

# 安信证券投资基金 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：中国工商银行股份有限公司  
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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 25 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 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>4</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
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.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
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真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>30</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	30
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	30
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.....	31
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	34
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.....	35
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.....	35
7.9 投资组合报告附注.....	35
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>36</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	36
<b>§ 9 重大事件揭示.....</b>	<b>36</b>
9.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	37
9.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
9.4 基金投资策略的改变.....	37
9.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
9.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
9.8 其他重大事件.....	39
<b>§ 10 备查文件目录.....</b>	<b>41</b>

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	安信证券投资基金
基金简称	华安安信封闭
交易代码	500003
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1998 年 6 月 22 日
报告期末基金份额总额	2,000,000,000 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	1998 年 6 月 26 日

### 2.2 基金产品说明

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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	冯颖	蒋松云
	联系电话	021-38969999	010-66105799
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-50099	95588
传真		021-68863414	010-66105798
注册地址		上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	北京市西城区复兴门内大街 55 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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		俞妙根	姜建清

### 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	<a href="http://www.huaan.com.cn">http://www.huaan.com.cn</a>
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

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	184,120,687.56
本期利润	849,992,521.32
加权平均基金份额本期利润	0.4250
本期加权平均净值利润率	30.79%
本期基金份额净值增长率	36.24%
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	422,401,333.67
期末可供分配基金份额利润	0.2112

期末基金资产净值	2,889,716,557.63
期末基金份额净值	1.4449
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期（2009年1月1日-2009年6月30日）</b>
基金份额累计净值增长率	731.96%

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	6.84%	1.92%	-	-	-	-
过去三个月	13.47%	1.79%	-	-	-	-
过去六个月	36.24%	2.62%	-	-	-	-
过去一年	11.01%	3.04%	-	-	-	-
过去三年	125.95%	3.22%	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	731.96%	2.64%	-	-	-	-

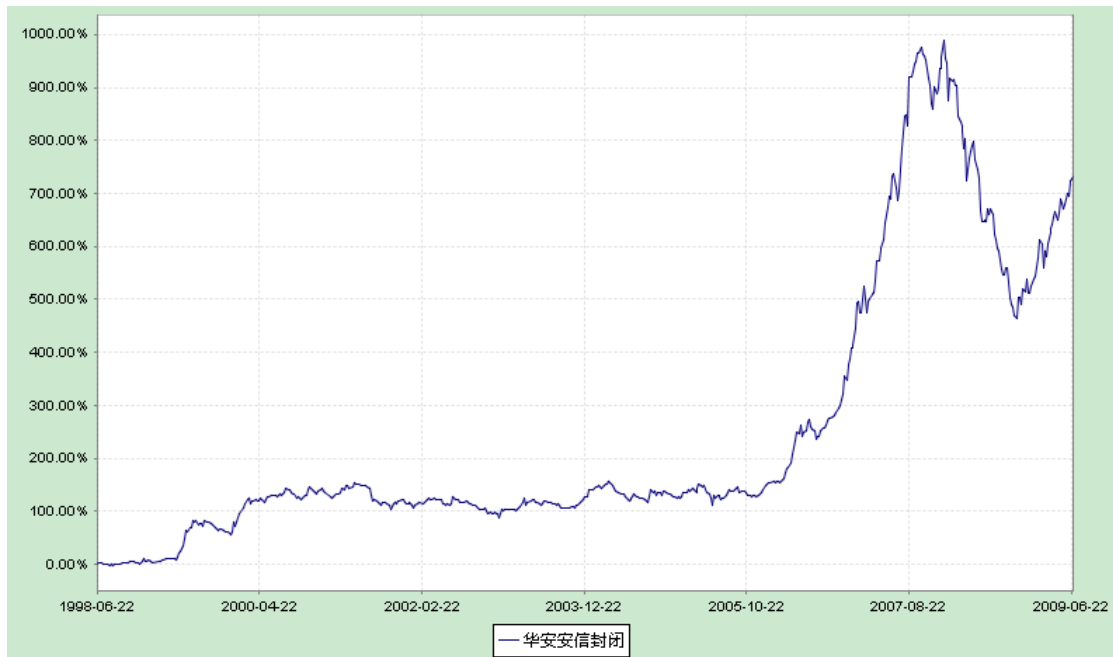
注：本基金合同中没有规定业绩比较基准。

#### 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		
陈俏宇	本基金的基金经理	2008 年 2 月 13 日	-	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。
--	--	--	--	--	---

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 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

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 年上半年，三基金净值增长率分别为：华安中小盘成长股票 56.75%、华安创新混合 30.51%、华安安信封闭 36.24%，华安中小盘成长股票的增长率高于华安创新混合和华安安信封闭。股票仓位的差异是三基金业绩差异较大的主要原因。上半年内，华安中小盘成长股票、华安创新混合和华安安信封闭的股票仓位的比例平均

仓位为 77.68%、60.72%与 70.60%，华安中小盘成长股票的平均持仓比例明显要高于另外两个基金。

#### 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 A 股市场再次成为全球关注焦点。美国次贷引发的全球金融和经济危机带来的悲观情绪在踏入 2009 年的第一个交易日起即一扫而光，在对政府执行力的高度信任和宽松的流动性因素支撑下，A 股市场保持了强劲上扬，沪深 300 指数涨幅接近 75%。此期间内行业和板块热点频现，而其中以通胀预期为背景的资源、资产类板块的上涨最为持续，而传统防御性行业表现则乏善可陈。

本基金在报告期初始阶段对市场的转折性趋势认知不深刻，加之需实施年度分红，股票仓位在分红后才持续保持在较高水平。在行业配置方面，虽在金融、采掘和地产等行业提高了配置比例，但同时由于对经济现状的疑虑，在医药等防御性行业中依然保持了相对较高比例，组合整体表现出进攻不足，防御有余的特征。

#### 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，我们认为下一阶段支持市场持续上涨的因素依然存在，但各因素的影响程度排序将发生变化。一方面，流动性因素虽在较长时间段不可能发生质的转向，但在新股发行开闸、再融资提速，信贷政策微调预期，以及实体经济本身的投资吸引力提升等因素下，证券市场流动性持续超预期可能性减弱。另一方面，对政策的预期将逐步让位于政策影响逐步兑现后的实际效果的观察与判断，部分行业存在惊喜，但部分行业则可能低于目前已膨胀的预期。虽然目前市场依旧以趋势投资的风格为主，但未来企业盈利的实际改善情况和估值的重要性会逐步提升。这一过程也许不是一蹴而就的，但不排除投资风格的逐步转变。

结合安信组合现状，我们下半年的基本操作思路如下：首先，股票仓位保持相对偏高水平，但留有一定余地，以应对宽幅震荡的市场提供的组合调整机会。其次，我们将更多去平衡市场预期与估值因素，尽可能做好风险收益的控制。再者，组合配置方向仍主要基于通胀及相关投资机会。我们并不认为短期内通胀就会发生，但我们无法忽略已经发生的通胀预期，因此组合仍将在泛通胀主题中挖掘机会，但将不仅仅限于市场高度关注的资源、地产类板块，同时包括金融、泛消费服务和低碳经济等经济转型主题的配置。我们相信危机的释放可以在短时间内完成，但危机的真正化解则必须有经济增长模式的转变支持，中国经济才能利用此次全球金融风暴，转危为机，确立更强大的可持续竞争力。

#### 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：

姓名	职务	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：

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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

1、2008 年度在本报告期内实施的利润分配：

向全体持有人按每 10 份基金份额收益分配金额 2.60 元。红利发放的公告日：2009 年 3 月 25 日，权益登记日：2009 年 3 月 30 日，除息日：2009 年 3 月 31 日，红利发放日：2009 年 4 月 7 日。

2、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，本基金托管人在对安信证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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,安信证券投资基金的管理人——华安基金管理有限公司在安信证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,安信证券投资基金对基金份额持有人进行了一次利润分配,分配金额为 520,000,000.00 元。

## 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

本托管人依法对华安基金管理有限公司编制和披露的安信证券投资基金 2009 年半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

## § 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:安信证券投资基金

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
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	111,856,947.82	162,599,380.95
结算备付金		2,854,989.40	1,918,651.57
存出保证金		1,341,288.79	848,780.49
交易性金融资产	6.4.7.2	2,780,403,822.35	2,401,742,590.33
其中:股票投资		2,182,863,012.55	1,504,032,978.53
基金投资		-	-
债券投资		597,540,809.80	897,709,611.80
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		25,719,759.26	-
应收利息	6.4.7.5	12,132,405.87	15,872,397.09
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,047,591.30	-
资产总计		2,935,356,804.79	2,582,981,800.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2009 年 6 月 30 日	2008 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		37,435,706.15	16,080,268.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬	6.4.10.2.1	3,468,765.54	3,297,528.25
应付托管费	6.4.10.2.2	578,127.58	549,588.05
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	2,059,539.02	1,360,379.12
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	2,098,108.87	1,970,000.00
负债合计		45,640,247.16	23,257,764.12
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	6.4.7.10	889,716,557.63	559,724,036.31
所有者权益合计		2,889,716,557.63	2,559,724,036.31
负债和所有者权益总计		2,935,356,804.79	2,582,981,800.43

注：报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4449 元，基金份额总额 2,000,000,000 份。

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：安信证券投资基金

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	上年度可比期间
		2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		882,606,694.29	-1,372,191,996.10
1. 利息收入		11,565,191.31	24,992,571.85
其中：存款利息收入	6.4.7.11	654,075.60	2,957,083.31
债券利息收入		10,911,115.71	21,905,734.90
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	129,753.64
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		205,157,749.07	1,155,067,552.36
其中：股票投资收益	6.4.7.12	178,957,079.71	1,144,495,588.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	14,518,873.50	287,638.54
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	26,462.94
股利收益	6.4.7.15	11,681,795.86	10,257,862.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	665,871,833.76	-2,552,252,120.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	11,920.15	-
<b>二、费用（以“-”号填列）</b>		-32,614,172.97	-72,292,712.67
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	-20,525,508.19	-36,667,249.18
2. 托管费	6.4.10.2.2	-3,420,918.02	-6,111,208.18
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	-7,914,178.53	-22,594,480.53
5. 利息支出		-600.00	-4,930,310.75
其中：卖出回购金融资产支出		-600.00	-4,930,310.75
6. 其他费用	6.4.7.19	-752,968.23	-1,989,464.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		849,992,521.32	-1,444,484,708.77
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		849,992,521.32	-1,444,484,708.77

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：安信证券投资基金

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）	2,000,000,000.00	559,724,036.31	2,559,724,036.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	849,992,521.32	849,992,521.32
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)	-	-520,000,000.00	-520,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	889,716,557.63	2,889,716,557.63
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)	2,000,000,000.00	4,725,978,114.81	6,725,978,114.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,444,484,708.77	-1,444,484,708.77
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)	-	-2,140,000,000.00	-2,140,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	1,141,493,406.04	3,141,493,406.04

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

安信证券投资基金(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)三家发起人依照《证券投资基金管理暂行办法》及其他有关规定和《安信证券投资基金基金契约》(后更名为《安信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(1998)22 号文批准,于 1998 年 6 月 22 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 20 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,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字(1998)第 040 号文审核同意,于 1998 年 6 月 26 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(1998)22 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》、《安信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所列示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 年上半年度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

本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

#### 6.4.6 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》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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 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	111,856,947.82
定期存款	-
其他存款	-
合计	111,856,947.82

##### 6.4.7.2 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	1,721,367,671.76	2,182,863,012.55	461,495,340.79
债券	交易所市场	94,682,006.63	97,059,809.80
	银行间市场	497,038,920.00	500,481,000.00
	合计	591,720,926.63	597,540,809.80
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,313,088,598.39	2,780,403,822.35	467,315,223.96

##### 6.4.7.3 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

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		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	-	-	-	-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2009年6月30日）买入返售金融资产余额为零。

##### 6.4.7.4.2 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6月30日）无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 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	26,830.03
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	899.28
应收债券利息	12,104,645.42
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
其他	31.14
合计	12,132,405.87

#### 6.4.7.6 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	1,047,591.30
合计	1,047,591.30

#### 6.4.7.7 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	2,058,039.02
银行间市场应付交易费用	1,500.00

合计	2,059,539.02
----	--------------

#### 6.4.7.8 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	1,750,000.00
应付赎回费	-
预提费用	348,108.87
合计	2,098,108.87

#### 6.4.7.9 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
本期申购	-	-
本期赎回	-	-
本期末	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00

注：按照《安信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低于基金单位总份额的 1.5%。

#### 6.4.7.10 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	758,280,646.11	-198,556,609.80	559,724,036.31
本期利润	184,120,687.56	665,871,833.76	849,992,521.32
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	-520,000,000.00	-	-520,000,000.00
本期末	422,401,333.67	467,315,223.96	889,716,557.63

#### 6.4.7.11 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6月30日
活期存款利息收入	628,739.62
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	25,335.98

其他	-
合计	654,075.60

**6.4.7.12 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6月30日
卖出股票成交总额	2,669,935,897.18
卖出股票成本总额	-2,490,978,817.47
买卖股票差价收入	178,957,079.71

**6.4.7.13 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6月30日
卖出债券及债券到期兑付成交金额	807,660,734.87
卖出债券及债券到期兑付成本总额	-771,585,409.97
应收利息总额	-21,556,451.40
债券投资收益	14,518,873.50

**6.4.7.14 衍生工具收益**
**6.4.7.14.1 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	-

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
股票投资产生的股利收益	11,681,795.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	11,681,795.86

**6.4.7.16 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6月30日
1. 交易性金融资产	665,871,833.76

——股票投资	694,840,715.59
——债券投资	-28,968,881.83
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	665,871,833.76

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2009年1月1日至2009年6月30日
基金赎回费收入	-
印花税返还收入	11,920.15
合计	11,920.15

#### 6.4.7.18 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	7,908,423.28
银行间市场交易费用	5,755.25
合计	7,914,178.53

#### 6.4.7.19 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	148,767.52
银行汇划费用	2,950.66
上市年费	29,752.78
账户维护费	9,000.00
分红手续费	512,408.70
持有人名册查询费	500.00
合计	752,968.23

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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

本报告期内未发生变化。

##### 6.4.9.2 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	基金管理人、基金发起人
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人
上海国际信托有限公司(“上海国际信托”)	基金管理人的股东、基金发起人
天同证券有限责任公司(已清算)	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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 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。

###### 6.4.10.1.2 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。

###### 6.4.10.1.3 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。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 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	20,525,508.19	36,667,249.18
其中：当期已支付	17,056,742.65	32,621,789.57
期末未支付	3,468,765.54	4,045,459.61

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 X 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。

#### 6.4.10.2.2 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	3,420,918.02	6,111,208.18
其中: 当期已支付	2,842,790.44	5,436,964.92
期末未支付	578,127.58	674,243.26

注: 支付基金托管人中国工商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 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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
中国工商银行 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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
中国工商银行 股份有限公司	48,061,755.74	98,025,885.56	-	-	321,600,000.00	396,493.15

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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	14,433,600	14,433,600
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	14,433,600	14,433,600
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.72%	0.72%

**6.4.10.4.2 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	18,000,000.00	0.90%	18,000,000.00	0.90%
天同证券有限责任公司 (已清算)	6,000,000.00	0.30%	6,000,000.00	0.30%

**6.4.10.5 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
中国工商银行股份有限公司	111,856,947.82	628,739.62	321,452,857.51	2,892,604.99

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2009年1月1日至2009年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日至2008年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股)	总金额
-	-	-	-	-	-

**6.4.11 利润分配情况**
**6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

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
1	2009-3-30	2009-3-31	2.600	520,000,000.00	-	520,000,000.00	2008 年年度分红
合计			2.600	520,000,000.00	-	520,000,000.00	

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

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
600169	太原重工	2008-12-31	预计 2009-12-29	非公开发行	12.67	10.78	1,500,000	19,005,000.00	16,170,000.00
600169	太原重工	2009-5-25	预计 2009-12-29	非公开发行送股转增部分	-	10.78	900,000	-	9,702,000.00
600239	云南城投	2009-4-14	预计 2010-4-12	非公开发行	15.18	13.34	3,000,000	45,540,000.00	40,020,000.00
600239	云南城投	2009-6-16	预计 2010-4-12	非公开发行送股转增部分	-	13.34	1,500,000	-	20,010,000.00

##### 6.4.12.2 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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

##### 6.4.12.3 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金，属于中高风险品种。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。

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之内。

#### 6.4.13.2 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同责任，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中国工商银行，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%。

#### 6.4.13.3 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、组合在短期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同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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 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	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	111,856,947.82	-	-	-	111,856,947.82
结算备付金	2,854,989.40	-	-	-	2,854,989.40
存出保证金	591,288.79	-	-	750,000.00	1,341,288.79
交易性金融资产	198,167,000.00	399,373,809.80	-	2,182,863,012.55	2,780,403,822.35
应收利息	-	-	-	12,132,405.87	12,132,405.87
应收证券清算款	-	-	-	25,719,759.26	25,719,759.26
其他资产	-	-	-	1,047,591.30	1,047,591.30
资产总计	313,470,226.01	399,373,809.80	-	2,222,512,768.98	2,935,356,804.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	37,435,706.15	37,435,706.15

应付管理人报酬	-	-	-	3,468,765.54	3,468,765.54
应付托管费	-	-	-	578,127.58	578,127.58
应付交易费用	-	-	-	2,059,539.02	2,059,539.02
其他负债	-	-	-	2,098,108.87	2,098,108.87
负债总计	-	-	-	45,640,247.16	45,640,247.16
利率敏感度缺口	313,470,226.01	399,373,809.80	-	2,176,872,521.82	2,889,716,557.63
上年度末 2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	162,599,380.95	-	-	-	162,599,380.95
结算备付金	1,918,651.57	-	-	-	1,918,651.57
存出保证金	98,780.49	-	-	750,000.00	848,780.49
交易性金融资产	131,708,108.50	610,846,503.30	155,155,000.00	1,504,032,978.53	2,401,742,590.33
应收利息	-	-	-	15,872,397.09	15,872,397.09
资产总计	296,324,921.51	610,846,503.30	155,155,000.00	1,520,655,375.62	2,582,981,800.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16,080,268.70	16,080,268.70
应付管理人报酬	-	-	-	3,297,528.25	3,297,528.25
应付托管费	-	-	-	549,588.05	549,588.05
应付交易费用	-	-	-	1,360,379.12	1,360,379.12
其他负债	-	-	-	1,970,000.00	1,970,000.00
负债总计	-	-	-	23,257,764.12	23,257,764.12
利率敏感度缺口	296,324,921.51	610,846,503.30	155,155,000.00	1,497,397,611.50	2,559,724,036.31

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者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 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 6 月 30 日)	上年末 (2008 年 12 月 31 日)
	市场利率下降 25 个基点	增加约 65	增加约 945
	市场利率上升 25 个基点	下降约 64	下降约 926

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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%。于 2009 年 6 月 30 日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 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	2,182,863,012.55	75.54%	1,504,032,978.53	58.76%
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,182,863,012.55	75.54%	1,504,032,978.53	58.76%

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“中标 300 指数 X 75%+中信国债指数 X20%+金融同业存款利率 X 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：人民币亿元）	
		本期末 (2009 年 6 月 30 日)	上年末 (2008 年 12 月 31 日)
	“中标 300 指数 X 75%+中信国债指数 X 20%+金融同业存款利率 X 5%” 上升 5%	增加约 0.95	增加约 0.83

“中标 300 指数 X 75%+中信国债指数 X 20%+金融同业存款利率 X 5%” 下降 5%	下降约 0.99	下降约 0.83
--	----------	----------

6.4.14 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	2,182,863,012.55	74.36
	其中：股票	2,182,863,012.55	74.36
2	固定收益投资	597,540,809.80	20.36
	其中：债券	597,540,809.80	20.36
	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	114,711,937.22	3.91
6	其他资产	40,241,045.22	1.37
7	合计	2,935,356,804.79	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	202,101,220.00	6.99
C	制造业	671,699,846.37	23.24
C0	食品、饮料	143,884,921.38	4.98
C1	纺织、服装、皮毛	39,270,000.00	1.36
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	58,987,223.85	2.04
C5	电子	4,653,656.50	0.16
C6	金属、非金属	65,549,754.27	2.27

C7	机械、设备、仪表	203,714,937.20	7.05
C8	医药、生物制品	149,914,353.17	5.19
C99	其他制造业	5,725,000.00	0.20
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	132,873,297.00	4.60
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	104,300,798.76	3.61
H	批发和零售贸易	161,112,515.00	5.58
I	金融、保险业	566,484,497.72	19.60
J	房地产业	151,883,754.64	5.26
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	192,407,083.06	6.66
	合计	2,182,863,012.55	75.54

### 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	601169	北京银行	7,890,000	128,291,400.00	4.44
2	002202	金风科技	3,958,082	119,217,429.84	4.13
3	600000	浦发银行	4,465,986	102,806,997.72	3.56
4	601328	交通银行	9,690,000	87,306,900.00	3.02
5	601318	中国平安	1,690,000	83,587,400.00	2.89
6	600895	张江高科	4,580,000	70,944,200.00	2.46
7	600266	北京城建	4,152,500	70,675,550.00	2.45
8	600739	辽宁成大	2,110,000	69,883,200.00	2.42
9	600239	云南城投	4,500,000	60,030,000.00	2.08
10	600635	大众公用	4,500,000	52,695,000.00	1.82
11	600016	民生银行	6,580,000	52,113,600.00	1.80
12	600196	复星医药	3,312,940	48,004,500.60	1.66
13	000933	神火股份	2,382,850	47,657,000.00	1.65
14	600770	综艺股份	3,380,000	46,982,000.00	1.63
15	600496	精工钢构	5,868,700	45,834,547.00	1.59
16	600395	盘江股份	1,680,000	45,544,800.00	1.58
17	600195	中牧股份	2,199,386	45,197,382.30	1.56
18	002038	双鹭药业	1,339,251	43,324,769.85	1.50
19	601899	紫金矿业	4,157,600	42,407,520.00	1.47
20	600586	金晶科技	3,090,000	41,622,300.00	1.44
21	600519	贵州茅台	280,000	41,442,800.00	1.43
22	600036	招商银行	1,800,000	40,338,000.00	1.40
23	000726	鲁泰A	4,620,000	39,270,000.00	1.36

24	000002	万 科 A	3,000,000	38,250,000.00	1.32
25	002024	苏宁电器	2,380,000	38,246,600.00	1.32
26	601666	平煤股份	1,270,000	36,715,700.00	1.27
27	600475	华光股份	2,000,800	35,114,040.00	1.22
28	600570	恒生电子	2,799,730	33,568,762.70	1.16
29	600486	扬农化工	1,000,000	32,100,000.00	1.11
30	600325	华发股份	1,396,836	31,554,525.24	1.09
31	000839	中信国安	1,990,350	29,337,759.00	1.02
32	1600315	上海家化	1,247,667	26,887,223.85	0.93
33	600169	太原重工	2,400,160	25,874,196.80	0.90
34	600153	建发股份	1,900,000	25,707,000.00	0.89
35	002065	东华软件	1,807,670	25,668,914.00	0.89
36	002233	塔牌集团	1,617,813	23,927,454.27	0.83
37	600600	青岛啤酒	880,700	23,417,813.00	0.81
38	600690	青岛海尔	1,707,856	22,646,170.56	0.78
39	601166	兴业银行	600,000	22,266,000.00	0.77
40	600256	广汇股份	1,433,630	22,049,229.40	0.76
41	000009	中国宝安	1,836,921	21,785,883.06	0.75
42	600132	重庆啤酒	1,098,058	21,697,626.08	0.75
43	600479	千金药业	1,218,878	21,086,589.40	0.73
44	601088	中国神华	700,000	20,937,000.00	0.72
45	600276	恒瑞医药	565,852	19,753,893.32	0.68
46	600837	海通证券	1,100,000	18,095,000.00	0.63
47	000028	一致药业	900,000	17,010,000.00	0.59
48	600970	中材国际	560,000	16,363,200.00	0.57
49	600718	东软集团	877,042	15,725,363.06	0.54
50	601939	建设银行	2,580,000	15,557,400.00	0.54
51	000001	深发展 A	700,000	15,274,000.00	0.53
52	600828	成商集团	700,500	12,209,715.00	0.42
53	000895	双汇发展	336,925	12,129,300.00	0.42
54	000061	农 产 品	850,000	9,673,000.00	0.33
55	601168	西部矿业	580,000	8,839,200.00	0.31
56	002017	东信和平	500,000	5,725,000.00	0.20
57	000759	武汉中百	500,000	4,880,000.00	0.17
58	002214	大立科技	227,910	3,908,656.50	0.14
59	600031	三一重工	30,000	863,100.00	0.03
60	600030	中信证券	30,000	847,800.00	0.03
61	002055	得润电子	100,000	745,000.00	0.03
62	002007	华兰生物	20,000	734,600.00	0.03
63	002251	步 步 高	20,000	513,000.00	0.02

## 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	601601	中国太保	89,863,226.74	3.51
2	600030	中信证券	75,767,335.40	2.96
3	601318	中国平安	64,210,884.22	2.51
4	601899	紫金矿业	59,456,830.38	2.32
5	002202	金风科技	57,281,574.45	2.24
6	601666	平煤股份	56,771,111.68	2.22
7	601168	西部矿业	55,822,655.18	2.18
8	600635	大众公用	53,462,136.83	2.09
9	600266	北京城建	53,038,229.97	2.07
10	600016	民生银行	51,035,023.30	1.99
11	600586	金晶科技	50,022,488.49	1.95
12	600196	复星医药	45,641,971.62	1.78
13	600239	云南城投	45,540,000.00	1.78
14	600001	邯郸钢铁	45,248,565.99	1.77
15	600770	综艺股份	45,114,093.18	1.76
16	000933	神火股份	44,899,586.19	1.75
17	600395	盘江股份	42,364,314.81	1.66
18	600739	辽宁成大	41,900,466.86	1.64
19	000726	鲁泰 A	40,094,755.13	1.57
20	600000	浦发银行	39,293,463.48	1.54

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	601088	中国神华	97,908,921.44	3.82
2	601601	中国太保	89,103,910.93	3.48
3	600030	中信证券	86,044,570.17	3.36
4	600309	烟台万华	74,021,276.50	2.89
5	002007	华兰生物	58,871,261.96	2.30
6	000792	盐湖钾肥	58,049,201.19	2.27
7	600000	浦发银行	57,621,740.37	2.25
8	000002	万科 A	54,696,682.26	2.14
9	600820	隧道股份	53,213,625.54	2.08
10	601168	西部矿业	51,450,604.26	2.01
11	600048	保利地产	51,072,526.67	2.00

12	000001	深发展 A	50,700,916.00	1.98
13	600001	邯郸钢铁	48,298,667.07	1.89
14	600271	航天信息	46,688,605.73	1.82
15	600036	招商银行	44,397,616.65	1.73
16	002109	兴化股份	42,320,124.64	1.65
17	600887	*ST 伊利	39,038,697.41	1.53
18	600068	葛洲坝	37,290,187.46	1.46
19	600028	中国石化	36,360,000.00	1.42
20	601666	平煤股份	36,246,907.00	1.42

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	2,474,968,135.90
卖出股票收入（成交）总额	2,669,935,897.18

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	97,059,809.80	3.36
2	央行票据	139,952,000.00	4.84
3	金融债券	360,529,000.00	12.48
	其中：政策性金融债	360,529,000.00	12.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	597,540,809.80	20.68

#### 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	050413	05 农发 13	600,000	60,858,000.00	2.11
2	080202	08 国开 02	500,000	53,975,000.00	1.87
3	080216	08 国开 16	500,000	53,040,000.00	1.84
4	0801044	08 央票 44	500,000	52,475,000.00	1.82
5	050227	05 国开 27	500,000	50,670,000.00	1.75

### 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，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。

#### 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	1,341,288.79
2	应收证券清算款	25,719,759.26
3	应收股利	-
4	应收利息	12,132,405.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	1,047,591.30
8	其他	-
9	合计	40,241,045.22

#### 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换债券。

#### 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	60,030,000.00	2.08	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
70,459	28,385	1,154,802,720	57.74%	845,197,280	42.26%

### 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	191,042,504	9.55%
2	中国人寿保险(集团)公司	185,982,311	9.30%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	150,768,922	7.54%
4	中国平安保险(集团)股份有限公司	88,099,780	4.40%
5	阳光财产保险股份有限公司—自有资金	48,942,598	2.45%
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	37,977,758	1.90%
7	信诚人寿保险有限公司	35,688,532	1.78%
8	中国太平洋财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品—013C—CT001 沪	27,149,796	1.36%
9	宝钢集团有限公司	26,750,000	1.34%
10	美国友邦保险有限公司上海分公司—传统—普通保险产品	24,584,567	1.23%

## § 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，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。

2、本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：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为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

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。

## 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	
上海证券有限责任公司	1	334,834,908.35	6.57%	284,606.28	6.65%	
中国银河证券股份有限公司	1	378,424,006.38	7.42%	307,475.23	7.18%	
招商证券股份有限公司	1	298,985,709.36	5.86%	254,138.62	5.94%	
申银万国证券股份有限公司	1	132,293,549.75	2.59%	107,489.96	2.51%	
光大证券股份有限公司	1	1,469,526,847.70	28.82%	1,249,088.06	29.18%	

国信证券股份 有限公司	2	1,072,676,790.57	21.04%	895,174.95	20.91%
海通证券股份 有限公司	1	-	-	-	-
国泰君安证券 股份有限公司	1	109,518,544.16	2.15%	93,090.13	2.17%
红塔证券股份 有限公司	1	215,069,188.30	4.22%	182,806.92	4.27%
渤海证券股份 有限公司	1	-	-	-	-
中银国际证券 有限责任公司	1	465,172,800.14	9.12%	377,957.97	8.83%
中国建银投资 证券有限责任 公司	1	622,861,688.37	12.21%	529,428.99	12.37%

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		备注
		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	
上海证券有限责 任公司	1	-	-	-	-	
中国银河证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	
招商证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	
申银万国证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	
光大证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	
国信证券股份有 限公司	2	21,344,626.40	52.12%	-	-	
海通证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	
国泰君安证券股 份有限公司	1	-	-	20,000,000.00	100.00%	
红塔证券股份有 限公司	1	10,237,500.00	25.00%	-	-	
渤海证券股份有 限公司	1	-	-	-	-	
中银国际证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	

中国建银投资证券有限责任公司	1	9,372,217.20	22.88%	-	-
----------------	---	--------------	--------	---	---

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、本报告期内无新增和退租的交易单元。

## 9.8 其他重大事件

(1) 收益分配：

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	安信证券投资基金 2008 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 2.60 元	上海证券报、证券时报、中国证券报、公司网站	[2009-03-25]

## (2) 其他:

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、公司网站	[2009-1-6]
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、公司网站	[2009-1-6]
3	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、公司网站	[2009-4-16]
4	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、公司网站	[2009-5-19]

## § 10 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》
- 4、中国证监会批准安信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