

安信证券投资基金 2009 年第 4 季度报告

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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 1 月 15 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2009 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	华安安信封闭
基金主代码	500003
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998年6月22日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000份
投资目标	本基金的投资目标是为投资者分散和减少投资风险，确保基金资产的安全，并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	本基金为成长型基金，本基金的证券资产将不低于基金资产总额的80%，其中投资于国债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45-80%，现金比例根据

	运作情况调整。在股票资产中，70%投资于具有良好成长性的上市公司股票。本基金界定的成长型股票主要指主业发展前景良好，在同行业的上市公司中具有较强的竞争优势，财务状况良好，能保持较高的业绩增长，预期收入或利润增长率不低于同期GDP增长率的上市公司股票。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2009年10月1日-2009年12月31日)
1. 本期已实现收益	213,387,571.76
2. 本期利润	436,789,323.75
3. 加权平均基金份额本期利润	0.2184
4. 期末基金资产净值	3,350,474,473.65
5. 期末基金份额净值	1.6752

1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：封闭式基金交易佣金，开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

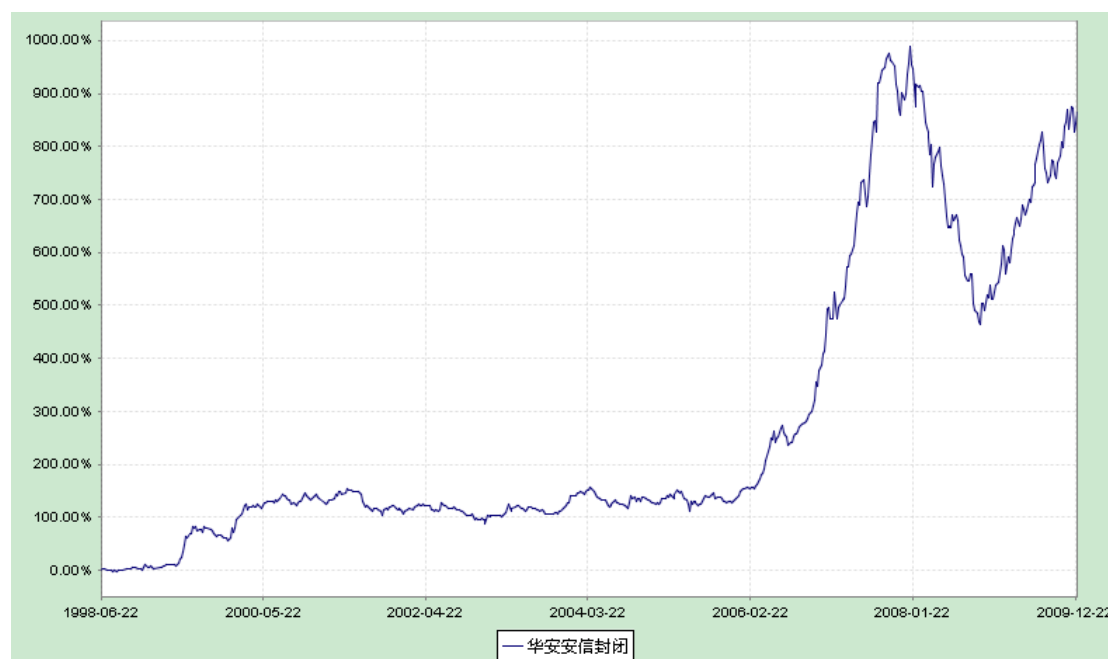
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.99%	2.94%	-	-	-	-

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

安信证券投资基金

累计份额净值增长率历史走势图

(1998 年 6 月 22 日至 2009 年 12 月 31 日)



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈俏宇	本基金的基金经理	2008-2-13	-	13年	工商管理硕士，中国注册会计师协会非执业会员，13年证券、基金从业经历。曾在上海万国证券公司发行部、申银万国证券有限公司国际业务部、上海申银万国证券研究所有限有限公司行业部工作。2003年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部高级研究员、专户理财部投资经理、安顺证券投资基金和华安宏利基金经理助理，2007年3月至2008年2月担任安顺证券投资基金、华安宏利基金经理，2008年2月起担任本基金的基金经理，2008年10月22日起同时担任华安核心优选股票型证券投资基金的基金经理。

- 1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。
- 2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《安信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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司旗下不同基金、包括特定客户账户对同一证券进行交易的业务，均纳入《交易端公平交易管理办法》进行管理。

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金（账户）间公平交易系统模块，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配，实现公平交易。本报告期内，场内业务的公平交易运作良好，未出现异常情况。

对于场外交易，公司制定《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

华安旗下以成长为投资风格的有 3 个基金：华安中小盘成长股票、华安创新混合、基金安信封闭。09 年第四季度，三基金净值增长率分别为：华安中小盘成长股票 17.45%、华安创新混合 14.06%、华安安信封闭 14.99%，三基金的业绩增长率差异未超过 5%。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本季度没有出现异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基于对经济复苏的确认，加之三季度市场已经历了相对充分的调整，挤压了部分乐观预期和估值的泡沫，本基金判断市场将进入震荡上行的阶段，因此在报告期内较前期保持了相对更为积极的股票仓位。另一方面，由于考虑到市场流动性预期已经发生转折，而政府更频繁地推出各项政策，表明经济转型的压力和决心均已超出预期，经济的再平衡与重振增长具备成为中期投资主线的可能。因此本基金在配置上相对更侧重于经济转型和产业整合的板块，主要为医药、信息技

术、二三线地产股和军工等行业。

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 1.6752 元，本报告期份额净值增长率为 14.99%，同期上证综指上涨 17.91%，深圳成指上涨 22.25%。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,609,025,174.93	76.81
	其中：股票	2,609,025,174.93	76.81
2	固定收益投资	698,128,693.80	20.55
	其中：债券	698,128,693.80	20.55
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	72,339,928.22	2.13
6	其他资产	17,441,682.42	0.51
7	合计	3,396,935,479.37	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采掘业	186,617,060.04	5.57
C	制造业	1,234,928,567.21	36.86
C0	食品、饮料	91,937,658.47	2.74
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	72,525,900.00	2.16
C4	石油、化学、塑胶、塑料	133,497,702.17	3.98
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	167,850,591.80	5.01
C7	机械、设备、仪表	417,970,515.94	12.47
C8	医药、生物制品	351,146,198.83	10.48
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	9,440,000.00	0.28
F	交通运输、仓储业	40,843,000.00	1.22
G	信息技术业	337,006,056.55	10.06
H	批发和零售贸易	79,175,550.48	2.36
I	金融、保险业	502,472,386.69	15.00
J	房地产业	102,555,000.00	3.06
K	社会服务业	1,941,767.46	0.06
L	传播与文化产业	24,237,000.00	0.72
M	综合类	89,808,786.50	2.68
	合计	2,609,025,174.93	77.87

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 （%）
1	601169	北京银行	8,500,000	164,390,000.00	4.91
2	600036	招商银行	7,576,053	136,747,756.65	4.08
3	600196	复星医药	6,017,799	117,768,326.43	3.51
4	000651	格力电器	3,650,000	105,631,000.00	3.15
5	600239	云南城投	4,500,000	102,555,000.00	3.06
6	601318	中国平安	1,850,000	101,916,500.00	3.04
7	600570	恒生电子	4,751,661	99,832,397.61	2.98
8	600588	用友软件	3,299,958	91,276,838.28	2.72
9	600585	海螺水泥	1,580,000	78,778,800.00	2.35
10	002024	苏宁电器	3,783,116	78,613,150.48	2.35

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净 值比例（%）
1	国家债券	101,846,693.80	3.04
2	央行票据	250,024,000.00	7.46
3	金融债券	346,258,000.00	10.33
	其中：政策性金融债	346,258,000.00	10.33
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	698,128,693.80	20.84

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 （%）
1	050413	05农发13	600,000	60,324,000.00	1.80
2	0901042	09央票42	600,000	58,956,000.00	1.76
3	080202	08国开02	500,000	52,740,000.00	1.57
4	080216	08国开16	500,000	52,045,000.00	1.55
5	0801044	08央票44	500,000	51,440,000.00	1.54

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

截止本报告期末，本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

截止本报告期末，本基金未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 本报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

5.8.2 本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,811,113.42
2	应收证券清算款	6,835,917.66
3	应收股利	-

4	应收利息	8,794,651.34
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,441,682.42

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

截止本报告期末，本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值(元)	占基金 资产净 值比例 (%)	流通受限情 况说明
1	600239	云南城投	102,555,000.00	3.06	非公开发行 股票未上市

§ 6 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

单位：份

报告期期初管理人持有的封闭式基金份额	14,433,600
报告期期间买入总份额	-
报告期期间卖出总份额	-
报告期期末管理人持有的封闭式基金份额	14,433,600
报告期期末持有的封闭式基金份额占基金总份 额比例（%）	0.72

§ 7 备查文件目录

7.1 备查文件目录

- 1、《安信证券投资基金基金合同》
- 2、《安信证券投资基金招募说明书》
- 3、《安信证券投资基金托管协议》

7.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站
<http://www.huaan.com.cn>。

7.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司
二〇一〇年一月二十一日