	管理学博士，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 月至 2009 年 3 月担任本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 日起担任华安创新证券投资基金的基金经理。
陆从珍	本基金的基金经理助理	2009 年 5 月 16 日	-	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 日起担任本基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理。

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《安顺证券投资基金基金

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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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

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。09 年年度，华安策略优选股票净值增长率为 67.60%，华安安顺封闭的净值增长率为 77.62%，华安安顺封闭增长率高于华安策略优选股票 10.02 个百分点。产生较大差异的主要原因在于 8 月份市场出现大幅下跌前后对股票仓位控制上，期间华安策略优选股票基金的股票平均仓位比例为 90.99%，而华安安顺封闭的平均股票仓位为 75.5%。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年一开年，中国政府即开始出台了强力的经济刺激政策，包括 4 万亿投资和各大产业振兴计划，银行信贷投放达到历史天量，向实体经济注入了大量流动性。在政策的拉动下，加之自身的活力，中国经济快速回升，各行业业绩大幅改善。随着经济向好，政府也不断调整支持的方向，下半年，扶持政策重点从上半年的保增长转向调结构。A 股市场随着宏观经济的变化和政策调整方向反复向上。上半年市场热点集中于周期性行业，下半年则在稳定性行业，而新兴产业类个股不时表现出其强劲的上漲能力。总体而言，09 年的市场给予了投资人良好的回报，上证综指上涨 80%，深成指上涨 111%。

年初，我们判断经济最差的时候正在过去，连续的财政、货币扩张政策以及产业扶持政策有利于扭转业绩下滑趋势，因此提高了股票配置比例。由于政策的及时支持，中国经济回升势头稳健，为股市提供了坚实的支撑，基于这样的判断，我们在全年保持相对高的仓位，仅在三季度，出于对政策调整的判断，我们在仓位方面

有一定的变化。

在操作中，根据政策扶持可能产生的投资机会，及之后经济复苏对产业拉动的变化路径，对投资组合进行相机调整。一季度，根据产业政策的导向，主要增加新能源的配置；二季度，随着各国信贷投入的不断投入，以及经济指标的实质性向好，增加资产、资源等板块的配置比例，同时在后期增加对防御类行业如医药、通讯的配置，使得基金表现在三季度相对平稳；四季度，我们认为调结构将成为政策指向的重点，而各类行业的估值水平已经上升，因此增加了对 TMT 行业的配置，同时也增加了低估值的大型蓝筹股的投资比例，但随后而来的流动性收紧使得配置于大型蓝筹股的收益率在四季度后半期表现不佳。

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 1.9394 元，本报告期份额净值增长率为 77.62%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2009 年全球都采用了扩张性的货币政策和财政政策，以期将经济拉出次贷危机的泥潭。到年底，各国的经济都实现了增长，中国 09 年四季度的 GDP 增速达到 10.7%，美国的四季度 GDP 季比折年率达到 5.7%。在这样的经济增长势头下，各国陆续开始退出扩张性的政策。1 月，中国开始调高存款准备金率，2 月，美联储提高贴现率，而在此之前，澳大利亚等一些国家已经开始加息。市场担忧退出政策将导致资金不足，从而对股市产生负面影响。确实，国内 09 年的信贷大量投放在拉动经济的同时也产生一些副作用，如资产价格的大幅上升，因此在 2010 年，防通胀必然成为政府的一个政策出发点，从而收紧信贷投放。但同时可以看到，政府调控的速度超过市场的普遍预期，显示当前政府在政策调控上是具有一定前瞻性的。我们认为政策是经济的内生变量，而不是外生变量，在经济前景并非一片坦途的情况下，政策调控将会是相机抉择，而非只紧缩不放松，而且目前实体经济确实已经好转，从而支持企业的盈利增长，这是股价上涨的最根本动因，因此 2010 年的 A 股市场依然具备投资机会。只是相比 2009 年，结构性特点可能更加突出，我们将主要围绕新兴产业、经济结构调整等方向来寻找投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，公司合规监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、基金运作、基金销售及员工行为的合规性进行定期和不定期检查，强化员工的合规意识，同时推动公司风险控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实。

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 积极配合公司管理层深化“主动合规”的管理理念，落实《合规手册》，规范公司在业务运作、道德规范、反洗钱、利益冲突、客户信息保密、市场营销和客户投诉处理、投资和交易行为等环节的行为；

(2) 落实和完善合规员制度，发挥部门合规员在各部门业务流程的合规控制及风险管理中的作用；

(3) 初步完成了投资交易合规监察系统，实行了投资合规检查的自动化，提高合规监察效率；

(4) 除经常性地组织员工进行法律法规的学习与培训，提高员工的合规意识，还组织投资部门、销售部门进行合规考试，主要内容包括了法律法规、公司的合规政策、合规手册、部门制度、反洗钱规定等；

(5) 组织公司各部门进行业务流程的梳理，进行风险评估；

(6) 聘请外部咨询机构梳理关键投资业务流程，开展投资业务流程标准化，初步完成了标准投资业务流程的编写；

(7) 除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察外，还有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部总经理、风险管理和金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

主要职责包括：证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，负责评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用确定的方法以及采用该方法对相关证券估值后与基金的托管银行进行沟通。

相关人员专业胜任能力及工作经历：

王国卫，首席投资官，研究生学历。曾在上海国际信托投资公司证券投资信托部、投资银行部工作，1998年加入华安基金管理有限公司，曾任华安安信封闭的基金经理、华安180指数增强型基金、基金安久的基金经理，投资总监。现任华安基金管理有限公司首席投资官。

尚志民，基金投资部总经理，工商管理硕士，曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作，进入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，基金投资部总经理。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究

所从事证券研究工作，2000年2月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部总经理，经济学硕士，13年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004年8月加入华安基金管理有限公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安现金富利货币、华安强化收益债券的基金经理、固定收益部总经理。

许之彦，风险管理和金融工程部总经理，理学博士，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，现任华安中国A股增强指数、华安上证180ETF及华安上证180ETF联接的基金经理，风险管理和金融工程部总经理。

朱永红，基金运营部总经理，经济学学士，ACCA英国特许公认会计师公会会员，CPA中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000年10月加入华安基金管理有限公司，现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度

本基金的基金经理尚志民作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

5、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

6、已签约的任何定价服务的性质与程度等信息

无。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金未进行收益分配。

2009年度，将向全体持有人按每10份基金份额收益分配金额6.00元。红利发放的公告日：2010年3月26日，权益登记日：2010年3月31日，除息日：2010年4月1日，红利发放日：2010年4月8日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009年度，托管人在安顺证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应

尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年度，华安基金管理有限公司在安顺证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2009 年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关安顺证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20106 号

安顺证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的安顺证券投资基金（以下简称“基金安顺”）的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是基金安顺的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；
- (2) 选择和运用恰当的会计政策；
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包

括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了基金安顺 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师
马颖旒

中国·上海市
2010 年 3 月 26 日

注册会计师
金毅

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：安顺证券投资基金
报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	5,373,411.23	153,730,181.85
结算备付金		36,612,401.73	4,923,933.95
存出保证金		1,921,236.66	713,666.89
交易性金融资产	7.4.7.2	5,742,161,328.86	3,202,410,784.91
其中：股票投资		4,569,540,010.46	2,516,398,610.41
基金投资		-	-
债券投资		1,172,621,318.40	686,012,174.50
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		33,232,767.23	2,719,152.09
应收利息	7.4.7.5	18,253,871.33	12,498,038.22
应收股利		-	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,837,555,017.04	3,376,995,757.91
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,907,349.93	92,130,784.23
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		7,316,503.63	4,217,457.13
应付托管费		1,219,417.30	702,909.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,842,592.87	3,110,127.41
应交税费		58,900.00	58,900.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,117,000.00	970,000.00
负债合计		19,461,763.73	101,190,178.27
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	7.4.7.10	2,818,093,253.31	275,805,579.64
所有者权益合计		5,818,093,253.31	3,275,805,579.64
负债和所有者权益总计		5,837,555,017.04	3,376,995,757.91

注：1、报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9394 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

7.2 利润表

会计主体：安顺证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009年1月1日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至 2008年12月31日
一、收入		2,656,959,409.18	-2,320,493,105.49
1. 利息收入		34,629,090.61	68,525,726.51
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,824,544.63	8,149,036.83

债券利息收入		30,772,473.81	60,238,506.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		32,072.17	138,183.08
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,579,988,427.18	7,403,122.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,557,778,651.76	-32,253,141.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-3,265,233.99	21,879,517.26
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	279,417.88
股利收益	7.4.7.15	25,475,009.41	17,497,329.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,042,308,874.36	-2,396,472,238.00
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	33,017.03	50,283.14
减：二、费用		114,671,735.51	147,682,323.09
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	71,169,908.07	75,784,267.88
2. 托管费	7.4.10.2.2	11,861,651.46	12,644,206.64
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	30,302,717.28	44,264,813.69
5. 利息支出		852,279.66	8,780,283.34
其中：卖出回购金融资产支出		852,279.66	8,780,283.34
6. 其他费用	7.4.7.19	485,179.04	6,208,751.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,542,287,673.67	-2,468,175,428.58
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,542,287,673.67	-2,468,175,428.58

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：安顺证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	275,805,579.64	3,275,805,579.64
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,542,287,673.67	2,542,287,673.67
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	2,818,093,253.31	5,818,093,253.31
项目	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	6,433,981,008.22	9,433,981,008.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2,468,175,428.58	-2,468,175,428.58
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-3,690,000,000.00	-3,690,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	275,805,579.64	3,275,805,579.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

俞妙根
基金管理人负责人

李炳旺
主管会计工作的负责人

朱永红
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

安顺证券投资基金(以下简称“本基金”)由华安基金管理有限公司、上海国际信托投资公司(后更名为上海国际信托有限公司)、山东证券有限责任公司(后更名为天同证券有限责任公司)和浙江证券有限责任公司(后更名为方正证券有限责任公司)四家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安顺证券投资基金基金契约》(后更名为《安顺证券投资基金基金合同》)发起,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字(1999)15 号文批准,于 1999 年 6 月 15 日募集成立。本基金为契约型封闭式,存续期 15 年,发行规模为 30 亿份基金份额。

本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1999)第 36 号文审核同意,于 1999 年 6 月 22 日在上交所挂牌交易。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和中国证监会证监基金字(1999)15 号文的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中,投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的 80%,投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于 2010 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《安顺证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(i) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(ii) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(i) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(ii) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(iii) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并

自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。

7.4.4.8 损益平准金

不适用。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见相关基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在

日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[1998]55号《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	5,373,411.23	153,730,181.85
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	5,373,411.23	153,730,181.85

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,739,058,953.68	4,569,540,010.46	830,481,056.78
债券	交易所市场	174,489,209.58	176,029,118.40
	银行间市场	994,811,600.00	996,592,200.00
	合计	1,169,300,809.58	1,172,621,318.40
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,908,359,763.26	5,742,161,328.86	833,801,565.60
项目	上年度末 2008 年 12 月 31 日		

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,742,928,923.91	2,516,398,610.41	-226,530,313.50
债券	交易所市场	149,985,649.76	155,883,174.50	5,897,524.74
	银行间市场	518,003,520.00	530,129,000.00	12,125,480.00
	合计	667,989,169.76	686,012,174.50	18,023,004.74
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,410,918,093.67	3,202,410,784.91	-208,507,308.76

注：1. 于 2009 年 12 月 31 日，股票投资余额中无按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票（2008 年 12 月 31 日：1,323,000.00 元，采用该估值技术的股票投资于 2008 年度利润表中确认的公允价值变动损失为 3,529,287.02 元）。

2. 债券投资中银行间同业市场交易债券均按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为 10,344,880.00 元（2008 年度：公允价值变动收益 20,342,044.44 元）。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2009 年 12 月 31 日）及比较报告期末（2008 年 12 月 31 日）衍生金融资产/负债余额均为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2009 年 12 月 31 日）及比较报告期末（2008 年 12 月 31 日）买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2009 年 12 月 31 日）及比较报告期末（2008 年 12 月 31 日）买断式逆回购交易中取得的债券余额均为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	6,451.91	27,054.27
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	60,993.66	48,182.02
应收债券利息	18,186,389.46	12,422,756.33
应收买入返售证券利息	-	-

应收申购款利息	-	-
其他	36.30	45.60
合计	18,253,871.33	12,498,038.22

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,839,617.87	3,103,527.41
银行间市场应付交易费用	2,975.00	6,600.00
合计	4,842,592.87	3,110,127.41

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	750,000.00	750,000.00
应付赎回费	-	-
预提费用	367,000.00	220,000.00
合计	1,117,000.00	970,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00

注：按照《安顺证券投资基金招募说明书》的约定，在本基金存续期间，基金发起人持有的基金份额不得低于基金总规模的 0.5%。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	484,312,888.40	-208,507,308.76	275,805,579.64

本期利润	1,499,978,799.31	1,042,308,874.36	2,542,287,673.67
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,984,291,687.71	833,801,565.60	2,818,093,253.31

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008 年12月31日
活期存款利息收入	173,010.34	4,247,592.23
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	3,651,534.29	3,901,444.60
合计	3,824,544.63	8,149,036.83

7.4.7.12 股票投资收益-买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009 年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008 年12月31日
卖出股票成交总额	10,160,354,496.16	9,302,956,249.47
减：卖出股票成本总额	8,602,575,844.40	9,335,209,391.46
买卖股票差价收入	1,557,778,651.76	-32,253,141.99

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12 月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12 月31日
卖出债券及债券到期兑付成交总额	1,120,016,333.13	5,898,337,101.30
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	1,093,381,503.28	5,778,743,679.47
减：应收利息总额	29,900,063.84	97,713,904.57
债券投资收益	-3,265,233.99	21,879,517.26

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
卖出权证成交总额	-	805,887.35
减：卖出权证成本总额	-	526,469.47
买卖权证差价收入	-	279,417.88

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	25,475,009.41	17,497,329.71
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	25,475,009.41	17,497,329.71

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	1,042,308,874.36	-2,396,472,238.00
——股票投资	1,057,011,370.28	-2,432,364,418.22
——债券投资	-14,702,495.92	35,892,180.22
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	1,042,308,874.36	-2,396,472,238.00

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
印花税手续费返还	25,397.94	50,283.14
其他	7,619.09	-
合计	33,017.03	50,283.14

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	30,293,342.28	44,222,951.19
银行间市场交易费用	9,375.00	41,862.50
合计	30,302,717.28	44,264,813.69

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
审计费用	94,000.00	100,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
红利手续费	-	5,700,000.00
上市年费	60,000.00	60,000.00
银行划款手续费	11,179.04	19,251.54
债券托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
其他	2,000.00	11,500.00
合计	485,179.04	6,208,751.54

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明
7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人拟定的 2009 年度的末期分红为 1,800,000,000.00 元，每 10 份基金份额可获得分配收益 6.00 元，年度总收益分配比例为 90.71%。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人 本基金发起人
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东 本基金发起人
上海电气（集团）总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的原股东（2009 年 11 月 4

	日以前)
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东(自 2009 年 11 月 4 日起)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
方正证券有限责任公司(“方正证券”)	本基金发起人
天同证券有限责任公司(“天同证券”)	本基金发起人

注：根据华安基金管理有限公司于 2009 年 11 月 4 日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监许可[2009]1087 号文批准，公司原股东上海沸点投资发展有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 20% 股权全部转让给国泰君安投资管理股份有限公司。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	71,169,908.07	75,784,267.88
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 \times 1.5% / 当年天数。如持有现金比例高于基金资产净值的 20% (由于卖出回购证券和现金分红的原因造成可以除外)，超出部分不计提基金管理人报酬。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,861,651.46	12,644,206.64

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 \times 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
交通银行	29,844,585.62	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金 额	利息支 出
交通银行	54,652,109.59	159,048,347.24	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

期初持有的基金份额	11,633,800.00	11,633,800.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	11,633,800.00	11,633,800.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.39%	0.39%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年12月31日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例
上海国际信托有限公司	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
方正证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%
天同证券	3,750,000.00	0.13%	3,750,000.00	0.13%

注：以上信息摘自中国证券登记结算有限公司上海分公司提供的截至2009年12月31日安顺证券投资基金持有人名册。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年 12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	5,373,411.23	173,010.34	153,730,181.85	4,247,592.23

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于2009年12月31日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2008年12月31日：同)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内(2009年1月1日至2009年12月31日)和上年度可比期间内(2008年1月1日至2008年12月31日)均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

本基金的基金管理人拟定的 2009 年度的末期分红为 1,800,000,000.00 元，每 10 份基金份额可获得分配收益 6.00 元，年度总收益分配比例为 90.71%。

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009 年 12 月 29 日	2010 年 1 月 7 日	网上新股认购	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
601888	中国国旅	2009 年 9 月 25 日	2010 年 1 月 15 日	网下新股认购	11.78	20.94	89,359	1,052,649.02	1,871,177.46	-
600239	云南城投	2009 年 4 月 14 日	预计 2010 年 4 月 12 日	非公开发行流通受限	15.18	22.79	7,000,000	106,260,000.00	159,530,000.00	-
600239	云南城投	2009 年 6 月 16 日	预计 2010 年 4 月 12 日	非公开发行转增部分	-	22.79	3,500,000	-	79,765,000.00	-
600770	综艺股份	2009 年 12 月 21 日	预计 2010 年 12 月 17 日	非公开发行流通受限	12.00	12.20	1,000,000	12,000,000.00	12,200,000.00	-
000887	中鼎股份	2009 年 2 月 12 日	2010 年 2 月 25 日	非公开发行流通受限	6.16	13.96	5,000,000	30,800,000.00	69,800,000.00	-
000887	中鼎股份	2009 年 6 月 12 日	2010 年 2 月 25 日	非公开发行送股部分	-	13.96	1,000,000	-	13,960,000.00	-
300017	网宿科技	2009 年 10 月 15 日	2010 年 2 月 1 日	网下新股认购	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	-
300037	新宙邦	2009 年 12 月 28 日	2010 年 1 月 8 日	网上新股认购	28.99	28.99	500	14,495.00	14,495.00	-
300041	回天胶业	2009 年 12 月 28 日	2010 年 1 月 8 日	网上新股认购	36.40	36.40	500	18,200.00	18,200.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在

新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型证券投资基金，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。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部等相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理和投资风险、绩效评估等。监察稽核部对公司执行总裁负责，并由督察长分管。风险管理部向分管副总裁和总裁汇报工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资

证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行交通银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2008 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年12月31日	1年以内	1年至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,373,411.23	-	-	-	5,373,411.23
结算备付金	36,612,401.73	-	-	-	36,612,401.73
存出保证金	103,913.63	-	-	1,817,323.03	1,921,236.66
交易性金融资产	719,035,251.30	453,586,067.10	-	4,569,540,010.46	5,742,161,328.86
应收证券清算款	-	-	-	33,232,767.23	33,232,767.23
应收利息	-	-	-	18,253,871.33	18,253,871.33
资产总计	761,124,977.89	453,586,067.10	-	4,622,843,972.05	5,837,555,017.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,907,349.93	4,907,349.93
应付管理人报酬	-	-	-	7,316,503.63	7,316,503.63
应付托管费	-	-	-	1,219,417.30	1,219,417.30
应付交易费用	-	-	-	4,842,592.87	4,842,592.87
应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
其他负债	-	-	-	1,117,000.00	1,117,000.00
负债总计	-	-	-	19,461,763.73	19,461,763.73
利率敏感度缺口	761,124,977.89	453,586,067.10	-	4,603,382,208.32	5,818,093,253.31
上期末 2008年12月31日	1年以内	1年至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	153,730,181.85	-	-	-	153,730,181.85
结算备付金	4,923,933.95	-	-	-	4,923,933.95
存出保证金	101,282.05	-	-	612,384.84	713,666.89
交易性金融资产	326,512,448.00	359,499,726.50	-	2,516,398,610.41	3,202,410,784.91
应收证券清算款	-	-	-	2,719,152.09	2,719,152.09
应收利息	-	-	-	12,498,038.22	12,498,038.22
资产总计	485,267,845.85	359,499,726.50	-	2,532,228,185.56	3,376,995,757.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	92,130,784.23	92,130,784.23
应付管理人报酬	-	-	-	4,217,457.13	4,217,457.13
应付托管费	-	-	-	702,909.50	702,909.50
应付交易费用	-	-	-	3,110,127.41	3,110,127.41
应交税费	-	-	-	58,900.00	58,900.00
其他负债	-	-	-	970,000.00	970,000.00
负债总计	-	-	-	101,190,178.27	101,190,178.27
利率敏感度缺口	485,267,845.85	359,499,726.50	-	2,431,038,007.29	3,275,805,579.64

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：万元）	
		本期末 2009 年 12 月 31 日	上年末 2008 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 50	增加约 148
	市场利率上升 25 个基点	下降约 50	下降约 147

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于股票、债券的比例合计不低于基金资产净值的 80%，投资于国家债券的比例不低于基金资产净值的 20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	4,569,540,010.46	78.54	2,516,398,610.41	76.82

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	4,569,540,010.46	78.54	2,516,398,610.41	76.82

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“中信标普 300 指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：亿元）	
		本期末（2009 年 12 月 31 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	“中信标普 300 指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”上升 5%	增加约 2.54	增加约 1.18
	“中信标普 300 指数×75%+中信标普国债指数×20%+金融同业存款利率×5%”下降 5%	下降约 2.54	下降约 1.18

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,569,540,010.46	78.28
	其中：股票	4,569,540,010.46	78.28
2	固定收益投资	1,172,621,318.40	20.09
	其中：债券	1,172,621,318.40	20.09
	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	41,985,812.96	0.72
6	其他各项资产	53,407,875.22	0.91
7	合计	5,837,555,017.04	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

A	农、林、牧、渔业	63,117,713.10	1.08
B	采掘业	342,829,432.00	5.89
C	制造业	1,804,672,267.02	31.02
C0	食品、饮料	415,227,092.00	7.14
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	179,195,498.58	3.08
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,966,875.55	1.05
C5	电子	60,118,921.00	1.03
C6	金属、非金属	167,570,578.20	2.88
C7	机械、设备、仪表	626,740,625.86	10.77
C8	医药、生物制品	294,852,675.83	5.07
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	231,406,520.00	3.98
F	交通运输、仓储业	244,500.00	0.00
G	信息技术业	179,331,978.24	3.08
H	批发和零售贸易	108,974,057.11	1.87
I	金融、保险业	1,096,892,386.00	18.85
J	房地产业	340,396,922.64	5.85
K	社会服务业	156,399,546.31	2.69
L	传播与文化产业	53,858,061.04	0.93
M	综合类	191,416,627.00	3.29
	合计	4,569,540,010.46	78.54

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600196	复星医药	14,999,909	293,548,219.13	5.05
2	600519	贵州茅台	1,599,000	271,542,180.00	4.67
3	600239	云南城投	10,500,000	239,295,000.00	4.11
4	600036	招商银行	13,199,900	238,258,195.00	4.10
5	601166	兴业银行	5,900,000	237,829,000.00	4.09
6	601318	中国平安	4,199,900	231,372,491.00	3.98
7	601668	中国建筑	48,990,000	231,232,800.00	3.97
8	601398	工商银行	40,000,000	217,600,000.00	3.74
9	601088	中国神华	6,190,000	215,535,800.00	3.70
10	600415	小商品城	3,999,900	178,915,527.00	3.08
11	000718	苏宁环球	12,999,910	178,228,766.10	3.06
12	600588	用友软件	6,399,900	177,021,234.00	3.04

13	601169	北京银行	8,800,000	170,192,000.00	2.93
14	000069	华侨城 A	8,999,905	154,528,368.85	2.66
15	600166	福田汽车	7,770,000	148,018,500.00	2.54
16	600298	安琪酵母	4,789,880	143,217,412.00	2.46
17	600123	兰花科创	2,880,000	125,971,200.00	2.17
18	000651	格力电器	3,999,999	115,759,971.06	1.99
19	600169	太原重工	6,190,000	107,706,000.00	1.85
20	002024	苏宁电器	5,166,600	107,361,948.00	1.85
21	002202	金风科技	3,666,600	105,084,756.00	1.81
22	600162	香江控股	11,399,902	100,547,135.64	1.73
23	600585	海螺水泥	2,000,000	99,720,000.00	1.71
24	000887	中鼎股份	6,000,000	83,760,000.00	1.44
25	000656	ST 东源	4,269,929	67,464,878.20	1.16
26	002152	广电运通	1,989,168	65,344,168.80	1.12
27	002200	绿大地	2,199,990	63,117,713.10	1.08
28	002214	大立科技	2,009,900	59,874,921.00	1.03
29	002215	诺普信	1,888,000	58,509,120.00	1.01
30	600880	博瑞传播	1,999,928	53,858,061.04	0.93
31	600770	综艺股份	1,010,000	12,372,400.00	0.21
32	601888	中国国旅	89,359	1,871,177.46	0.03
33	300017	网宿科技	37,544	1,603,504.24	0.03
34	600016	民生银行	180,000	1,423,800.00	0.02
35	002091	江苏国泰	54,709	1,192,109.11	0.02
36	002292	奥飞动漫	22,752	966,732.48	0.02
37	600309	烟台万华	30,900	741,909.00	0.01
38	000538	云南白药	9,900	597,960.00	0.01
39	000792	盐湖钾肥	10,000	569,900.00	0.01
40	002287	奇正藏药	23,082	557,430.30	0.01
41	600050	中国联通	66,000	481,140.00	0.01
42	000983	西山煤电	10,000	398,900.00	0.01
43	600315	上海家化	10,000	329,000.00	0.01
44	600395	盘江股份	10,000	294,400.00	0.01
45	000157	中联重科	11,000	286,110.00	0.00
46	002251	步步高	10,000	281,200.00	0.00
47	600887	*ST 伊利	10,000	264,800.00	0.00
48	000800	一汽轿车	10,000	260,200.00	0.00
49	002258	利尔化学	10,000	246,000.00	0.00
50	002106	莱宝高科	10,000	244,000.00	0.00
51	601857	中国石油	16,600	229,412.00	0.00
52	600256	广汇股份	10,000	229,000.00	0.00
53	600352	浙江龙盛	19,800	226,116.00	0.00

54	600718	东软集团	10,000	226,100.00	0.00
55	000060	中金岭南	8,000	223,200.00	0.00
56	600000	浦发银行	10,000	216,900.00	0.00
57	600038	哈飞股份	10,000	211,300.00	0.00
58	600195	中牧股份	10,000	202,700.00	0.00
59	601958	金钼股份	10,000	190,600.00	0.00
60	600586	金晶科技	10,000	162,500.00	0.00
61	600523	贵航股份	10,000	160,100.00	0.00
62	002068	黑猫股份	8,800	157,960.00	0.00
63	000826	合加资源	9,979	154,175.55	0.00
64	600475	华光股份	8,000	149,520.00	0.00
65	002294	信立泰	1,680	149,066.40	0.00
66	601919	中国远洋	10,000	139,000.00	0.00
67	000061	农产品	10,000	138,800.00	0.00
68	600895	张江高科	10,000	128,700.00	0.00
69	000402	金融街	9,900	120,087.00	0.00
70	600028	中国石化	8,000	112,720.00	0.00
71	000002	万科A	10,000	108,100.00	0.00
72	600428	中远航运	10,000	105,500.00	0.00
73	002133	广宇集团	10,000	97,600.00	0.00
74	601899	紫金矿业	10,000	96,400.00	0.00
75	601186	中国铁建	10,000	91,400.00	0.00
76	601117	中国北车	14,000	76,020.00	0.00
77	300041	回天胶业	500	18,200.00	0.00
78	300037	新宙邦	500	14,495.00	0.00
79	601390	中国中铁	1,000	6,300.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600585	海螺水泥	393,158,413.36	12.00
2	600036	招商银行	350,945,570.60	10.71
3	600016	民生银行	312,772,423.20	9.55
4	601318	中国平安	312,634,481.41	9.54
5	601169	北京银行	302,081,229.59	9.22
6	601166	兴业银行	290,548,568.03	8.87
7	601668	中国建筑	286,891,648.37	8.76
8	601398	工商银行	285,692,462.81	8.72
9	002024	苏宁电器	245,774,912.71	7.50
10	600519	贵州茅台	244,826,495.13	7.47

11	601088	中国神华	240,805,891.75	7.35
12	600675	中华企业	233,387,431.13	7.12
13	000718	苏宁环球	211,761,651.96	6.46
14	000069	华侨城 A	197,895,167.52	6.04
15	600395	盘江股份	182,078,911.08	5.56
16	600166	福田汽车	181,431,020.43	5.54
17	600030	中信证券	175,442,396.09	5.36
18	600415	小商品城	174,966,383.37	5.34
19	600256	广汇股份	173,939,801.15	5.31
20	600123	兰花科创	163,377,910.19	4.99
21	600586	金晶科技	160,320,814.16	4.89
22	600588	用友软件	145,062,124.55	4.43
23	600196	复星医药	140,692,742.84	4.29
24	600050	中国联通	139,183,992.61	4.25
25	600875	东方电气	131,541,193.58	4.02
26	600195	中牧股份	130,878,046.36	4.00
27	600635	大众公用	120,875,955.73	3.69
28	000651	格力电器	119,452,156.19	3.65
29	600162	香江控股	113,625,670.69	3.47
30	601899	紫金矿业	113,592,657.78	3.47
31	600239	云南城投	106,260,000.00	3.24
32	600028	中国石化	104,864,650.59	3.20
33	600298	安琪酵母	103,244,744.69	3.15
34	600718	东软集团	99,174,335.27	3.03
35	600153	建发股份	93,203,815.80	2.85
36	600000	浦发银行	88,155,202.00	2.69
37	000800	一汽轿车	86,744,178.70	2.65
38	000001	深发展 A	86,476,226.47	2.64
39	601918	国投新集	80,576,192.21	2.46
40	002068	黑猫股份	79,934,257.97	2.44
41	600085	同仁堂	78,914,973.85	2.41
42	000792	盐湖钾肥	77,585,895.11	2.37
43	601857	中国石油	76,521,301.78	2.34
44	000698	沈阳化工	74,455,803.93	2.27
45	000656	ST 东源	71,419,227.02	2.18
46	000090	深天健	71,124,626.53	2.17
47	002133	广宇集团	71,025,571.73	2.17
48	600887	*ST 伊利	69,618,131.42	2.13
49	002152	广电运通	69,421,396.18	2.12
50	601988	中国银行	67,539,713.77	2.06

注：本项“买入金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易

费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600585	海螺水泥	341,760,093.08	10.43
2	600016	民生银行	322,547,080.74	9.85
3	601169	北京银行	312,070,645.71	9.53
4	601166	兴业银行	288,072,580.52	8.79
5	002024	苏宁电器	273,156,332.72	8.34
6	601088	中国神华	273,084,335.61	8.34
7	600036	招商银行	258,912,070.89	7.90
8	600030	中信证券	245,420,788.35	7.49
9	600675	中华企业	231,188,442.75	7.06
10	000698	沈阳化工	229,000,291.89	6.99
11	600256	广汇股份	208,775,295.49	6.37
12	600586	金晶科技	196,980,754.03	6.01
13	600395	盘江股份	188,902,285.46	5.77
14	601398	工商银行	184,412,924.63	5.63
15	600309	烟台万华	179,483,540.69	5.48
16	600895	张江高科	166,960,745.42	5.10
17	601318	中国平安	161,822,942.48	4.94
18	600050	中国联通	153,188,361.52	4.68
19	601899	紫金矿业	151,701,976.79	4.63
20	600875	东方电气	143,191,336.36	4.37
21	600000	浦发银行	138,624,449.04	4.23
22	600887	*ST 伊利	138,118,120.46	4.22
23	600635	大众公用	137,836,940.69	4.21
24	600519	贵州茅台	137,450,215.19	4.20
25	600195	中牧股份	137,330,151.22	4.19
26	600153	建发股份	134,931,181.00	4.12
27	000001	深发展 A	131,510,309.76	4.01
28	002202	金风科技	120,576,272.96	3.68
29	000792	盐湖钾肥	117,207,500.84	3.58
30	000983	西山煤电	115,924,139.76	3.54
31	600718	东软集团	111,923,409.92	3.42
32	600499	科达机电	111,079,395.75	3.39
33	601918	国投新集	103,200,290.30	3.15
34	002068	黑猫股份	100,383,738.72	3.06
35	600028	中国石化	99,400,951.23	3.03
36	601601	中国太保	98,233,225.64	3.00

37	600561	江西长运	92,024,736.59	2.81
38	600649	城投控股	91,714,487.65	2.80
39	600085	同仁堂	91,404,346.72	2.79
40	000800	一汽轿车	90,891,597.48	2.77
41	600475	华光股份	89,470,393.25	2.73
42	000090	深天健	88,759,268.28	2.71
43	600202	哈空调	85,628,937.45	2.61
44	000002	万科A	82,269,583.37	2.51
45	600315	上海家化	79,596,617.64	2.43
46	600266	北京城建	79,261,107.45	2.42
47	000651	格力电器	78,894,197.44	2.41
48	600820	隧道股份	78,535,015.04	2.40
49	601857	中国石油	78,102,367.83	2.38
50	600428	中远航运	77,477,340.62	2.37
51	600271	航天信息	75,479,964.83	2.30
52	002133	广宇集团	72,333,468.44	2.21
53	601988	中国银行	71,959,157.34	2.20
54	600522	中天科技	69,080,626.15	2.11
55	600426	华鲁恒升	68,827,049.37	2.10
56	600415	小商品城	68,345,635.58	2.09
57	600489	中金黄金	68,113,876.12	2.08
58	600166	福田汽车	66,224,617.20	2.02

注：本项“卖出金额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,598,705,874.17
卖出股票收入（成交）总额	10,160,354,496.16

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	176,029,118.40	3.03
2	央行票据	763,747,000.00	13.13
3	金融债券	232,845,200.00	4.00
	其中：政策性金融债	232,845,200.00	4.00

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,172,621,318.40	20.15

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0901042	09 央票 42	1,400,000	137,564,000.00	2.36
2	0901036	09 央票 36	1,200,000	117,948,000.00	2.03
3	0801050	08 央票 50	1,000,000	102,930,000.00	1.77
4	0801044	08 央票 44	1,000,000	102,880,000.00	1.77
5	070401	07 农发 01	700,000	70,049,000.00	1.2

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,921,236.66
2	应收证券清算款	33,232,767.23
3	应收股利	-
4	应收利息	18,253,871.33
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,407,875.22

8.9.4 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债债券。

8.9.5.1 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600239	云南城投	239,295,000.00	4.11	非公开发行股票未上市

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
56,122	53,454.97	1,655,086,833.00	55.17%	1,344,913,167.00	44.83%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	286,641,820.00	9.55%
2	中国人寿保险(集团)公司	282,312,920.00	9.41%
3	太平人寿保险有限公司	120,110,787.00	4.00%
4	宝钢集团有限公司	88,989,466.00	2.97%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	78,625,523.00	2.62%
6	嘉禾人寿保险股份有限公司	62,477,390.00	2.08%
7	新华人寿保险股份有限公司	59,923,929.00	2.00%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	55,735,335.00	1.86%
9	信诚人寿保险有限公司	37,690,537.00	1.26%
10	中国平安保险(集团)股份有限公司	35,687,116.00	1.19%

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本基金管理人重大人事变动如下：

(1) 2009 年 1 月 12 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举陈兵先生担任本公司董事，万才华先生不再担任本公司董事。

(2) 2009 年 2 月 19 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议，选举冯祖新先生担任本公司董事，辜昌基先生不再担任本公司董事。

(3) 2009 年 3 月 27 日，本基金管理人发布关于基金经理调整的公告，汪光成先生不再担任安顺证券投资基金的基金经理。

(4) 2009 年 5 月 16 日，本基金管理人发布关于增聘基金经理助理的公告，增聘陆从珍女士为安顺证券投资基金的基金经理助理。

(5) 2009 年 11 月 17 日，本基金管理人发布关于董事长变更的公告，经本公司董事会会议审议通过，同意徐建国同志辞去本公司董事长职务，并选举俞妙根同志任本公司董事长。俞妙根同志的董事长任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1144 号文核准。在公司总经理招聘工作尚未完成之前，俞妙根同志将兼任公司总经理职务。

(6) 2010 年 1 月 16 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金财产、基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为人民币 94,000 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自 2007 年 6 月 5 日起至今。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
高华证券有限责任公司	1	3,644,666,007.69	18.61%	3,097,945.99	18.79%	-
海通证券股份有限公司	1	2,062,925,712.59	10.53%	1,753,474.20	10.64%	-
中国国际金融有限公司	1	550,675,182.16	2.81%	468,073.28	2.84%	-
中信建投证券有限责任公司	2	2,105,573,257.78	10.75%	1,754,163.23	10.64%	-
招商证券股份有限公司	1	1,359,641,538.19	6.94%	1,104,716.94	6.70%	-
中信证券股份有限公司	2	1,844,997,274.04	9.42%	1,554,028.90	9.43%	-
东方证券股份有限公司	2	4,495,360,496.94	22.95%	3,767,067.31	22.85%	-
申银万国证券股份有限公司	2	1,456,338,401.15	7.44%	1,232,170.62	7.47%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	2,063,754,925.81	10.54%	1,754,179.00	10.64%	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		回购交易	
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例
高华证券有限责任公司	1	128,038,946.50	25.95%	340,000,000.00	22.65%
海通证券股份有限公司	1	64,765,321.70	13.13%	100,000,000.00	6.66%
中国国际金融有限公司	1	8,835,276.50	1.79%	78,000,000.00	5.20%
中信建投证券有限责任公司	2	27,593,804.50	5.59%	130,000,000.00	8.66%
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	26,261,998.80	5.32%	100,000,000.00	6.66%
东方证券股份有限公司	2	68,116,014.30	13.80%	-	-
申银万国证券股份有限公司	2	68,859,560.00	13.95%	500,000,000.00	33.30%
国泰君安证券股份有限公司	1	100,969,306.60	20.46%	253,300,000.00	16.87%

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2. 券商专用交易单元选择程序:

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由研究发展部/市场部分别牵头并组织相关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

研究发展部或基金投资部/市场部汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管副总经理审批

公司分管副总经理对研究发展部或基金投资部/市场部提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元使用协议》，并通知基金托管人。

3. 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况:

无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于恢复旗下基金持有的“盐湖钾肥”股票进行市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009年1月6日
2	关于旗下基金投资太原重工（600169）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009年1月6日
3	关于旗下基金投资中鼎股份（000887）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009年2月14日
4	关于旗下基金投资云南城投（600239）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009年4月16日
5	关于恢复旗下基金持有的“长江电力”股票进行市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009年5月19日
6	关于旗下基金投资创业板股票和可转换债券的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009年9月24日
7	经公司股东会会议审议通过，并经中国证监会	《上海证券报》、《证	2009年11月4

	<p>证监许可[2009]1087 号文核准，本公司原股东上海沸点投资发展有限公司将其持有的本公司 20% 股权全部转让给国泰君安投资管理股份有限公司。</p> <p>此次变更后本公司的股东及持股比例为：上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、国泰君安投资管理股份有限公司分别持有本公司 20% 的股权。</p>	券时报》、《中国证券报》和公司网站	日
8	关于旗下基金投资综艺股份（600770）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009 年 12 月 23 日
9	安顺证券投资基金 2009 年度收益分配公告，向全体持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 6.00 元	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010 年 3 月 26 日

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站 www.huaan.com.cn 上披露。

§ 11 备查文件目录

- 1、《安顺证券投资基金基金合同》
- 2、《安顺证券投资基金招募说明书》
- 3、《安顺证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准安顺证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；
- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、上述文件的存放地点和查阅方式如下：

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>。

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
2010年3月29日