

华安宝利配置证券投资基金 2011 年半年度报告

2011 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

报告送出日期：二〇一一年八月二十九日

1 重要提示及目录

1.1 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。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 2011 年 8 月 22 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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 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.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告.....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	37
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.....	37
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.....	38
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.....	38
7.9 投资组合报告附注.....	38

8 基金份额持有人信息.....	39
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	39
9 开放式基金份额变动.....	39
10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	40
10.4 基金投资策略的改变.....	40
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	40
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8 其他重大事件.....	42
11 备查文件目录.....	44
11.1 备查文件目录.....	44
11.2 存放地点.....	44
11.3 查阅方式.....	44

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华安宝利配置证券投资基金	
基金简称	华安宝利配置混合	
基金主代码	040004	
交易代码	040004(前端)	041004(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年8月24日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,139,465,440.96份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过挖掘存在于各相关证券子市场以及不同金融工具之间的投资机会，灵活配置资产，并充分提高基金资产的使用效率，在实现基金资产保值的基础上获取更高的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场进行定量和定性的分析，采用积极的投资组合策略，保留可控制的风险，规避或降低无法控制的风险，发现和捕捉市场机会以实现基金的投资目标。
业绩比较基准	$35\% \times \text{天相转债指数收益率} + 30\% \times \text{天相280指数收益率} + 30\% \times \text{天相国债全价指数收益率} + 5\% \times \text{金融同业存款利率}$
风险收益特征	本基金面临与其他开放式基金相同的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等)，但上述风险在本基金中存在一定的特殊性。本基金主要面临的风险为：利率风险,政策风险,经济周期风险, 信用风险, 再投资风险, 上市公司经营风险, 新产品创新带来的风险, 购买力风险, 流动性风险, 现金管理风险, 技术风险, 管理风险, 巨额赎回风险等。

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	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话	4008850099	95559	
传真	021-68863414	021-62701216	
注册地址	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 38 楼	上海市浦东新区银城中路 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	上海市浦东新区银城中路 188 号	
邮政编码	200120	200120	
法定代表人	李劼	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	名称	办公地址
注册登记机构	华安基金管理有限公司	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 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 (2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	272,139,004.04
本期利润	55,963,045.70
加权平均基金份额本期利润	0.0166
本期加权平均净值利润率	1.44%
本期基金份额净值增长率	2.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2011 年 6 月 30 日)

期末可供分配利润	375,488,037.09
期末可供分配基金份额利润	0.0907
期末基金资产净值	4,813,715,574.12
期末基金份额净值	1.163
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2011年6月30日)
基金份额累计净值增长率	475.78%

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	2.56%	0.83%	-0.27%	0.47%	2.83%	0.36%
过去三个月	0.26%	0.90%	-1.94%	0.43%	2.20%	0.47%
过去六个月	2.08%	1.09%	-1.48%	0.49%	3.56%	0.60%
过去一年	30.21%	1.19%	8.39%	0.58%	21.82%	0.61%
过去三年	47.52%	1.31%	7.25%	0.86%	40.27%	0.45%
自基金成立起至今	475.78%	1.28%	95.51%	0.90%	380.27%	0.38%

注：本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

根据本基金合同的有关规定，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。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%（其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%）；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。

截至 2011 年 6 月 30 日，本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的比例为 14.87%，其中所对应的基础股票的投资比例为资产净值的 9.56%；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的比例为 21.72%；除可转换债券所对应基础股票

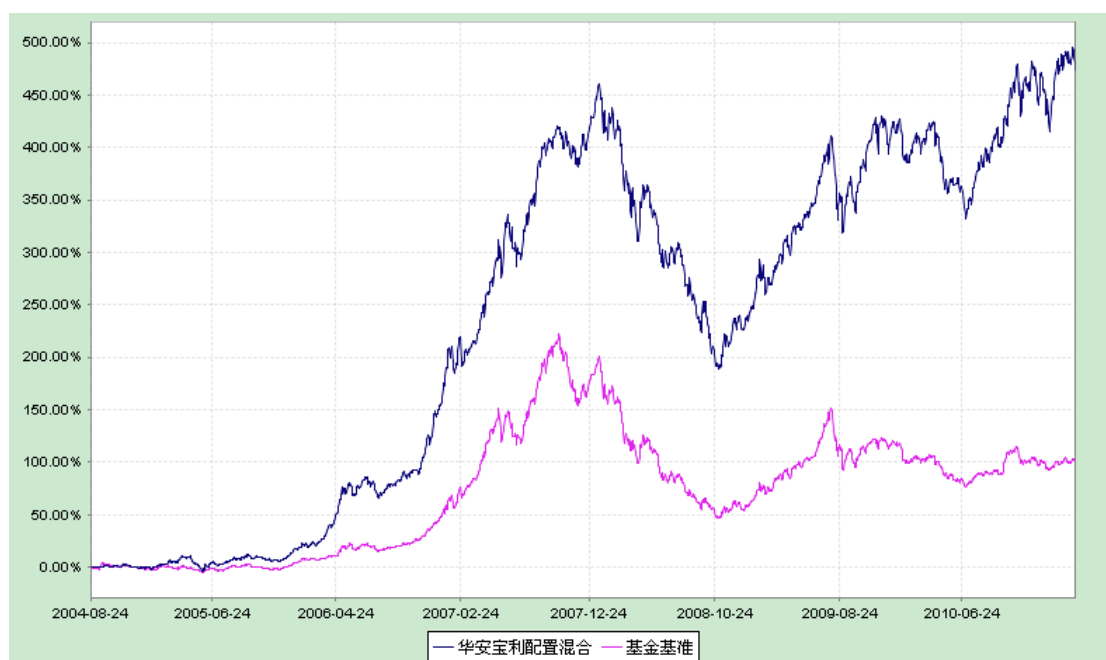
外的其它股票市值占基金资产净值的比例为 59.18%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

华安宝利配置证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2004 年 8 月 24 日至 2011 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国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2011 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，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活混合、华安强化

收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头 ETF、上证龙头 ETF 联接基金、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安大中华升级股票等 22 只开放式基金，管理资产规模达到 755.14 亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
陆从珍	本基金的基金经理	2010年4月21日	-	10年	经济学硕士，10年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商局职员；京华山一证券上海公司高级研究员；中企东方资产管理公司高级研究员；东方证券研究部资深研究员等职。2008年3月加入华安基金管理公司，任研究发展部高级研究员，2009年5月16日起至2010年4月21日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助理，2010年4月起担任本基金的基金经理。

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《华安宝利配置型证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置型证券投资基金招募说明书》等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配，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》等制度对其进行规范，执行情况良好，未出现异常情况。

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

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

华安旗下没有与本基金风格相同的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

货币政策紧缩以及由此带来的经济减速预期等情况是上半年困扰市场的重要因素，央行每月调整准备金率、每两月加息的紧缩步伐，导致资金面愈来愈紧张。企业层面、资本市场都在面对紧缩局面，资金面的紧缩、逐步攀高的通胀数据，使投资者对经济增长的前景开始担忧和谨慎。不过来自不少行业的运行数据如库存、产能利用率以及产品价格数据显示仍有不少行业处于景气较好的状态。上半年市场在紧缩货币环境带来的巨大压力下以及一些行业景气较好形成支撑的双重影响下，上证综指运行在 2800 点左右的较小区间内。主要的可投资标的的基本集中在紧缩货币背景下，景气仍然较好的行业，例如：建材、化工、钢铁、银行等。同时中小市值类公司上半年主要还在消化 2010 年形成的价格泡沫，并逐步下调过高的业绩预期。

上半年，由于对紧缩货币环境所带来的经济减速有所担忧，宝利保持相对低的仓位。同时投资一些行业景气度仍然较高的公司品种。从效果看，化工、钢铁行业的配置有正面贡献，而对银行的配置并没有带来正面贡献。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 6 月 30 日,本基金份额净值为 1.163 元,本报告期份额净值增长率为 2.08%,同期业绩比较基准增长率为-1.48%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年,我们认为通胀在 6、7 月份见顶是大概率事件,通胀不应该成为持续压制市场因素。虽然通胀压力有所下降,但持续的紧缩货币环境对经济的压制作用也将显现。市场预期继续保持震荡走势,自下而上地寻找个股、行业机会是下半年的主要工作。继续以安全性、确定性为主要的选股标准,希望能在低估值品种中寻找业绩确定增长的品种。同时我们将较上半年更加关注成长股的机会,经过半年多的消化价格泡沫和下调业绩预期,不少中小市值个股已经具备投资价值,我们将审视公司估值和成长的匹配性,努力挖掘值得长期持有的成长类型公司。

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、固定收益部总经理、金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

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

相关人员专业胜任能力及工作经历:

尚志民,工商管理硕士,曾在上海证券报研究所、上海证大投资管理有限公司工作,进

入华安基金管理有限公司后曾先后担任公司研究发展部高级研究员，华安安顺封闭、基金安瑞、华安创新混合基金经理，现任华安安顺封闭、华安宏利股票的基金经理，华安基金管理有限公司首席投资官。

李炳旺先生，研究生学历，24 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理有限公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任华安动态灵活配置混合基金经理、研究发展部总经理。

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

许之彦，金融工程部总经理，理学博士，CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股增强指数、华安上证 180ETF 及华安上证 180ETF 联接、华安上证龙头 ETF 和华安上证龙头 ETF 联接的基金经理，金融工程部总经理。

陈林，基金运营部总经理，工商管理硕士，高级会计师，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作，2004 年 11 月加入华安基金管理有限公司，曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理，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、2010 年度在本报告期内实施的利润分配：

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 11 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 14 日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。

2、本报告期末进行收益分配。

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

2011 年上半年度，基金托管人在华安宝利配置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

2011 年上半年度，华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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。本报告期内本基金进行了 1 次收益分配，分配金额为 128,865,459.87 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

2011 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华安宝利配置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：华安宝利配置证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	65,554,378.51	55,525,394.66
结算备付金		191,785,610.77	182,276,867.44
存出保证金		2,399,033.32	2,548,549.57
交易性金融资产	6.4.7.2	4,610,160,728.40	3,111,555,946.97
其中：股票投资		3,308,938,407.56	2,454,557,423.71
基金投资		-	-
债券投资		1,301,222,320.84	656,998,523.26
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		-	47,572,345.12
应收利息	6.4.7.5	12,283,470.96	8,089,154.93
应收股利		1,162,211.54	-
应收申购款		15,052,887.66	4,239,221.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		4,898,398,321.16	3,411,807,480.14
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债	6.4.7.3	-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		67,862,803.16	1,930,641.76
应付赎回款		5,301,209.67	2,776,888.80
应付管理人报酬		4,578,797.69	3,592,807.88
应付托管费		953,916.20	748,501.65
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,945,399.68	4,856,643.01

应交税费		1,335,619.24	1,044,312.60
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	705,001.40	891,473.86
负债合计		84,682,747.04	15,841,269.56
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,139,465,440.96	2,865,251,049.91
未分配利润	6.4.7.10	674,250,133.16	530,715,160.67
所有者权益合计		4,813,715,574.12	3,395,966,210.58
负债和所有者权益总计		4,898,398,321.16	3,411,807,480.14

注：报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.163 元，基金份额总额 4,139,465,440.96 份。

6.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		96,648,067.37	-661,425,134.91
1.利息收入		14,464,018.00	15,260,464.36
其中：存款利息收入	6.4.7.11	2,650,477.57	2,307,104.79
债券利息收入		11,357,082.06	12,614,584.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		456,458.37	338,774.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		297,820,237.30	-124,882,997.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	281,127,793.73	-140,333,390.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,476,206.85	5,254,624.43
资产支持证券投资收 益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	15,216,236.72	10,195,768.46
3.公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	6.4.7.16	-216,175,958.34	-552,360,706.17
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	539,770.41	558,104.07
减: 二、费用		40,685,021.67	45,569,569.09
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	23,020,210.04	25,267,515.57
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,795,877.14	5,264,065.75
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	12,282,051.08	14,988,418.52
5. 利息支出		383,960.40	-158,694.05
其中: 卖出回购金融资产支出		383,960.40	-158,694.05
6. 其他费用	6.4.7.19	202,923.01	208,263.30
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		55,963,045.70	-706,994,704.00
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		55,963,045.70	-706,994,704.00

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 华安宝利配置证券投资基金

本报告期: 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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)	2,865,251,049.91	530,715,160.67	3,395,966,210.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	55,963,045.70	55,963,045.70
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)	1,274,214,391.05	216,437,386.66	1,490,651,777.71
其中: 1. 基金申购款	1,799,989,903.40	308,968,723.59	2,108,958,626.99
2. 基金赎回款	-525,775,512.35	-92,531,336.93	-618,306,849.28
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)	-	-128,865,459.87	-128,865,459.87
五、期末所有者权益(基金净值)	4,139,465,440.96	674,250,133.16	4,813,715,574.12

项目	上年度可比期间		
	2010 年 1 月 1 日至 2010 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）	4,331,460,220.77	440,167,530.72	4,771,627,751.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-706,994,704.00	-706,994,704.00
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）	-266,182,506.22	-20,072,194.20	-286,254,700.42
其中：1. 基金申购款	364,222,338.50	19,409,758.98	383,632,097.48
2. 基金赎回款	-630,404,844.72	-39,481,953.18	-669,886,797.90
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）	4,065,277,714.55	-286,899,367.48	3,778,378,347.07

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：李勍，主管会计工作负责人：李炳旺，会计机构负责人：陈林

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华安宝利配置证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2004]第 97 号《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》核准，由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宝利配置证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,130,461,912.15 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第 161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于 2004 年 8 月 24 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,130,480,770.08 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,857.93 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》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。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为 45%，最低比例为 10%，最高比例为 70%（其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的 20%）；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为 30%，最低比例为 10%，最高比例为 65%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为 20%，最低比例为 10%，最高比例为 65%。本基金的业绩比较基准为：天相转债指数收益率×35%+天相 280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

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 2011 年 8 月 26 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”）、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宝利配置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 2011 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 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 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 本报告期所采取的会计政策、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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期无会计政策和会计估计变更以及差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题

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

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

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 2011年6月30日
活期存款	65,554,378.51
定期存款	-
其他存款	-
合计	65,554,378.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,202,627,929.59	3,308,938,407.56	106,310,477.97	
债券	交易所市场	401,849,716.61	400,280,320.84	-1,569,395.77
	银行间市场	905,629,580.54	900,942,000.00	-4,687,580.54
	合计	1,307,479,297.15	1,301,222,320.84	-6,256,976.31
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,510,107,226.74	4,610,160,728.40	100,053,501.66	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末衍生金融资产/负债余额均为零。

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

本基金本报告期末买断式逆回购交易中取得的债券余额为零。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	20,998.72
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	71,748.92
应收债券利息	12,185,310.90
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	5,370.30
其他	42.12
合计	12,283,470.96

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末其他资产余额为零。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
交易所市场应付交易费用	3,941,775.18
银行间市场应付交易费用	3,624.50
合计	3,945,399.68

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	14,232.60
应付后端申购费	347.75
债券利息税	-
预提费用	190,421.05

银行手续费	-
合计	705,001.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,865,251,049.91	2,865,251,049.91
本期申购	1,799,989,903.40	1,799,989,903.40
本期赎回（以“-”号填列）	-525,775,512.35	-525,775,512.35
本期末	4,139,465,440.96	4,139,465,440.96

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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	137,975,744.46	392,739,416.21	530,715,160.67
本期利润	272,139,004.04	-216,175,958.34	55,963,045.70
本期基金份额交易产生的变动数	94,238,748.46	122,198,638.20	216,437,386.66
其中：基金申购款	125,737,726.35	183,230,997.24	308,968,723.59
基金赎回款	-31,498,977.89	-61,032,359.04	-92,531,336.93
本期已分配利润	-128,865,459.87	-	-128,865,459.87
本期末	375,488,037.09	298,762,096.07	674,250,133.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
	活期存款利息收入
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	2,151,482.82
其他	77,993.14
合计	2,650,477.57

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日

卖出股票成交总额	3,780,322,043.17
减：卖出股票成本总额	3,499,194,249.44
买卖股票差价收入	281,127,793.73

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	302,363,183.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	295,779,028.97
减：应收利息总额	5,107,947.90
债券投资收益	1,476,206.85

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,216,236.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,216,236.72

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1. 交易性金融资产	-216,175,958.34
——股票投资	-205,649,534.73
——债券投资	-10,526,423.61
——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	-216,175,958.34

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	539,770.41
合计	539,770.41

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由赎回费和申购费补差两部分构成，其中赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	12,278,851.08
银行间市场交易费用	3,200.00
合计	12,282,051.08

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	51,572.33
信息披露费	138,848.72
银行汇划费用	3,501.96
帐户维护费	9,000.00
合计	202,923.01

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（“华安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金代销机构

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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 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（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2010 年 1 月 1 日至 2010 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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,020,210.04	25,267,515.57
其中：支付销售机构的客户 维护费	4,098,406.26	4,262,990.25

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 1.2% 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 × 1.2% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托 管费	4,795,877.14	5,264,065.75

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。

6.4.10.3 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 2011年1月1日至2011年6月30日						
银行间市场 交易的各关	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

关联方名称						
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	150,128,100.00	-	400,000,000.00	20,175.34	100,000,000.00	36,273.97

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 2011年1月1日至2011年6月 30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
期初持有的基金份额	126,400,201.90	126,400,201.90
期间申购/买入总份额	5,301,033.62	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	131,701,235.52	126,400,201.90
期末持有的基金份额占基金 总份额比例	3.18%	3.11%

注：本期增加的份额为红利转再投资。

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

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方无投资本基金的情况。

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 2011年1月1日至2011年6月30日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	65,554,378.51	421,001.61	29,119,855.15	308,045.82

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 2011 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(2010 年 6 月 30 日：同)。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期和上年度可比期间均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

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	2011-01-14	2011-01-14	0.45	65,131,229.16	63,734,230.71	128,865,459.87	-
合计	-	-	0.45	65,131,229.16	63,734,230.71	128,865,459.87	-

6.4.12 期末（2011 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	备 注
601566	九牧王	2011-5-23	预计 2011-8-30	网下认 购新股	22.00	21.61	1,337,047	29,415,034.00	28,893,585.67	-
601798	蓝科高 新	2011-6-14	预计 2011-9-22	网下认 购新股	11.00	13.27	66,211	728,321.00	878,619.97	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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	备 注
600170	上海建工	2011-6-29	资产重组	15.59	2011-7-4	16.25	1,275,641	18,920,281.35	19,887,243.19	-

注：本基金截至 2010 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券
6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2011 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的

债券。

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配置型证券投资基金，属于偏低风险品种。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，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险和收益高于保本基金而低于平衡型基金，谋求稳定和可持续的绝对收益”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。而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特征通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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

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

方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。于 2011 年 6 月 30 日,本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 9.12%(2010 年 12 月 31 日: 13.77%)。

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面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。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

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

除卖出回购金融资产款到期日为一个半月以内且计息外,本基金所持有的其他金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011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	65,554,378.51	-	-	-	65,554,378.51
结算备付金	191,785,610.77	-	-	-	191,785,610.77
存出保证金	2,399,033.32	-	-	-	2,399,033.32
交易性金融资产	1,082,740,285.54	159,115,200.00	59,366,835.30	3,308,938,407.56	4,610,160,728.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息				12,283,470.96	12,283,470.96
应收股利				1,162,211.54	1,162,211.54
应收申购款	9,322,882.65			5,730,005.01	15,052,887.66
资产总计	1,351,802,190.79	159,115,200.00	59,366,835.30	3,328,114,095.07	4,898,398,321.16
负债					
应付证券清算款	-	-	-	67,862,803.16	67,862,803.16
应付赎回款				5,301,209.67	5,301,209.67
应付管理人报酬				4,578,797.69	4,578,797.69
应付托管费				953,916.20	953,916.20
应付交易费用				3,945,399.68	3,945,399.68
应交税金				1,335,619.24	1,335,619.24
其他负债				705,001.40	705,001.40

负债总计	-	-	-	84,682,747.04	84,682,747.04
利率敏感度缺口	1,351,802,190.79	159,115,200.00	59,366,835.30	3,243,431,348.03	4,813,715,574.12
上年度末2010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	55,525,394.66	-	-	-	55,525,394.66
结算备付金	182,276,867.44	-	-	-	182,276,867.44
存出保证金	103,913.63	-	-	2,444,635.94	2,548,549.57
交易性金融资产	169,917,000.00	133,183,194.16	353,898,329.10	2,454,557,423.71	3,111,555,946.97
应收证券清算款	-	-	-	47,572,345.12	47,572,345.12
应收利息	-	-	-	8,089,154.93	8,089,154.93
应收申购款	3,624,379.67	-	-	614,841.78	4,239,221.45
资产总计	411,447,555.40	133,183,194.16	353,898,329.10	2,513,278,401.48	3,411,807,480.14
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,930,641.76	1,930,641.76
应付赎回款	-	-	-	2,776,888.80	2,776,888.80
应付管理人报酬	-	-	-	3,592,807.88	3,592,807.88
应付托管费	-	-	-	748,501.65	748,501.65
应付交易费用	-	-	-	4,856,643.01	4,856,643.01
应交税费	-	-	-	1,044,312.60	1,044,312.60
其他负债	-	-	-	891,473.86	891,473.86
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	15,841,269.56	15,841,269.56
利率敏感度缺口	411,447,555.40	133,183,194.16	353,898,329.10	2,497,437,131.92	3,395,966,210.58

注：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：人民币）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率上升25个基点	减少约226万元	减少约23万元
市场利率下降25个基点	增加约226万元	增加约23万元	

6.4.13.4.2 外汇风险

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

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汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中可转换债券及其对应的基础股票投资比例为基金资产净值的 10%-70%，除可转换债券外的其它债券投资比例为基金资产净值的 10%-65%，除可转换债券所对应基础股票外的其它股票投资比例为基金资产净值的 10%-65%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2011年6月30日		上年度末 2010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	3,308,938,407.56	68.74	2,454,557,423.71	72.28
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,308,938,407.56	68.74	2,454,557,423.71	72.28

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）	
		本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约9,134万元	增加约24,993万元
	业绩比较基准下降5%	减少约9,134万元	减少约24,993万元

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	3,308,938,407.56	67.55
	其中：股票	3,308,938,407.56	67.55
2	固定收益投资	1,301,222,320.84	26.56
	其中：债券	1,301,222,320.84	26.56
	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	257,339,989.28	5.25
6	其他各项资产	30,897,603.48	0.63
7	合计	4,898,398,321.16	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	35,550,000.00	0.74
B	采掘业	121,075,500.00	2.52
C	制造业	1,978,264,396.79	41.10
C0	食品、饮料	203,415,987.60	4.23
C1	纺织、服装、皮毛	80,776,084.65	1.68
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	118,551,758.30	2.46
C4	石油、化学、塑胶、塑料	650,473,519.41	13.51
C5	电子	123,327,223.92	2.56
C6	金属、非金属	276,598,641.50	5.75
C7	机械、设备、仪表	285,062,165.41	5.92
C8	医药、生物制品	240,059,016.00	4.99
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	111,902,640.64	2.32
E	建筑业	120,520,243.19	2.50
F	交通运输、仓储业	15,680,000.00	0.33
G	信息技术业	231,294,421.81	4.80
H	批发和零售贸易	145,056,471.70	3.01
I	金融、保险业	363,339,000.00	7.55
J	房地产业	179,721,597.91	3.73
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	6,534,135.52	0.14
	合计	3,308,938,407.56	68.74

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	600160	巨化股份	7,665,600	248,825,376.00	5.17

2	600636	三爱富	5,467,400	194,256,722.00	4.04
3	000858	五 粮 液	4,300,000	153,596,000.00	3.19
4	601166	兴业银行	10,000,000	134,800,000.00	2.80
5	000629	攀钢钒钛	8,932,950	98,887,756.50	2.05
6	600000	浦发银行	10,000,000	98,400,000.00	2.04
7	000983	西山煤电	3,990,000	96,558,000.00	2.01
8	000002	万 科 A	11,199,037	94,631,862.65	1.97
9	600963	岳阳林纸	11,000,000	94,160,000.00	1.96
10	002161	远 望 谷	3,800,000	85,234,000.00	1.77
11	600970	中材国际	3,100,000	84,723,000.00	1.76
12	600104	上海汽车	4,500,000	84,330,000.00	1.75
13	600153	建发股份	8,670,053	77,163,471.70	1.60
14	000999	华润三九	4,290,000	77,005,500.00	1.60
15	000401	冀东水泥	3,000,000	74,970,000.00	1.56
16	600362	江西铜业	2,100,000	74,424,000.00	1.55
17	002024	苏宁电器	5,300,000	67,893,000.00	1.41
18	601918	国投新集	5,551,204	67,502,640.64	1.40
19	600036	招商银行	5,000,000	65,100,000.00	1.35
20	600383	金地集团	10,000,000	64,100,000.00	1.33
21	600570	恒生电子	4,236,963	62,876,530.92	1.31
22	601988	中国银行	20,000,000	62,800,000.00	1.30
23	000887	中鼎股份	4,500,000	58,365,000.00	1.21
24	601607	上海医药	3,323,870	55,841,016.00	1.16
25	002020	京新药业	2,700,000	51,975,000.00	1.08
26	002595	豪迈科技	1,980,000	49,579,200.00	1.03
27	600295	鄂尔多斯	2,428,362	46,843,102.98	0.97
28	600795	国电电力	15,000,000	44,400,000.00	0.92
29	600426	华鲁恒升	2,420,950	40,914,055.00	0.85
30	002304	洋河股份	305,485	38,539,987.60	0.80
31	002073	软控股份	1,863,418	38,386,410.80	0.80
32	000623	吉林敖东	1,200,000	36,972,000.00	0.77
33	002092	中泰化学	2,662,793	34,935,844.16	0.73
34	002152	广电运通	1,100,000	33,913,000.00	0.70
35	002250	联化科技	1,055,053	33,603,438.05	0.70
36	002475	立讯精密	881,550	31,788,693.00	0.66
37	600108	亚盛集团	5,000,000	30,350,000.00	0.63
38	601566	九牧王	1,337,047	28,893,585.67	0.60
39	002484	江海股份	1,199,410	28,557,952.10	0.59
40	002415	海康威视	639,900	25,141,671.00	0.52
41	600460	士兰微	1,450,759	24,648,395.41	0.51
42	002155	辰州矿业	750,000	24,517,500.00	0.51

43	002117	东港股份	1,305,070	24,391,758.30	0.51
44	000063	中兴通讯	856,164	24,212,317.92	0.50
45	300182	捷成股份	669,999	23,389,665.09	0.49
46	002123	荣信股份	1,000,000	22,780,000.00	0.47
47	601766	中国南车	3,165,033	22,535,034.96	0.47
48	002061	江山化工	1,621,300	21,741,633.00	0.45
49	600150	中国船舶	272,772	20,182,400.28	0.42
50	600170	上海建工	1,275,641	19,887,243.19	0.41
51	300010	立思辰	1,200,000	16,092,000.00	0.33
52	600502	安徽水利	1,000,000	15,910,000.00	0.33
53	600029	南方航空	2,000,000	15,680,000.00	0.33
54	300136	信维通信	710,313	13,190,512.41	0.27
55	002417	三元达	908,953	13,107,102.26	0.27
56	000932	华菱钢铁	3,000,000	12,330,000.00	0.26
57	002324	普利特	769,306	11,693,451.20	0.24
58	000568	泸州老窖	250,000	11,280,000.00	0.23
59	000718	苏宁环球	1,200,378	9,603,024.00	0.20
60	600741	华域汽车	799,380	8,897,099.40	0.18
61	002541	鸿路钢构	205,200	8,269,560.00	0.17
62	000778	新兴铸管	731,500	7,717,325.00	0.16
63	000402	金融街	1,000,000	7,470,000.00	0.16
64	002007	华兰生物	200,000	6,788,000.00	0.14
65	600518	康美药业	500,000	6,580,000.00	0.14
66	600770	综艺股份	345,356	6,534,135.52	0.14
67	300044	赛为智能	401,182	6,382,805.62	0.13
68	600078	澄星股份	600,000	6,138,000.00	0.13
69	000998	隆平高科	200,000	5,200,000.00	0.11
70	002327	富安娜	120,100	5,039,396.00	0.10
71	600976	武汉健民	250,000	4,897,500.00	0.10
72	600325	华发股份	349,083	3,916,711.26	0.08
73	601601	中国太保	100,000	2,239,000.00	0.05
74	300090	盛运股份	200,000	2,162,000.00	0.04
75	300105	龙源技术	30,000	1,418,400.00	0.03
76	601798	蓝科高新	66,211	878,619.97	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	600636	三爱富	273,562,536.83	8.06
2	601166	兴业银行	173,013,950.68	5.09
3	600000	浦发银行	160,066,608.87	4.71
4	600963	岳阳林纸	159,506,863.14	4.70
5	000401	冀东水泥	143,917,117.51	4.24
6	600068	葛洲坝	142,218,644.69	4.19
7	000629	攀钢钒钛	141,080,436.54	4.15
8	000983	西山煤电	140,992,265.28	4.15
9	000002	万科A	131,601,125.63	3.88
10	000858	五粮液	109,835,292.21	3.23
11	600153	建发股份	99,313,589.63	2.92
12	600970	中材国际	96,646,123.73	2.85
13	601398	工商银行	91,936,269.75	2.71
14	600795	国电电力	84,740,983.30	2.50
15	601988	中国银行	84,620,000.00	2.49
16	000709	河北钢铁	83,374,435.36	2.46
17	600362	江西铜业	81,502,609.33	2.40
18	600036	招商银行	70,248,612.75	2.07
19	600383	金地集团	63,650,100.33	1.87
20	600019	宝钢股份	59,830,628.78	1.76

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	600068	葛洲坝	301,732,605.03	8.89
2	600636	三爱富	198,538,956.86	5.85
3	601601	中国太保	148,745,664.02	4.38
4	000858	五粮液	140,732,038.52	4.14
5	600160	巨化股份	125,084,931.97	3.68
6	000630	铜陵有色	106,100,454.52	3.12
7	601398	工商银行	96,613,618.83	2.84
8	000709	河北钢铁	96,605,216.35	2.84
9	600739	辽宁成大	90,219,053.86	2.66
10	600104	上海汽车	81,983,596.60	2.41
11	600288	大恒科技	72,728,791.67	2.14
12	601989	中国重工	72,162,576.45	2.12
13	601607	上海医药	69,883,751.32	2.06
14	000063	中兴通讯	66,451,105.07	1.96

15	000401	冀东水泥	62,998,920.44	1.86
16	600071	凤凰光学	61,473,563.71	1.81
17	000887	中鼎股份	61,210,904.82	1.80
18	600000	浦发银行	59,742,248.40	1.76
19	600970	中材国际	59,519,440.96	1.75
20	600019	宝钢股份	56,563,981.80	1.67

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,559,224,768.02
卖出股票的收入（成交）总额	3,780,322,043.17

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	49,882,000.00	1.04
2	央行票据	782,742,000.00	16.26
3	金融债券	29,412,000.00	0.61
-	其中：政策性金融债	29,412,000.00	0.61
4	企业债券	189,070,035.30	3.93
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	250,116,285.54	5.20
8	其他	-	-
9	合计	1,301,222,320.84	27.03

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	1101027	11 央票 27	2,500,000	248,100,000.00	5.15
2	1101023	11 央票 23	2,000,000	198,500,000.00	4.12
3	1101025	11 央票 25	1,200,000	119,088,000.00	2.47
4	1101029	11 央票 29	800,000	79,384,000.00	1.65

5	1001080	10 央票 80	800,000	78,120,000.00	1.62
---	---------	----------	---------	---------------	------

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 2011年5月27日，五粮液收到中国证监会的《行政处罚决定书》。本基金投资该股票的决策程序符合相关法律法规的要求。报告期内，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、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 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,399,033.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,162,211.54
4	应收利息	12,283,470.96
5	应收申购款	15,052,887.66
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,897,603.48

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113002	工行转债	70,306,021.50	1.46
2	113001	中行转债	68,627,000.00	1.43
3	125709	唐钢转债	27,646,009.90	0.57
4	110007	博汇转债	5,612,500.00	0.12

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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
228,006	18,155.07	1,119,909,513.31	27.05%	3,019,555,927.65	72.95%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,162,417.24	0.03%

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年8月24日)基金份额总额	1,130,480,770.08
本报告期期初基金份额总额	2,865,251,049.91
本报告期基金总申购份额	1,799,989,903.40
减：本报告期基金总赎回份额	525,775,512.35
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	4,139,465,440.96

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券股份有限公司	1	3,123,106,427.57	37.72%	2,537,545.34	36.67%	-
红塔证券股份有限公司	1	2,437,018,474.69	29.44%	2,071,454.43	29.93%	-
渤海证券股份有限公司	1	1,973,555,682.53	23.84%	1,677,511.04	24.24%	-

长城证券有 限责任公司	1	343,609,941.81	4.15%	292,067.32	4.22%	-
兴业证券股 份有限公司	1	327,147,774.48	3.95%	278,071.42	4.02%	-
中信证券股 份有限公司	1	74,853,225.01	0.90%	63,624.37	0.92%	-
中银国际证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
申银万国证 券股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券有限责任 公司	1	-	-	-	-	-

注:1.本报告期本基金无新增交易单元。

2.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。

3.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

由研究发展部或基金投资部/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《证券交易单元租用协议》, 并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期	成交金额	占当期回	成交金额	占当期

		债券成交总额的比例		购成交总额的比例		权证成交总额的比例
海通证券股份有限公司	8,263,638.50	2.94%	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	168,987,851.00	60.22%	169,000,000.00	21.98%	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	300,000,000.00	39.01%	-	-
长城证券有限责任公司	21,552,508.80	7.68%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	81,803,740.90	29.15%	300,000,000.00	39.01%	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于参加深圳发展银行股份有限公司基金定期定额投资、网上银行及电话银行申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-1-4
2	关于参加中国邮政储蓄银行有限责任公司网上申购基金费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-1-4
3	华安宝利配置证券投资基金分红公告，向基金持有人按每 10 份基金份额派发现金红利 0.45 元。	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-1-11
4	关于参加温州银行股份有限公司个人网上	《上海证券报》、	2011-1-31

	银行基金申购费率优惠活动的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
5	关于新增浙商证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-1-31
6	关于新增财达证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-2-14
7	关于旗下基金持有的“上海汽车”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-2-19
8	关于旗下基金在天相投资顾问有限公司开通定投业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-3-10
9	关于新增哈尔滨银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-3-21
10	关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-3-31
11	关于旗下基金持有的“上海汽车”股票恢复按市价估值的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-4-8
12	关于新增民生证券有限责任公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-4-11
13	关于参加华夏银行-盈基金 2011 网上银行基金申购 4 折优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-4-18
14	关于新增浙江稠州商业银行股份有限公司为基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-4-18
15	关于新增烟台银行股份有限公司为开放式	《上海证券报》、	2011-4-23

	基金代销机构的公告	《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	
16	关于华安基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-6-30
17	关于新增大连银行股份有限公司为开放式基金代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2011-6-30

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》
- 2、《华安宝利配置证券投资基金招募说明书》
- 3、《华安宝利配置证券投资基金托管协议》
- 4、中国证监会批准华安宝利配置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、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则

11.2 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>。

11.3 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
二〇一一年八月二十九日