

安顺证券投资基金 2009 年半年度报告

2009 年 6 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

送出日期：2009 年 8 月 28 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。本半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 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 6 月 30 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 主要财务指标和基金净值表现 | 5 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 5 |
| 3.2 基金净值表现..... | 6 |
| § 4 管理人报告 | 7 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 7 |
| 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 | 9 |
| 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 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 10 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 12 |
| § 5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 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 | 12 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| § 7 投资组合报告 | 31 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 31 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合 | 31 |
| 7.3 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 | 32 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 34 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 36 |
| 7.6 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 | 36 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 | 37 |
| 7.8 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 | 37 |
| 7.9 投资组合报告附注..... | 37 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 37 |
| § 9 重大事件揭示 | 38 |
| § 10 备查文件目录 | 42 |

§ 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 |
| 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 |
| 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</p> |

| | |
|--|--|
| | 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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 冯颖 | 张咏东 |
| | 联系电话 | 021-38969999 | 021-68888917 |
| | 电子邮箱 | fengying@huaan.com.cn | zhangyd@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 40088-50099 | 95559 |
| 传真 | | 021-68863414 | 021-58408842 |
| 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 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.huaan.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 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 | 注册登记机构 |
|------|-------------------------|
| 名称 | 中国证券登记结算有限责任公司上海分公司 |
| 办公地址 | 上海市陆家嘴东路 166 号中保大厦 36 楼 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日） |
|---------------|-------------------------------------|
| 本期已实现收益 | 619,223,999.45 |

| | |
|----------------------|----------------------------------|
| 本期利润 | 1,582,751,922.18 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.5276 |
| 本期加权平均净值利润率 | 37.63% |
| 本期基金份额净值增长率 | 48.32% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期(2009年1月1日-2009年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 1,103,536,887.85 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3678 |
| 期末基金资产净值 | 4,858,557,501.82 |
| 期末基金份额净值 | 1.6195 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期(2009年1月1日-2009年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 596.53% |

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 |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
| 过去一个月 | 7.49% | 1.53% | - | - | - | - |
| 过去三个月 | 15.09% | 1.50% | - | - | - | - |
| 过去六个月 | 48.32% | 2.86% | - | - | - | - |
| 过去一年 | 21.27% | 3.51% | - | - | - | - |
| 过去三年 | 163.56% | 3.35% | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 596.53% | 2.60% | - | - | - | - |

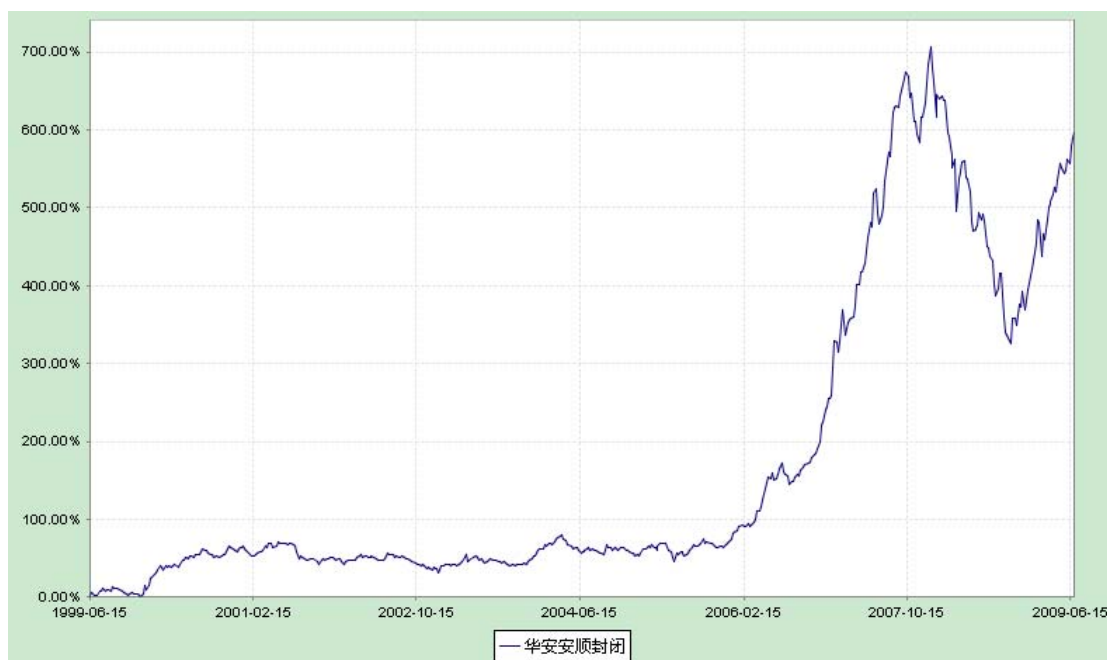
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

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6月30日)



§ 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上海沸点投资发展有限公司。

截至 2009 年 6 月 30 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，华安创新股票、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、华安国际配置(QDII)等 12 只开放式基金，管理资产规模达到 790.62 亿人民币、0.972 亿美元。

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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-----|-------------|------|--------|------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 尚志民 | 本基金 | 2003-9-18 | - | 12年 | 工商管理硕士，12年 |

| | | | | | |
|-----|--------------------------------|-----------|-----------|----|---|
| | 的基金 经理 基 金投资 部总经 理 | | | | 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 | 2008-2-13 | 2009-3-27 | 7年 | 管理学博士，持有基金从业资格证书，7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 | 2009-5-16 | - | 9年 | 经济学硕士，9年证券、基金行业从业经 |

| | | | | |
|--|------|--|--|--|
| | 经理助理 | | | 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合规守信情况的说明

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《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端基金间公平交易管理办法-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《交易端基金间公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金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

按照华安优选股票和华安安顺封闭的基金合同，华安优选股票和华安安顺封闭都是混合型股票基金。09年上半年，华安优选股票净值增长率为50.09%，华安安顺封闭的净值增长率为48.32%，二基金的差异不大。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

上半年没有出现异常交易。

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

2009年上半年，中国经济快速回升，基本走出衰退，恢复较高速度增长，第二季度的GDP增速为7.9%，远远超过一季度的6.1%，已经接近政府制定的年度目标。在经济快速回升的推动下，A股市场上半年表现强劲，上证综指上涨62.53%，深圳成指上涨78.3%。板块轮番表现，前期政策扶持板块表现优异，新能源、4万亿投资相关行业超越市场。之后随着各国央行向市场注入大量流动性、国内经济复苏预期强烈，资产价格膨胀概念一度成为主流，地产、煤炭、有色、金融行情可观。在整个上半年，传统防御性行业，如医药、电力和公用事业等表现持续逊色。

年初，我们判断经济最差的时候可能正在过去，政府也有拉动经济的能力，因此提高了股票配置比例，并在此后一直保持较高的股票仓位。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，对投资组合进行调整，在一季度，根据产业政策的导向，主要增加新能源的配置，效果较为明显，二季度，随着通胀预期的不断提升，以及经济指标的实质性向好，我们增加了资产、资源等板块的配置比例。不过经济复苏的速度和市场的热情依然超出我们的预期，对于更多取决于趋势而非业绩的行业如有色。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为股市向上的根本基础未变，即经济继续向好，三、四季度的GDP增速可能持续上升，使得全年的增长超过政府预订的8%的目标。分部门看，出口可能因为欧美经济触底而有较快回升，从而成为下半年的亮点之一；投资方面，房地产开工面积大幅增加将带动相关产业链公司业绩回升。预计下半年的股市仍然精彩不断，行业分化依然明显。但在指数和个股大幅上涨之后，我们对下半年的市场也将时刻保持警惕。目前的市场对流动性高度依赖，新股发行和货币政策的微调都会对市场资金产生一定的负面影响，我们判断下半年的市场可能不能维持上半年持续上涨的格局，我们将根据政策及市场的变化，及时调整配置，以期给投资者带来良好的回报。

4.6 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本报告期损益的影响

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、固定收益部负责人、金融工程部负责人、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公司，曾任基金安信的基金经理、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，基金安顺、基金安瑞、华安创新基金经理，现任基金安顺、华安宏利的基金经理，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公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部负责人，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公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。

许之彦，金融工程部负责人，理学博士，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 股基金经理，金融工程部负责人。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期暂不进行收益分配。

§ 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 年上半年度，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 年上半年度，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。

5.3 托管人对本半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 年上半年度，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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：安顺证券投资基金

报告截止日：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2009 年 6 月 30 日 | 上年度末 2008 年 12 月 31 日 |
|------|-----|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 银行存款 | 6.4.6.1 | 346,869.45 | 153,730,181.85 |
| 结算备付金 | | 244,615,555.29 | 4,923,933.95 |
| 存出保证金 | | 1,476,415.79 | 713,666.89 |
| 交易性金融资产 | 6.4.6.2 | 4,600,555,131.19 | 3,202,410,784.91 |
| 其中：股票投资 | | 3,611,158,312.69 | 2,516,398,610.41 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 989,396,818.50 | 686,012,174.50 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.6.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.6.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 4,399,960.83 | 2,719,152.09 |
| 应收利息 | 6.4.6.5 | 20,811,477.04 | 12,498,038.22 |
| 应收股利 | | 1,074,060.00 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.6.6 | - | - |
| 资产总计 | | 4,873,279,469.59 | 3,376,995,757.91 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2009年6月30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 | 6.4.6.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 2,562,480.43 | 92,130,784.23 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | 5,767,008.16 | 4,217,457.13 |
| 应付托管费 | 6.4.9.2.2 | 961,168.02 | 702,909.50 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.6.7 | 4,274,304.10 | 3,110,127.41 |
| 应交税费 | | - | 58,900.00 |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.6.8 | 1,157,007.06 | 970,000.00 |
| 负债合计 | | 14,721,967.77 | 101,190,178.27 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.6.9 | 3,000,000,000.00 | 3,000,000,000.00 |
| 未分配利润 | 6.4.6.10 | 1,858,557,501.82 | 275,805,579.64 |
| 所有者权益合计 | | 4,858,557,501.82 | 3,275,805,579.64 |
| 负债和所有者权益总计 | | 4,873,279,469.59 | 3,376,995,757.91 |

注：1、报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6195 元，基金份额总额 3,000,000,000.00 份。

2、后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

6.2 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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日 |
|------------------------|-----------|--|---|
| 一、收入 | | 1,631,864,469.57 | -1,635,879,149.89 |
| 1. 利息收入 | | 16,322,288.49 | 40,683,726.03 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.6.11 | 1,924,282.94 | 5,915,423.17 |
| 债券利息收入 | | 14,398,005.55 | 34,676,386.38 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | 91,916.48 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 652,006,639.26 | 752,104,438.85 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.6.12 | 632,528,947.34 | 740,405,932.01 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.6.13 | -161,700.00 | -4,875,819.12 |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.6.14 | - | 279,417.88 |
| 股利收益 | 6.4.6.15 | 19,639,391.92 | 16,294,908.08 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.6.16 | 963,527,922.73 | -2,428,667,314.77 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.6.17 | 7,619.09 | - |
| 二、费用（以“-”号填列） | | -49,112,547.39 | -101,767,314.05 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.9.2.1 | -30,910,976.65 | -49,287,475.84 |
| 2. 托管费 | 6.4.9.2.2 | -5,151,829.51 | -8,228,074.67 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.6.18 | -12,809,277.36 | -33,838,824.96 |

| | | | |
|---------------------|----------|------------------|-------------------|
| 5. 利息支出 | | - | -8,002,419.69 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | -8,002,419.69 |
| 6. 其他费用 | 6.4.6.19 | -240,463.87 | -2,410,518.89 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,582,751,922.18 | -1,737,646,463.94 |
| 所得税费用（以“-”号填列） | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,582,751,922.18 | -1,737,646,463.94 |

注：后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人：俞妙根 主管会计工作的负责人：李炳旺 会计机构负责人：朱永红

6.3 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 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 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） | - | 1,582,751,922.18 | 1,582,751,922.18 |
| 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（以“-”号填列） | - | - | - |
| 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 | 1,858,557,501.82 | 4,858,557,501.82 |
| 项目 | 上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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 |

| | | | |
|--|------------------|-------------------|-------------------|
| 值) | | | |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -1,737,646,463.94 | -1,737,646,463.94 |
| 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(以“-”号填列) | - | - | - |
| 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 | 1,006,334,544.28 | 4,006,334,544.28 |

注: 后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

基金管理公司负责人: 俞妙根 主管会计工作的负责人: 李炳旺 会计机构负责人: 朱永红

6.4 报表附注

6.4.1 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 2009 年 8 月 27 日批准报出。

6.4.2 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”)、中国证监会基金部通知[2009]4

号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、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基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2009 年上半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 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 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。

(b) 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。

(c) 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。

(d) 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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 346,869.45 |
| 定期存款 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计 | 346,869.45 |

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
| | |

| | | 成本 | 公允价值 | 估值增值 |
|--------|-------|------------------|------------------|----------------|
| 股票 | | 2,864,396,251.66 | 3,611,158,312.69 | 746,762,061.03 |
| 债券 | 交易所市场 | 293,693,395.56 | 296,868,618.50 | 3,175,222.94 |
| | 银行间市场 | 687,444,870.00 | 692,528,200.00 | 5,083,330.00 |
| | 合计 | 981,138,265.56 | 989,396,818.50 | 8,258,552.94 |
| 资产支持证券 | | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - |
| 合计 | | 3,845,534,517.22 | 4,600,555,131.19 | 755,020,613.97 |

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009年6月30日 | | | 备注 |
|--------|-------------------|------|----|----|
| | 合同/名义 金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | - |
| 货币衍生工具 | - | - | - | - |
| 权益衍生工具 | - | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - |

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2009年6月30日）买入返售金融资产余额为零。

6.4.6.4.2 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6月30日）买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 20.91 |
| 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 | 60,621.99 |
| 应收债券利息 | 20,750,801.56 |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 其他 | 32.58 |

| | |
|----|---------------|
| 合计 | 20,811,477.04 |
|----|---------------|

6.4.6.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | - |
| 合计 | - |

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 4,273,354.10 |
| 银行间市场应付交易费用 | 950.00 |
| 合计 | 4,274,304.10 |

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 750,000.00 |
| 预提费用 | 348,107.06 |
| 其他 | 58,900.00 |
| 合计 | 1,157,007.06 |

6.4.6.9 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6月30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 | - | - |
| 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%。

6.4.6.10 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 | 619,223,999.45 | 963,527,922.73 | 1,582,751,922.18 |
| 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 | 1,103,536,887.85 | 755,020,613.97 | 1,858,557,501.82 |

6.4.6.11 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6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 39,684.32 |
| 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 | 1,884,598.62 |
| 其他 | - |
| 合计 | 1,924,282.94 |

6.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009年1月1日至2009年6月30日 |
|----------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 4,402,497,345.57 |
| 卖出股票成本总额 | -3,769,968,398.23 |
| 买卖股票差价收入 | 632,528,947.34 |

6.4.6.13 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6月30日 |
|-----------------|----------------------------|
| 卖出债券及债券到期兑付成交金额 | 50,000,000.00 |
| 卖出债券及债券到期兑付成本总额 | -48,211,700.00 |
| 应收利息总额 | -1,950,000.00 |
| 债券投资收益 | -161,700.00 |

6.4.6.14 衍生工具收益

6.4.6.14.1 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 6 月 30 日 |
| 卖出权证成交金额 | - |
| 卖出权证成本总额 | - |
| 买卖权证差价收入 | - |

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|---------------------------------|
| | 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 19,639,391.92 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 19,639,391.92 |

6.4.6.16 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 6 月 30 日 |
| 1. 交易性金融资产 | 963,527,922.73 |
| ——股票投资 | 973,292,374.53 |
| ——债券投资 | -9,764,451.80 |
| ——资产支持证券投资 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 合计 | 963,527,922.73 |

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----------|---------------------------------|
| | 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 |
| 新股首发失败利息 | 7,619.09 |
| 合计 | 7,619.09 |

注：本项为 002257 立立电子首发失败退还本金所包含的利息。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 |
| 交易所市场交易费用 | 12,807,077.36 |
| 银行间市场交易费用 | 2,200.00 |
| 合计 | 12,809,277.36 |

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 148,765.71 |
| 红利手续费 | - |
| 上市年费 | 29,752.78 |
| 银行划款手续费 | 2,856.81 |
| 债券托管账户维护费 | 9,000.00 |
| 其他 | 500.00 |
| 合计 | 240,463.87 |

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明
6.4.7.1 或有事项

无。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.8 关联方关系
6.4.8.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期关联方关系未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------|--------------------|
| 华安基金管理有限公司 (“华安基金公司”) | 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 |
| 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”)(已清算) | 本基金发起人 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易
6.4.9.1.1 股票交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.9.1.2 权证交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.9.1.3 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 6 月 30 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日)均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|---|
| 当期应支付的管理费 | 30,910,976.65 | 49,287,475.84 |
| 其中：当期已支付 | 25,143,968.49 | 44,190,423.90 |
| 期末未支付 | 5,767,008.16 | 5,097,051.94 |

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 × 1.5% / 当年天数。如持有现金比例高于基金资产净值的 20%，超出部分不计提基金管理人报酬。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日 |
|-----------|--|---|
| 当期应支付的托管费 | 5,151,829.51 | 8,228,074.67 |
| 其中：当期已支付 | 4,190,661.49 | 7,378,566.01 |
| 期末未支付 | 961,168.02 | 849,508.66 |

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 × 0.25% / 当年天数。

6.4.9.3 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 6 月 30 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 6 月 30 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 | - | 109,148,312.31 | - | - | - | - |

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 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 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日 |
|-------------------|---------------------------------------|--|
| | 期初持有的基金份额 | 11,633,800.00 |
| 期间认购总份额 | - | - |
| 期间申购/买入总份额 | - | - |
| 期间因拆分增加的份额 | - | - |
| 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% |

6.4.9.4.2 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 6 月 30 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% |
| 方正证券有限责任公司 | 3,750,000.00 | 0.13% | 3,750,000.00 | 0.13% |

| | | | | |
|-------------------------|--------------|-------|--------------|-------|
| 天同证券有 限责任公司 (已清算) | 3,750,000.00 | 0.13% | 3,750,000.00 | 0.13% |
|-------------------------|--------------|-------|--------------|-------|

注：按照《安顺证券投资基金基金合同》的规定，全部基金发起人认购基金份额的 1%，且在基金存续期间，全部发起人持有的基金份额不得低于基金总规模的 0.5%，其余部分在基金成立之日起一年后后方可流通。

6.4.9.5 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 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 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 | 346,869.45 | 39,684.32 | 138,788,199.34 | 3,592,355.02 |

注：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，按银行同业利率计息。于 2009 年 6 月 30 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)。

6.4.9.6 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 6 月 30 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日)均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况

单位：人民币元

| 序号 | 权益 登记日 | 除息 日 | 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 | 利润分配 合计 | 备注 |
|----|-----------|---------|-------------------|--------------|---------------|------------|----|
| - | - | - | - | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - | - | - | - |

6.4.11 期末(2009 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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

| 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 |
| 000698 | 沈阳化工 | 2008-08-07 | 2009-08-12 | 非公开发 行 | 12.42 | 7.37 | 9,000,000 | 111,780,000.00 | 66,330,000.00 |
| 000698 | 沈阳化工 | 2009-06-03 | 2009-08-12 | 非公开发 行送股转 增部分 | - | 7.37 | 2,700,000 | - | 19,899,000.00 |

| | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|----|---------------------|-------|-------|-----------|----------------|----------------|
| 600169 | 太原重工 | 2008-12-31 | 预计 | 非公开发 行 | 12.67 | 10.76 | 3,000,000 | 38,010,000.00 | 32,280,000.00 |
| 600169 | 太原重工 | 2009-05-25 | 预计 | 非公开发 行送股转 增部分 | - | 10.76 | 1,800,000 | | -19,368,000.00 |
| 600239 | 云南城投 | 2009-04-14 | 预计 | 非公开发 行 | 15.18 | 13.34 | 7,000,000 | 106,260,000.00 | 93,380,000.00 |
| 600239 | 云南城投 | 2009-06-16 | 预计 | 非公开发 行送股转 增部分 | - | 13.34 | 3,500,000 | | -46,690,000.00 |
| 000887 | 中鼎股份 | 2009-02-12 | 预计 | 非公开发 行 | 6.16 | 6.89 | 5,000,000 | 30,800,000.00 | 34,450,000.00 |
| 000887 | 中鼎股份 | 2009-06-12 | 预计 | 非公开发 行送股转 增部分 | - | 6.89 | 1,000,000 | | -6,890,000.00 |

注：1) 本报告期内本基金未持有流通受限债券以及其他证券类别。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

| 股票代码 | 股票名称 | 停牌日期 | 停牌原因 | 期末 估值单价 | 复牌日期 | 复牌 开盘单价 | 数量(股) | 期末 成本总额 | 期末 估值总额 |
|--------|------|-----------|--------|------------|-----------|------------|--------|------------|------------|
| 600849 | 上海医药 | 2009-6-18 | 公告重大事项 | 12.18 | 未知 | 未知 | 60,000 | 295,550.56 | 730,800.00 |
| 000792 | 盐湖钾肥 | 2009-6-26 | 公告重大事项 | 55.14 | 2009-7-27 | 60.65 | 10,000 | 383,689.32 | 551,400.00 |

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2009 年 6 月 30 日止，本基金无债券正回购，因此无债券作为抵押。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

本公司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，因而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，因此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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券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%。

6.4.12.3 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，其余均能及时变现。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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2009年6月30 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 | 346,869.45 | - | - | - | 346,869.45 |
| 结算备付金 | 244,615,555.29 | - | - | - | 244,615,555.29 |
| 存出保证金 | 103,913.63 | - | - | 1,372,502.16 | 1,476,415.79 |
| 交易性金融资产 | 631,969,514.70 | 357,427,303.80 | - | 3,611,158,312.69 | 4,600,555,131.19 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 4,399,960.83 | 4,399,960.83 |
| 应收利息 | - | - | - | 20,811,477.04 | 20,811,477.04 |
| 应收股利 | - | - | - | 1,074,060.00 | 1,074,060.00 |
| 资产总计 | 877,035,853.07 | 357,427,303.80 | | 3,638,816,312.72 | 4,873,279,469.59 |
| 负债 | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 2,562,480.43 | 2,562,480.43 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,767,008.16 | 5,767,008.16 |
| 应付托管费 | - | - | - | 961,168.02 | 961,168.02 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,274,304.10 | 4,274,304.10 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 1,157,007.06 | 1,157,007.06 |

| | | | | | |
|---------------------|----------------|----------------|------|------------------|------------------|
| 负债总计 | - | - | - | 14,721,967.77 | 14,721,967.77 |
| 利率敏感度缺口 | 877,035,853.07 | 357,427,303.80 | - | 3,624,094,344.95 | 4,858,557,501.82 |
| 上年度末 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 |

6.4.12.4.1.2 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6月30日） | 上年度末（2008年12月31日） |
| | 市场利率下降25个基点 | 增加42 | 增加148 |
| | 市场利率上升25个基点 | 下降42 | 下降147 |

6.4.12.4.2 外汇风险

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。

6.4.12.4.3 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。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，及时对风险进行跟踪和控制。

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%。本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2009年6月30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 | 3,611,158,312.69 | 74.33% | 2,516,398,610.41 | 76.82 |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 3,611,158,312.69 | 74.33% | 2,516,398,610.41 | 76.82 |

6.4.12.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | |
|----|--|---------------------------|
| 假设 | 除“中标 300 指数×75%+中信国债指数×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 6 月 30 日） | 上年度末（2008 年 12 月 31 日） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 增加约 1.79 | 增加约 1.18 |
| | 业绩比较基准下降 5% | 下降约 1.74 | 下降约 1.18 |

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
无。

§ 7 投资组合报告

7.1 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 | 3,611,158,312.69 | 74.10 |
| | 其中：股票 | 3,611,158,312.69 | 74.10 |
| 2 | 固定收益投资 | 989,396,818.50 | 20.30 |
| | 其中：债券 | 989,396,818.50 | 20.30 |
| | 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 | 244,962,424.74 | 5.03 |
| 6 | 其他资产 | 27,761,913.66 | 0.57 |
| 7 | 合计 | 4,873,279,469.59 | 100.00 |

7.2 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 | - | - |
| B | 采掘业 | 310,080,279.07 | 6.38 |
| C | 制造业 | 1,457,599,635.66 | 30.00 |
| C0 | 食品、饮料 | 305,325,585.99 | 6.28 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 10,965,000.00 | 0.23 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | 34,366,926.00 | 0.71 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 243,841,790.17 | 5.02 |
| C5 | 电子 | 37,872,111.05 | 0.78 |

| | | | |
|-----|----------------|------------------|-------|
| C6 | 金属、非金属 | 128,779,620.00 | 2.65 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 470,699,729.30 | 9.69 |
| C8 | 医药、生物制品 | 174,800,192.40 | 3.60 |
| C99 | 其他制造业 | 50,948,680.75 | 1.05 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 70,514,512.07 | 1.45 |
| E | 建筑业 | 164,116,043.27 | 3.38 |
| F | 交通运输、仓储业 | 2,303,020.00 | 0.05 |
| G | 信息技术业 | 66,952,788.18 | 1.38 |
| H | 批发和零售贸易 | 258,388,252.35 | 5.32 |
| I | 金融、保险业 | 876,738,532.99 | 18.05 |
| J | 房地产业 | 202,746,224.00 | 4.17 |
| K | 社会服务业 | 235,861.10 | 0.00 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 201,483,164.00 | 4.15 |
| | 合计 | 3,611,158,312.69 | 74.33 |

7.3 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 | 601318 | 中国平安 | 4,799,900 | 237,403,054.00 | 4.89 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 6,290,000 | 233,421,900.00 | 4.80 |
| 3 | 002202 | 金风科技 | 7,119,900 | 214,451,388.00 | 4.41 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 1,180,000 | 174,651,800.00 | 3.59 |
| 5 | 600239 | 云南城投 | 10,500,000 | 140,070,000.00 | 2.88 |
| 6 | 601169 | 北京银行 | 8,180,000 | 133,006,800.00 | 2.74 |
| 7 | 600635 | 大众公用 | 11,190,000 | 131,034,900.00 | 2.70 |
| 8 | 600036 | 招商银行 | 5,807,437 | 130,144,663.17 | 2.68 |
| 9 | 601088 | 中国神华 | 4,199,919 | 125,619,577.29 | 2.59 |
| 10 | 600196 | 复星医药 | 8,190,000 | 118,673,100.00 | 2.44 |
| 11 | 002024 | 苏宁电器 | 6,099,980 | 98,026,678.60 | 2.02 |
| 12 | 000698 | 沈阳化工 | 11,700,000 | 86,229,000.00 | 1.77 |
| 13 | 600585 | 海螺水泥 | 2,000,000 | 84,280,000.00 | 1.73 |
| 14 | 600195 | 中牧股份 | 3,999,189 | 82,183,333.95 | 1.69 |
| 15 | 601899 | 紫金矿业 | 7,990,000 | 81,498,000.00 | 1.68 |
| 16 | 600153 | 建发股份 | 5,999,000 | 81,166,470.00 | 1.67 |
| 17 | 600202 | 哈空调 | 5,519,986 | 78,107,801.90 | 1.61 |
| 18 | 600395 | 盘江股份 | 2,699,980 | 73,196,457.80 | 1.51 |
| 19 | 600415 | 小商品城 | 1,617,600 | 66,548,064.00 | 1.37 |
| 20 | 600315 | 上海家化 | 3,074,997 | 66,266,185.35 | 1.36 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 21 | 601918 | 国投新集 | 3,999,943 | 65,959,060.07 | 1.36 |
| 22 | 000651 | 格力电器 | 2,985,000 | 62,386,500.00 | 1.28 |
| 23 | 600256 | 广汇股份 | 4,000,000 | 61,520,000.00 | 1.27 |
| 24 | 600820 | 隧道股份 | 4,999,900 | 59,448,811.00 | 1.22 |
| 25 | 600266 | 北京城建 | 3,390,000 | 57,697,800.00 | 1.19 |
| 26 | 600522 | 中天科技 | 3,000,000 | 55,950,000.00 | 1.15 |
| 27 | 600016 | 民生银行 | 6,999,970 | 55,439,762.40 | 1.14 |
| 28 | 600479 | 千金药业 | 2,999,988 | 51,899,792.40 | 1.07 |
| 29 | 600169 | 太原重工 | 4,800,000 | 51,648,000.00 | 1.06 |
| 30 | 002215 | 诺普信 | 2,999,998 | 51,509,965.66 | 1.06 |
| 31 | 600496 | 精工钢构 | 5,999,967 | 46,859,742.27 | 0.96 |
| 32 | 600298 | 安琪酵母 | 2,419,908 | 46,123,446.48 | 0.95 |
| 33 | 600000 | 浦发银行 | 2,000,000 | 46,040,000.00 | 0.95 |
| 34 | 600586 | 金晶科技 | 3,190,000 | 42,969,300.00 | 0.88 |
| 35 | 000887 | 中鼎股份 | 6,000,000 | 41,340,000.00 | 0.85 |
| 36 | 601988 | 中国银行 | 9,180,000 | 41,218,200.00 | 0.85 |
| 37 | 600693 | 东百集团 | 4,666,600 | 40,926,082.00 | 0.84 |
| 38 | 002214 | 大立科技 | 2,129,991 | 36,529,345.65 | 0.75 |
| 39 | 000061 | 农产品 | 3,199,900 | 36,414,862.00 | 0.75 |
| 40 | 002258 | 利尔化学 | 1,180,000 | 35,659,600.00 | 0.73 |
| 41 | 600308 | 华泰股份 | 3,199,900 | 34,366,926.00 | 0.71 |
| 42 | 002017 | 东信和平 | 2,999,929 | 34,349,187.05 | 0.71 |
| 43 | 600489 | 中金黄金 | 439,780 | 28,972,706.40 | 0.60 |
| 44 | 000530 | 大冷股份 | 2,109,900 | 18,039,645.00 | 0.37 |
| 45 | 002094 | 青岛金王 | 1,999,939 | 16,599,493.70 | 0.34 |
| 46 | 000726 | 鲁泰A | 1,290,000 | 10,965,000.00 | 0.23 |
| 47 | 600718 | 东软集团 | 300,000 | 5,379,000.00 | 0.11 |
| 48 | 000538 | 云南白药 | 99,900 | 3,496,500.00 | 0.07 |
| 49 | 600588 | 用友软件 | 180,000 | 3,418,200.00 | 0.07 |
| 50 | 600475 | 华光股份 | 180,000 | 3,159,000.00 | 0.07 |
| 51 | 600895 | 张江高科 | 180,000 | 2,788,200.00 | 0.06 |
| 52 | 600900 | 长江电力 | 180,000 | 2,480,400.00 | 0.05 |
| 53 | 600570 | 恒生电子 | 180,000 | 2,158,200.00 | 0.04 |
| 54 | 600309 | 烟台万华 | 130,900 | 2,064,293.00 | 0.04 |
| 55 | 600132 | 重庆啤酒 | 99,900 | 1,974,024.00 | 0.04 |
| 56 | 002091 | 江苏国泰 | 90,009 | 1,597,659.75 | 0.03 |
| 57 | 600516 | 方大炭素 | 80,000 | 1,358,400.00 | 0.03 |
| 58 | 600426 | 华鲁恒升 | 80,000 | 1,310,400.00 | 0.03 |
| 59 | 600649 | 城投控股 | 88,800 | 1,224,552.00 | 0.03 |
| 60 | 600026 | 中海发展 | 90,000 | 1,161,900.00 | 0.02 |
| 61 | 600770 | 综艺股份 | 80,000 | 1,112,000.00 | 0.02 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|--------|--------------|------|
| 62 | 000002 | 万 科 A | 80,000 | 1,020,000.00 | 0.02 |
| 63 | 002123 | 荣信股份 | 34,880 | 1,016,054.40 | 0.02 |
| 64 | 600323 | 南海发展 | 90,000 | 850,500.00 | 0.02 |
| 65 | 600849 | 上海医药 | 60,000 | 730,800.00 | 0.02 |
| 66 | 600561 | 江西长运 | 66,000 | 694,320.00 | 0.01 |
| 67 | 002241 | 歌尔声学 | 49,270 | 690,765.40 | 0.01 |
| 68 | 002008 | 大族激光 | 80,000 | 652,000.00 | 0.01 |
| 69 | 000792 | 盐湖钾肥 | 10,000 | 551,400.00 | 0.01 |
| 70 | 600428 | 中远航运 | 30,000 | 311,100.00 | 0.01 |
| 71 | 000983 | 西山煤电 | 10,000 | 299,000.00 | 0.01 |
| 72 | 002122 | 天马股份 | 10,000 | 282,800.00 | 0.01 |
| 73 | 002251 | 步 步 高 | 10,000 | 256,500.00 | 0.01 |
| 74 | 002220 | 天宝股份 | 12,943 | 244,881.56 | 0.01 |
| 75 | 002210 | 飞马国际 | 26,062 | 235,861.10 | 0.00 |
| 76 | 601857 | 中国石油 | 15,966 | 231,187.68 | 0.00 |
| 77 | 000157 | 中联重科 | 10,000 | 223,300.00 | 0.00 |
| 78 | 601958 | 金钼股份 | 11,026 | 178,069.90 | 0.00 |
| 79 | 000060 | 中金岭南 | 8,000 | 171,920.00 | 0.00 |
| 80 | 600887 | *ST 伊利 | 10,000 | 148,100.00 | 0.00 |
| 81 | 600352 | 浙江龙盛 | 19,800 | 140,778.00 | 0.00 |
| 82 | 000402 | 金 融 街 | 9,900 | 136,224.00 | 0.00 |
| 83 | 601919 | 中国远洋 | 10,000 | 135,700.00 | 0.00 |
| 84 | 000826 | 合加资源 | 9,979 | 110,168.16 | 0.00 |
| 85 | 601186 | 中国铁建 | 10,000 | 102,900.00 | 0.00 |
| 86 | 600028 | 中国石化 | 8,000 | 85,280.00 | 0.00 |
| 87 | 601398 | 工商银行 | 9,900 | 53,658.00 | 0.00 |
| 88 | 600499 | 科达机电 | 4,000 | 45,240.00 | 0.00 |
| 89 | 002261 | 拓维信息 | 1,680 | 42,907.20 | 0.00 |
| 90 | 000001 | 深发展 A | 481 | 10,495.42 | 0.00 |
| 91 | 601390 | 中国中铁 | 1,000 | 6,790.00 | 0.00 |
| 92 | 600271 | 航天信息 | 282 | 4,480.98 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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 | 601318 | 中国平安 | 312,634,481.41 | 9.54 |
| 2 | 600585 | 海螺水泥 | 198,746,993.66 | 6.07 |
| 3 | 600030 | 中信证券 | 175,442,396.09 | 5.36 |
| 4 | 600635 | 大众公用 | 120,875,955.73 | 3.69 |

| | | | | |
|----|--------|------|----------------|------|
| 5 | 600016 | 民生银行 | 115,383,071.88 | 3.52 |
| 6 | 600036 | 招商银行 | 115,092,944.23 | 3.51 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 113,592,657.78 | 3.47 |
| 8 | 600239 | 云南城投 | 106,260,000.00 | 3.24 |
| 9 | 600028 | 中国石化 | 104,864,650.59 | 3.20 |
| 10 | 600195 | 中牧股份 | 93,974,194.87 | 2.87 |
| 11 | 601088 | 中国神华 | 90,642,044.49 | 2.77 |
| 12 | 600586 | 金晶科技 | 89,003,202.64 | 2.72 |
| 13 | 600000 | 浦发银行 | 88,155,202.00 | 2.69 |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 87,222,362.13 | 2.66 |
| 15 | 000001 | 深发展A | 86,476,226.47 | 2.64 |
| 16 | 601166 | 兴业银行 | 79,060,759.86 | 2.41 |
| 17 | 600085 | 同仁堂 | 78,914,973.85 | 2.41 |
| 18 | 000792 | 盐湖钾肥 | 77,585,895.11 | 2.37 |
| 19 | 002024 | 苏宁电器 | 72,927,317.15 | 2.23 |
| 20 | 601169 | 北京银行 | 69,386,119.36 | 2.12 |
| 21 | 600395 | 盘江股份 | 67,236,167.70 | 2.05 |
| 22 | 600153 | 建发股份 | 67,063,493.18 | 2.05 |

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。

7.4.2 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 | 600030 | 中信证券 | 245,420,788.35 | 7.49 |
| 2 | 601088 | 中国神华 | 191,794,295.39 | 5.85 |
| 3 | 600309 | 烟台万华 | 177,143,359.69 | 5.41 |
| 4 | 601398 | 工商银行 | 157,513,069.89 | 4.81 |
| 5 | 600585 | 海螺水泥 | 137,329,013.34 | 4.19 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 132,149,739.48 | 4.03 |
| 7 | 000001 | 深发展A | 131,497,717.18 | 4.01 |
| 8 | 000792 | 盐湖钾肥 | 117,207,500.84 | 3.58 |
| 9 | 000983 | 西山煤电 | 115,924,139.76 | 3.54 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 112,726,350.26 | 3.44 |
| 11 | 600895 | 张江高科 | 111,140,212.57 | 3.39 |
| 12 | 600499 | 科达机电 | 111,031,061.75 | 3.39 |
| 13 | 600028 | 中国石化 | 99,400,951.23 | 3.03 |
| 14 | 601601 | 中国太保 | 98,233,225.64 | 3.00 |
| 15 | 600887 | *ST 伊利 | 97,339,677.45 | 2.97 |
| 16 | 600085 | 同仁堂 | 91,404,346.72 | 2.79 |
| 17 | 600561 | 江西长运 | 91,264,231.59 | 2.79 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 18 | 600649 | 城投控股 | 90,346,489.65 | 2.76 |
| 19 | 600000 | 浦发银行 | 90,334,397.02 | 2.76 |
| 20 | 601169 | 北京银行 | 86,297,888.34 | 2.63 |
| 21 | 000002 | 万科A | 81,540,301.47 | 2.49 |
| 22 | 600428 | 中远航运 | 77,270,444.62 | 2.36 |
| 23 | 600271 | 航天信息 | 75,475,554.35 | 2.30 |
| 24 | 601166 | 兴业银行 | 70,510,489.09 | 2.15 |
| 25 | 600426 | 华鲁恒升 | 67,192,928.87 | 2.05 |

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。

7.4.3 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 | 3,891,435,725.98 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 4,402,497,345.57 |

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。

7.5 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 | 296,868,618.50 | 6.11 |
| 2 | 央行票据 | 458,346,000.00 | 9.43 |
| 3 | 金融债券 | 234,182,200.00 | 4.82 |
| | 其中：政策性金融债 | 234,182,200.00 | 4.82 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 可转债 | - | - |
| 7 | 其他 | - | - |
| 8 | 合计 | 989,396,818.50 | 20.36 |

7.6 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 | 0801050 | 08央票50 | 1,000,000 | 105,020,000.00 | 2.16 |
| 2 | 0801101 | 08央票101 | 1,000,000 | 96,590,000.00 | 1.99 |
| 3 | 0801092 | 08央票92 | 1,000,000 | 96,440,000.00 | 1.98 |
| 4 | 010210 | 02国债(10) | 812,380 | 81,538,580.60 | 1.68 |

| | | | | | |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|
| 5 | 070401 | 07农发01 | 700,000 | 70,630,000.00 | 1.45 |
|---|--------|--------|---------|---------------|------|

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,476,415.79 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,399,960.83 |
| 3 | 应收股利 | 1,074,060.00 |
| 4 | 应收利息 | 20,811,477.04 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 27,761,913.66 |

7.9.4 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明细

7.9.5 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 | 140,070,000.00 | 2.88 | 非公开发行股票未上市 |

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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 |
| 58,677 | 51,127.36 | 1,690,044,900.00 | 56.33% | 1,309,955,100.00 | 43.67% |

8.2 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 | 294,621,441.00 | 9.82% |
| 2 | 中国人寿保险（集团）公司 | 277,312,920.00 | 9.24% |
| 3 | 中国平安保险（集团）股份有限公司 | 111,687,030.00 | 3.72% |
| 4 | 宝钢集团有限公司 | 88,989,466.00 | 2.97% |
| 5 | 太平人寿保险有限公司 | 61,499,998.00 | 2.05% |
| 6 | 新华人寿保险股份有限公司 | 54,025,929.00 | 1.80% |
| 7 | 中国太平洋人寿保险股份有限公司 一分红一个人分红 | 50,625,311.00 | 1.69% |
| 8 | 嘉禾人寿保险股份有限公司 | 48,724,615.00 | 1.62% |
| 9 | 阳光财产保险股份有限公司—自有 资金 | 39,819,214.00 | 1.33% |
| 10 | 瑞士联合银行集团(UBS AG) | 38,685,401.00 | 1.29% |

§ 9 重大事件揭示

9.1 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。

9.2 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，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，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，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和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理，尚志民先生仍然担任上述两只基金的基金经理；刘新勇先生不再担任华安创新证券投资基金的基金经理，由汪光成先生担任该基金的基金经理。

(4)、2009 年 5 月 16 日，关于增聘基金经理的公告。增聘陆从珍女士为安顺证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理，尚志民先生继续担任上述两只基金的基金经理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：无。

9.3 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。

9.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

9.5 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。

9.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内未受到任何处分。

9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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 | 2,224,771,575.11 | 27.27% | 1,891,041.11 | 27.50% | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 1,341,631,669.17 | 16.45% | 1,140,376.51 | 16.58% | - |
| 中国国际金融有限公司 | 1 | 385,277,897.51 | 4.72% | 327,485.44 | 4.76% | - |
| 中信建投证券有限责任公司 | 2 | 816,274,964.12 | 10.01% | 677,240.32 | 9.85% | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | 307,004,333.06 | 3.76% | 249,443.94 | 3.63% | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | 608,421,752.31 | 7.46% | 505,126.29 | 7.35% | - |
| 东方证券股份有限公司 | 2 | 1,144,140,744.03 | 14.03% | 959,447.11 | 13.95% | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2 | 710,154,788.95 | 8.71% | 600,007.62 | 8.72% | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 619,784,217.29 | 7.60% | 526,804.87 | 7.66% | - |

| | | | | | | |
|--------|--|--|--|--|--|--|
| 股份有限公司 | | | | | | |
|--------|--|--|--|--|--|--|

债券、回购及权证交易情况

| 券商名称 | 交易单元数量 | 债券交易 | | 回购交易 | | 权证交易 | |
|--------------|--------|---------------|--------------|------|--------------|------|--------------|
| | | 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 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 高华证券有限责任公司 | 1 | 31,463,761.50 | 21.89% | - | - | - | - |
| 海通证券股份有限公司 | 1 | 39,909,621.70 | 27.77% | - | - | - | - |
| 中国国际金融有限公司 | 1 | 8,835,276.50 | 6.15% | - | - | - | - |
| 中信建投证券有限责任公司 | 2 | 5,031,500.00 | 3.50% | - | - | - | - |
| 招商证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券股份有限公司 | 2 | 29,177,900.00 | 20.30% | - | - | - | - |
| 申银万国证券股份有限公司 | 2 | 9,982,873.40 | 6.95% | - | - | - | - |
| 中银国际证券有限责任公司 | 1 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1 | 19,306,812.70 | 13.43% | - | - | - | - |

注：1. 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：无变更。

9.8 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 | 2009-01-06 |
| 2 | 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 | 2009-01-06 |
| 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 | 2009-02-14 |
| 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 | 2009-4-16 |
| 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 | 2009-5-19 |

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。

§ 10 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
2009 年 8 月 28 日