华安宝利配置证券投资基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：华安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 14 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。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 1
1.1 重要提示 1
§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 4
2.4 信息披露方式 5
2.5 其他相关资料 5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 5
3.1 主要会计数据和财务指标 5
3.2 基金净值表现 6
3.3 过去三年基金的利润分配情况 8
§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遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 14
§5 托管人报告 14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 14
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 14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 14
§6 审计报告 14
6.1 管理层对财务报表的责任 14
6.2 注册会计师的责任 15
6.3 审计意见 15
§7 年度财务报表 15
7.1 资产负债表 15
7.2 利润表 17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 18
7.4 报表附注 20
§8 投资组合报告 39
8.1 期末基金资产组合情况 39
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 39
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 42
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 43
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 44
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 44

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细 44
8.9 投资组合报告附注 44
§9 基金份额持有人信息 45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 45
§10 开放式基金份额变动 46
§11 重大事件揭示 46
11.1 基金份额持有人大会决议 46
11.2 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 46
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 46
11.4 基金投资策略的改变 47
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 47
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 47
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 47
11.8 其他重大事件 49
§12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

§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	2,865,251,049.91 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%×天相转债指数收益率＋30%×天相 280 指数收益率＋30%×天相国债全价指数收益率＋5%×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

露负责人	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		李勍	胡怀邦

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	285,782,104.55	1,252,151,502.70	-1,629,775,432.98
本期利润	257,563,703.27	1,797,990,724.66	-2,037,254,863.10
加权平均基金份额本期利润	0.0669	0.4227	-0.4516
本期加权平均净值利润率	6.33%	45.66%	-52.95%
本期基金份额净值增长率	7.53%	60.64%	-38.20%
3.1.2 期末数据和指标	**2010 年末**	**2009 年末**	**2008 年末**
期末可供分配利润	137,975,744.46	-208,538,368.40	-1,443,466,708.78

期末可供分配基金份额利润	0.0482	-0.0481	-0.3422
期末基金资产净值	3,395,966,210.58	4,771,627,751.49	2,894,572,949.82
期末基金份额净值	1.185	1.102	0.686
3.1.3 累计期末指标	**2010 年末**	**2009 年末**	**2008 年末**
基金份额累计净值增长率	464.03%	424.53%	226.52%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	10.03%	1.52%	3.56%	0.81%	6.47%	0.71%
过去六个月	27.56%	1.28%	10.16%	0.66%	17.40%	0.62%
过去一年	7.53%	1.18%	-7.08%	0.68%	14.61%	0.50%
过去三年	6.76%	1.43%	-19.00%	1.02%	25.76%	0.41%
过去五年	399.23%	1.41%	103.55%	1.01%	295.68%	0.40%
自基金成立起至今	464.03%	1.29%	99.46%	0.92%	364.57%	0.37%

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 2010 年 12 月 31 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 20.75%，其中所对应的基础股票的投资比例为资

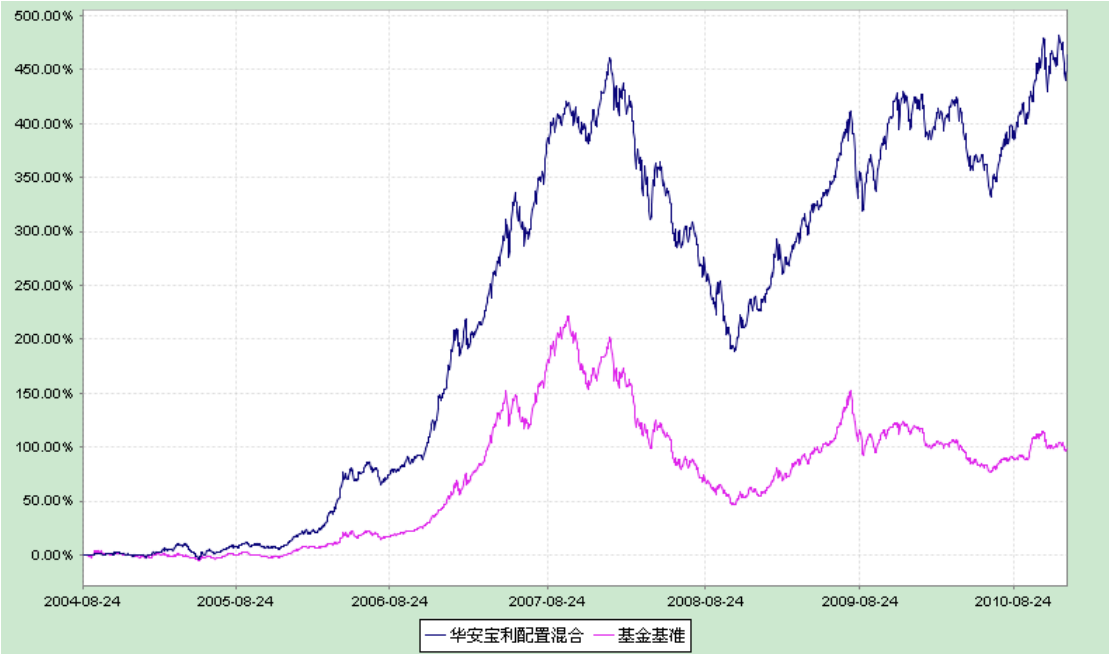
产净值的 12.77%；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的比例为 11.37%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的比例为 59.51%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

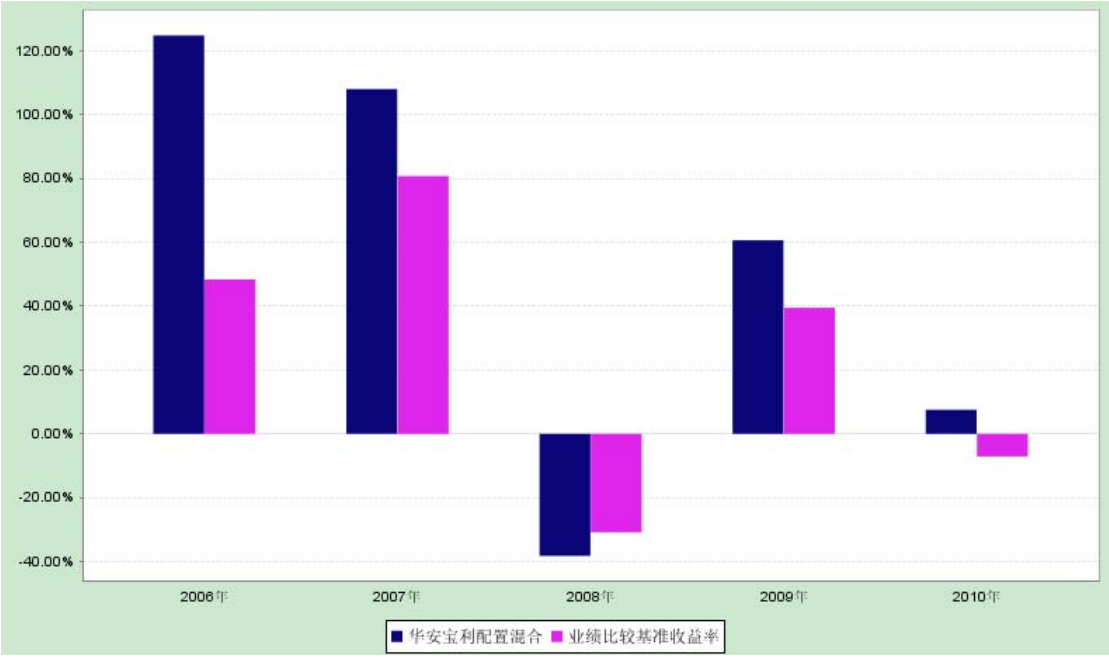
（2004 年 8 月 24 日至 2010 年 12 月 31 日）



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安宝利配置证券投资基金

过去五年净值增长率图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	-
2009年	-	-	-	-	-
2008年	0.400	53,862,625.81	59,957,242.72	113,819,868.53	为2007年度批准、公告但在2008年度实施的利润分配。
合计	0.400	53,862,625.81	59,957,242.72	113,819,868.53	-

§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 2010 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安现金富

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、华安国际配置、华安香港精选股票、华安稳固收益债券等 19 只开放式基金，管理资产规模达到 825.65 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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓跃辉	本基金的基金经理	2008-04-25	2010-03-19	7 年	经济学硕士，CFA，CPA，7 年基金行业从业经历。2003 年 4 月加入华安基金管理公司，曾任研究发展部高级研究员，2008 年 2 月至 2010 年 3 月担任华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理，2008 年 4 月至 2010 年 3 月同时任本基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理	2008-10-11	2010-04-21	16 年	经济学硕士，16 年证券、基金行业从业经历。历任安徽省国际信托投资公司投资银行部业务主办、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、投研部副总监等职。2006 年 6 月 21 日至 2007 年 10 月 27 日任华富货币市场基金基金经理，2007 年 5 月 12 日至 2008 年 5 月 17 日同时任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。2008 年 6 月重新加入华安基金管理公司，2008 年 10 月 11 日至 2010 年 4 月 21 日任本基金的基金经理，2009 年 6

					月 25 日起担任华安中小盘成长股票基金的基金经理，2010 年 5 月 11 日起同时担任华安行业轮动股票型证券投资基金的基金经理。
陆从珍	本基金的基金经理	2010-04-21	-	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 21 日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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守有关法律法规及《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

按照华安宝利配置混合与华安动态灵活配置混合的基金合同，二基金同属于配置型基金，2010 年全年，二基金净值增长率分别为：华安宝利配置混合 7.53%、华安动态灵活配置混合 4.89%， 二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

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年，A 股市场整体呈现先抑后扬，大幅震荡的走势，其中板块间分化明显，大盘蓝筹股全年估值受压，而新兴产业表现突出。为应对市场的变化，华安宝利在 2010 年内仓位变动幅度较大，期间最低仓位在 42%，最高仓位在 78%，灵活的仓位变动为宝利赢取了一定的收益。同时，宝利于各行业的配置在前后期也有较为明显的差异，年初时基金大部分仓位配置于大盘股，此后经过大幅度的调整，在年中时，提高了对食品饮料、医药、周期品以及新兴产业的配置，使得基金在下半年获得超过市场的收益。在 2010 年底，基于对 2011 年的市场判断，宝利降低了食品饮料、医药等的配置，转而提高对高端制造的投资比例。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.185 元，本报告期份额净值增长率为 7.53%，同期上证综指下跌 14.31%，深圳成指下跌 9.06%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

预期在 2011 上半年，通胀依然是主导政策走向的主要因素。由于美国在金融危机后持续的量化宽松政策，导致全球流动性泛滥，农产品等大宗商品价格持续上涨，新兴国家受影响尤其严重。在国内，抗通胀也成为主要的政策目标之一，从 2010 年下半年以来，政府已经连续上调利率及存款准备金率，回收流动性的意图明显。随着发达经济体的经济增速回升，其退出政策的讨论逐渐增加，美国 QE2 到期以后是否继续刺激政策存在很大的不确定性。如果发达经济体要执行退出政策，可能影响到新兴市场的流动性，对其股市产生不利影响。但 A 股是一个相对封闭的市场，而且，我们认为国内政策往往会倾向于对冲外围的影响，在上半年持续收紧之后，后续反而存在放松的可能，因此，我们认为 A 股市场全年存在收益机会。加之 2011 年是十二五规划的开局之年，各产业政策、区域政策将会持续出台，利好相关公司。预期 2011 年市场将呈现震荡上行态势，我们将围绕产业政策、财政刺激等主题，适时调整仓位和持仓结构，以期为投资人带

来良好收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

在本报告期内，本基金管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

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

（2）由公司督察长牵头与基金经理、投资经理一对一进行合规谈话，要求基金经理和投资经理在投资运作中严格遵守法律法规、基金合同、公司规章制度的各项规定，严格把握职业操守，坚决不碰“老鼠仓、内幕交易、利益输送”三条底线，并进行了合规考试；

（3）通过合规培训以强化员工的合规意识和风险控制意识。本报告期内公司组织的合规培训包括：公司及基金行业违规及操作失误案例的合规培训；投资流程标准化操作培训；防止内幕交易、违规买卖股票和利用未公开信息交易的培训；基金销售合规培训等等；

（4）按照中国证监会要求，组织投资研究部门对投资、研究、风险管理、投资人员管理等方面进行了一次全面性的自查，自查情况良好，基本达到了中国证监会的监管要求；

（5）除保持投资、交易、核算、销售等相关业务活动进行日常合规性监察同时，强化了在基金新产品开发过程中的合规支持；

（6）有计划地对公司相关业务部门进行了多次全面或专项稽核，进一步强化了对公司制度执行和风控措施的落实。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

（1）公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、

研究发展部总经理、固定收益部总经理、金融工程部总经理、基金运营部总经理及相关负责人员。

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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。

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

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

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

许之彦,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。

朱永红，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理有限公司，2010 年 11 月 19 日离职前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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

§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

2010 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

2010 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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2010 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年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20331 号

华安宝利配置证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华安宝利配置证券投资基金(以下简称“华安宝利配置基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基

金行业实务操作编制财务报表是华安宝利配置基金的基金管理人华安基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1)设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2)选择和运用恰当的会计政策；

(3)作出合理的会计估计。

6.2 注册会计师的责任

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

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华安宝利配置基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司　　注册会计师 汪棣 金毅

上海市湖滨路
202 号普华永道中心 11 楼

2011-03-25

§7 年度财务报表

7.1 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：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日

资 产：			
银行存款	7.4.7.1	55,525,394.66	10,383,234.23
结算备付金		182,276,867.44	387,389,138.88
存出保证金		2,548,549.57	4,713,203.60
交易性金融资产	7.4.7.2	3,111,555,946.97	4,526,764,778.15
其中：股票投资		2,454,557,423.71	3,675,690,304.48
基金投资		-	-
债券投资		656,998,523.26	851,074,473.67
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		47,572,345.12	30,003,619.69
应收利息	7.4.7.5	8,089,154.93	8,177,822.52
应收股利		-	-
应收申购款		4,239,221.45	1,697,911.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,411,807,480.14	4,969,129,708.23
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2010年12月31日**	**上年度末 2009年12月31日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	99,999,650.00
应付证券清算款		1,930,641.76	67,811,056.09
应付赎回款		2,776,888.80	14,147,980.03
应付管理人报酬		3,592,807.88	4,784,991.60
应付托管费		748,501.65	996,873.26
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,856,643.01	8,070,424.10
应交税费		1,044,312.60	918,852.60
应付利息		-	4,323.97

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	891,473.86	767,805.09
负债合计		15,841,269.56	197,501,956.74
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,865,251,049.91	4,331,460,220.77
未分配利润	7.4.7.10	530,715,160.67	440,167,530.72
所有者权益合计		3,395,966,210.58	4,771,627,751.49
负债和所有者权益总计		3,411,807,480.14	4,969,129,708.23

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.185 元，基金份额总额 2,865,251,049.91 份。

7.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		**350,102,927.38**	**1,905,246,090.50**
1.利息收入		33,563,454.29	28,031,142.67
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,617,334.28	4,013,344.29
债券利息收入		29,607,345.06	24,012,501.46
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		338,774.95	5,296.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		342,980,217.89	1,329,705,030.24
其中：股票投资收益	7.4.7.12	301,130,331.22	1,270,462,016.96
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.13	24,982,672.09	42,794,716.75
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	292,820.80
股利收益	7.4.7.15	16,867,214.58	16,155,475.73
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-28,218,401.28	545,839,221.96
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,777,656.48	1,670,695.63
减：二、费用		**92,539,224.11**	**107,255,365.84**
1．管理人报酬	7.4.10.2.1	48,939,914.04	46,929,309.19
2．托管费	7.4.10.2.2	10,195,815.40	9,776,939.40
3．销售服务费		-	-
4．交易费用	7.4.7.18	30,726,180.13	49,494,561.35
5．利息支出		2,261,724.05	639,921.13
其中：卖出回购金融资产支出		2,261,724.05	639,921.13
6．其他费用	7.4.7.19	415,590.49	414,634.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**257,563,703.27**	**1,797,990,724.66**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		257,563,703.27	1,797,990,724.66

7.3 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：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	257,563,703.27	257,563,703.27
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）	-1,466,209,170.86	-167,016,073.32	-1,633,225,244.18
其中：1. 基金申购款	639,433,978.74	49,756,756.88	689,190,735.62
2. 基金赎回款	-2,105,643,149.60	-216,772,830.20	-2,322,415,979.80
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）	2,865,251,049.91	530,715,160.67	3,395,966,210.58
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,217,954,911.77	-1,323,381,961.95	2,894,572,949.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,797,990,724.66	1,797,990,724.66
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）	113,505,309.00	-34,441,231.99	79,064,077.01
其中：1. 基金申购款	1,938,839,958.05	-126,106,101.85	1,812,733,856.20
2. 基金赎回款	-1,825,334,649.05	91,664,869.86	-1,733,669,779.19
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）	4,331,460,220.77	440,167,530.72	4,771,627,751.49

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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 3 月 25 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

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

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

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

(2)金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。具体收益分配政策请参见相关基金合同中的相关章节。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

重要会计估计及其关键假设

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

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

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	55,525,394.66	10,383,234.23
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	55,525,394.66	10,383,234.23

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,142,597,411.01	2,454,557,423.71	311,960,012.70
债券	交易所市场	359,310,153.78	368,084,523.26	8,774,369.48
	银行间市场	293,418,922.18	288,914,000.00	-4,504,922.18
	合计	652,729,075.96	656,998,523.26	4,269,447.30
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,795,326,486.97	3,111,555,946.97	316,229,460.00
项目		上年度末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		3,360,057,449.68	3,675,690,304.48	315,632,854.80
债券	交易所市场	410,780,896.65	441,854,473.67	31,073,577.02
	银行间市场	411,478,570.54	409,220,000.00	-2,258,570.54
	合计	822,259,467.19	851,074,473.67	28,815,006.48
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,182,316,916.87	4,526,764,778.15	344,447,861.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末（2010 年 12 月 31 日）及比较报告期末(2009 年 12 月 31 日)衍生金融资产/负债余额均为零。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末（2010 年 12 月 31 日）及比较报告期末(2009 年 12 月 31 日)买入返售金融资产余额均为零。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末（2010 年 12 月 31 日）及比较报告期末(2009 年 12 月 31 日) 买断式逆回购交易中取得的债券余额均为零。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	11,994.63	28,399.41
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	40,224.72	170,137.25
应收债券利息	8,035,552.89	7,975,346.07
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	1,346.39	3,903.49
其他	36.30	36.30
合计	8,089,154.93	8,177,822.52

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末（2010 年 12 月 31 日）及比较报告期末(2009 年 12 月 31 日) 其他资产余额均为零。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	4,853,014.76	8,066,077.10
银行间市场应付交易费用	3,628.25	4,347.00
合计	4,856,643.01	8,070,424.10

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	7,473.86	37,305.09
预提费用	384,000.00	230,500.00
合计	891,473.86	767,805.09

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期

	2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,331,460,220.77	4,331,460,220.77
本期申购	639,433,978.74	639,433,978.74
本期赎回（以“-”号填列）	-2,105,643,149.60	-2,105,643,149.60
本期末	2,865,251,049.91	2,865,251,049.91

注：申购含转入份额；赎回含转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-208,538,368.40	648,705,899.12	440,167,530.72
本期利润	285,782,104.55	-28,218,401.28	257,563,703.27
本期基金份额交易产生的变动数	60,732,008.31	-227,748,081.63	-167,016,073.32
其中：基金申购款	-27,242,809.46	76,999,566.34	49,756,756.88
基金赎回款	87,974,817.77	-304,747,647.97	-216,772,830.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	137,975,744.46	392,739,416.21	530,715,160.67

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	602,857.12	392,024.42
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	2,996,692.98	3,549,165.28
其他	17,784.18	72,154.59
合计	3,617,334.28	4,013,344.29

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31

	31日	日
卖出股票成交总额	10,630,129,922.45	16,103,981,803.13
减：卖出股票成本总额	10,328,999,591.23	14,833,519,786.17
买卖股票差价收入	301,130,331.22	1,270,462,016.96

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,762,908,603.18	2,214,824,406.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,721,888,330.68	2,133,168,818.46
减：应收利息总额	16,037,600.41	38,860,871.34
债券投资收益	24,982,672.09	42,794,716.75

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出权证成交总额	-	791,999.61
减：卖出权证成本总额	-	499,178.81
买卖权证差价收入	-	292,820.80

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	16,867,214.58	16,155,475.73
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,867,214.58	16,155,475.73

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
1. 交易性金融资产	-28,218,401.28	545,839,221.96
——股票投资	-3,672,842.10	568,628,757.24
——债券投资	-24,545,559.18	-22,789,535.28
——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	-28,218,401.28	545,839,221.96

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	1,646,121.57	1,316,775.13
基金转出费收入	104,945.05	339,835.73
其他	-	7,054.71
印花税手续费返还收入	26,589.86	7,030.06
合计	1,777,656.48	1,670,695.63

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	30,717,055.13	49,481,186.35
银行间市场交易费用	9,125.00	13,375.00
合计	30,726,180.13	49,494,561.35

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	104,000.00	101,000.00
信息披露费	280,000.00	280,000.00
银行托管账户维护费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	13,590.49	15,634.77
合计	415,590.49	414,634.77

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 11 日宣告 2010 年度第 1 次分红，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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
上海国际信托有限公司	基金管理人的股东
上海电气(集团)总公司	基金管理人的股东
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	48,939,914.04	46,929,309.19
其中：支付销售机构的客户维护费	8,442,470.58	8,368,357.84

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 X 1.2% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,195,815.40	9,776,939.40

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 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限公司	150,128,100.00	182,549,598.77	400,000,000.00	19,855.34	100,000,000.00	36,623.97
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日						

银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	126,400,201.90	107,108,669.21
期间申购/买入总份额	-	19,291,532.69
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	126,400,201.90	126,400,201.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.41%	2.92%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2010 年 12 月 31 日）和上年度末（2009 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	55,525,394.66	602,857.12	10,383,234.23	392,024.42

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2010 年 12 月 31 日的相关余额在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示(2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日）和上年度可比

期间内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行收益分配。

7.4.12 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-01-07	新股网上认购	5.99	5.99	5,000	29,950.00	29,950.00	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股网下认购	23.00	31.11	24,284	558,532.00	755,475.24	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是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管理、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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的信用类债券占基金资产净值的比例为 13.77%(2009 年 12 月 31 日：9.67%)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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公司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 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2010 年 12 月 31 日，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，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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金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。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
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
上年度末 2009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	10,383,234.23	-	-	-	10,383,234.23
结算备付金	387,389,138.88	-	-	-	387,389,138.88
存出保证金	103,913.63	-	-	4,609,289.97	4,713,203.60
交易性金融资产	256,902,868.80	512,177,228.99	81,994,375.88	3,675,690,304.48	4,526,764,778.15
应收证券清算款	-	-	-	30,003,619.69	30,003,619.69
应收利息	-	-	-	8,177,822.52	8,177,822.52
应收申购款	1,409,613.49	-	-	288,297.67	1,697,911.16
资产总计	656,188,769.03	512,177,228.99	81,994,375.88	3,718,769,334.33	4,969,129,708.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	67,811,056.09	67,811,056.09
应付赎回款	-	-	-	14,147,980.03	14,147,980.03
应付管理人报酬	-	-	-	4,784,991.60	4,784,991.60
应付托管费	-	-	-	996,873.26	996,873.26
应付交易费用	-	-	-	8,070,424.10	8,070,424.10
应交税费	-	-	-	918,852.60	918,852.60
其他负债	-	-	-	767,805.09	767,805.09
卖出回购金融资产款	99,999,650.00	-	-	-	99,999,650.00
应付利息	-	-	-	4,323.97	4,323.97

负债总计	99,999,650.00	-	-	97,502,306.74	197,501,956.74
利率敏感度缺口	556,189,119.03	512,177,228.99	81,994,375.88	3,621,267,027.59	4,771,627,751.49

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.35%(2009 年 12 月 31 日：17.84%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 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	2,454,557,423.71	72.28	3,675,690,304.48	77.03

衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,454,557,423.71	72.28	3,675,690,304.48	77.03

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）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：人民币元）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	业绩比较基准（附注 7.4.1）下降 5%	减少约 25,000.00 万元	减少约 29,000.00 万元
	业绩比较基准（附注 7.4.1）上升 5%	增加约 25,000.00 万元	增加约 29,000.00 万元

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 2,822,641,946.97 元，第二层级的余额为 288,914,000.00 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 3,842,568,778.15 元，第二层级 684,196,000.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年度：同)。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，并于限售期满后从第二层级转入第一层级(2009 年度：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,454,557,423.71	71.94
	其中：股票	2,454,557,423.71	71.94
2	固定收益投资	656,998,523.26	19.26
	其中：债券	656,998,523.26	19.26
	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	237,802,262.10	6.97
6	其他各项资产	62,449,271.07	1.83
7	合计	3,411,807,480.14	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	29,950.00	0.00
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,552,951,505.04	45.73
C0	食品、饮料	235,864,406.00	6.95
C1	纺织、服装、皮毛	59,697,090.60	1.76
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	39,698,400.00	1.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	429,086,010.80	12.64
C5	电子	55,262,744.48	1.63
C6	金属、非金属	92,390,014.00	2.72
C7	机械、设备、仪表	338,089,460.76	9.96
C8	医药、生物制品	273,874,219.90	8.06

C99	其他制造业	28,989,158.50	0.85
D	电力、煤气及水的生产和供应业	49,008,367.00	1.44
E	建筑业	192,123,000.00	5.66
F	交通运输、仓储业	14,997,808.08	0.44
G	信息技术业	310,005,656.83	9.13
H	批发和零售贸易	159,341,136.76	4.69
I	金融、保险业	130,530,000.00	3.84
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	45,570,000.00	1.34
	合计	2,454,557,423.71	72.28

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600160	巨化股份	8,500,000	192,780,000.00	5.68
2	000858	五 粮 液	5,200,000	180,076,000.00	5.30
3	000887	中鼎股份	6,088,607	148,562,010.80	4.37
4	600068	葛洲坝	12,000,000	139,200,000.00	4.10
5	601601	中国太保	5,700,000	130,530,000.00	3.84
6	601607	上海医药	5,000,000	109,200,000.00	3.22
7	600104	上海汽车	7,001,849	102,787,143.32	3.03
8	000999	华润三九	3,250,000	83,037,500.00	2.45
9	600570	恒生电子	4,090,000	82,822,500.00	2.44
10	002161	远 望 谷	2,280,000	79,594,800.00	2.34
11	000063	中兴通讯	2,700,000	73,710,000.00	2.17
12	600739	辽宁成大	2,328,723	70,141,136.76	2.07
13	000630	铜陵有色	2,000,000	70,100,000.00	2.06
14	601989	中国重工	5,800,000	68,382,000.00	2.01
15	002020	京新药业	3,800,845	66,210,719.90	1.95

16	002024	苏宁电器	5,000,000	65,500,000.00	1.93
17	002154	报 喜 鸟	1,877,267	59,697,090.60	1.76
18	600970	中材国际	1,300,000	52,923,000.00	1.56
19	601918	国投新集	3,488,140	49,008,367.00	1.44
20	600770	综艺股份	2,100,000	45,570,000.00	1.34
21	600071	凤凰光学	3,585,699	44,175,811.68	1.30
22	600288	大恒科技	3,300,000	41,613,000.00	1.23
23	600866	星湖科技	2,912,900	41,188,406.00	1.21
24	002324	普利特	1,000,000	40,360,000.00	1.19
25	002117	东港股份	1,390,000	39,698,400.00	1.17
26	002475	立讯精密	700,000	39,179,000.00	1.15
27	000541	佛山照明	1,900,000	31,521,000.00	0.93
28	002398	建研集团	896,110	28,989,158.50	0.85
29	002152	广电运通	500,000	27,190,000.00	0.80
30	000530	大冷股份	2,121,355	25,201,697.40	0.74
31	600500	中化国际	2,000,000	23,700,000.00	0.70
32	600523	贵航股份	911,636	21,806,333.12	0.64
33	002409	雅克科技	500,000	20,710,000.00	0.61
34	300010	立思辰	700,000	18,410,000.00	0.54
35	002013	中航精机	500,000	16,270,000.00	0.48
36	002250	联化科技	390,000	15,990,000.00	0.47
37	000597	东北制药	900,000	15,426,000.00	0.45
38	601111	中国国航	1,096,331	14,997,808.08	0.44
39	000972	新 中 基	1,000,000	14,600,000.00	0.43
40	000547	闽福发 A	981,953	13,855,356.83	0.41
41	600362	江西铜业	300,000	13,551,000.00	0.40
42	600096	云天化	400,000	10,684,000.00	0.31
43	002156	通富微电	546,256	9,739,744.48	0.29
44	600459	贵研铂业	228,770	8,739,014.00	0.26
45	002414	高德红外	200,000	6,344,000.00	0.19
46	601126	四方股份	24,284	755,475.24	0.02

47	601118	海南橡胶	5,000	29,950.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	351,645,183.48	7.37
2	600016	民生银行	280,856,039.65	5.89
3	601318	中国平安	270,071,123.61	5.66
4	600028	中国石化	249,731,869.24	5.23
5	601666	平煤股份	214,201,641.42	4.49
6	000858	五 粮 液	206,318,927.08	4.32
7	601607	上海医药	194,243,838.25	4.07
8	601601	中国太保	183,694,928.68	3.85
9	000630	铜陵有色	180,606,540.32	3.79
10	600160	巨化股份	176,501,620.13	3.70
11	600104	上海汽车	172,855,171.56	3.62
12	600036	招商银行	146,917,757.29	3.08
13	000063	中兴通讯	144,727,482.43	3.03
14	601169	北京银行	140,181,280.97	2.94
15	600068	葛洲坝	139,835,357.06	2.93
16	600352	浙江龙盛	135,505,488.04	2.84
17	600739	辽宁成大	131,397,423.41	2.75
18	601989	中国重工	124,394,239.77	2.61
19	600572	康恩贝	110,250,835.56	2.31
20	601001	大同煤业	94,987,983.76	1.99

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）

1	601318	中国平安	449,503,429.61	9.42
2	601166	兴业银行	391,497,261.92	8.20
3	600028	中国石化	365,157,238.27	7.65
4	600016	民生银行	312,613,968.56	6.55
5	600036	招商银行	277,339,504.48	5.81
6	601666	平煤股份	262,306,898.46	5.50
7	601788	光大证券	231,911,725.65	4.86
8	600598	北大荒	231,429,821.20	4.85
9	000630	铜陵有色	199,367,724.40	4.18
10	002022	科华生物	173,648,826.30	3.64
11	601607	上海医药	143,827,410.88	3.01
12	600519	贵州茅台	142,876,349.99	2.99
13	600572	康恩贝	139,025,923.53	2.91
14	601169	北京银行	136,942,156.77	2.87
15	600352	浙江龙盛	129,240,319.67	2.71
16	600239	云南城投	123,238,295.78	2.58
17	600585	海螺水泥	113,620,910.91	2.38
18	600428	中远航运	99,840,257.94	2.09
19	601601	中国太保	97,786,207.52	2.05
20	002078	太阳纸业	95,976,014.95	2.01
21	600050	中国联通	95,630,359.25	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	9,111,539,552.56
卖出股票的收入（成交）总额	10,630,129,922.45

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净

			值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	70,203,000.00	2.07
3	金融债券	119,281,000.00	3.51
	其中：政策性金融债	119,281,000.00	3.51
4	企业债券	191,873,755.30	5.65
5	企业短期融资券	10,049,000.00	0.30
6	可转债	265,591,767.96	7.82
7	其他	-	-
8	合计	656,998,523.26	19.35

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113001	中行转债	1,090,780	119,833,090.80	3.53
2	0801035	08 央票 35	700,000	70,203,000.00	2.07
3	113002	工行转债	593,450	70,110,183.00	2.06
4	060202	06 国开 02	500,000	50,105,000.00	1.48
5	126630	铜陵转债	210,000	42,325,500.00	1.25

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

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

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

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,548,549.57
2	应收证券清算款	47,572,345.12
3	应收股利	-
4	应收利息	8,089,154.93
5	应收申购款	4,239,221.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,449,271.07

8.9.4 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	113001	中行转债	119,833,090.80	3.53
2	125709	唐钢转债	27,410,994.16	0.81
3	110007	博汇转债	5,912,000.00	0.17

8.9.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
161,087	17,786.98	357,691,885.91	12.48%	2,507,559,164.00	87.52%

9.2 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	266,378.22	0.01%

§10 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	4,331,460,220.77
本报告期基金总申购份额	639,433,978.74
减：本报告期基金总赎回份额	2,105,643,149.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,865,251,049.91

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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).2010 年 1 月 16 日，本基金管理人发布关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

(2).2010 年 5 月 13 日，本基金管理人发布关于总经理任职的公告，经本公司董事会会议审议通过，聘任李勍先生任本公司总经理。董事长俞妙根先生不再兼任总经理职务。

(3).2010 年 3 月 19 日，本基金管理人发布关于基金经理变更的公告，鉴于邓跃辉先生因个人原因提出辞职，经华安基金管理有限公司研究，同意其辞职申请，并免去其华安宝利配置证券投资基金与华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理职务。

(4).2010 年 4 月 21 日，本基金管理人发布关于基金经理变更的公告，根据业务需要，经华安基金管理有限公司研究，决定对基金经理作如下调整：1）免去沈雪峰女士华安宝利配置证券投资基金的基金经理职务；2)免去陆从珍女士安顺证券投资基金、华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理职务，聘任其为华安宝利配置证券投资基金的基金经理。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 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。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 104,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
红塔证券股份有限公司	1	5,169,330,805.22	26.43%	4,393,906.62	26.78%	-
海通证券股份有限公司	1	4,632,364,585.76	23.69%	3,763,824.34	22.94%	-
兴业证券股份有限公司	1	2,728,262,262.92	13.95%	2,319,025.81	14.13%	-
申银万国证券股份有限公司	1	2,144,138,793.16	10.96%	1,822,506.85	11.11%	-
东莞证券有限责任公司	1	1,593,900,383.16	8.15%	1,354,805.70	8.26%	-
中信建投证券有限责任公司	1	1,118,794,683.02	5.72%	909,027.57	5.54%	-
渤海证券股份有限公司	1	706,098,094.98	3.61%	600,183.38	3.66%	-
中信证券股份有限公司	1	646,529,876.89	3.31%	549,549.65	3.35%	-

中银国际证券有限责任公司	1	594,390,041.87	3.04%	505,229.40	3.08%	-
长城证券有限责任公司	1	224,242,379.37	1.15%	190,605.45	1.16%	-

注：1、本报告期内，本基金新增东莞证券有限责任公司上海交易单元。

2、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。

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。

11.7.2 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	占当期债券成交总额	成交金额	占当期回购成交总额	成交金额	占当期权证成

		的比例		的比例		交总额的比例
红塔证券股份有限公司	586,389,563.50	42.17%	2,130,200,000.00	49.28%	-	-
海通证券股份有限公司	119,178,881.63	8.57%	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	276,937,056.60	19.92%	1,552,100,000.00	35.91%	-	-
申银万国证券股份有限公司	150,815,760.10	10.85%	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	75,554,198.10	5.43%	200,000,000.00	4.63%	-	-
中信建投证券有限责任公司	17,610,308.40	1.27%	-	-	-	-
渤海证券股份有限公司	45,369,474.00	3.26%	340,000,000.00	7.87%	-	-
中信证券股份有限公司	103,258,943.20	7.43%	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	14,240,592.60	1.02%	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	1,223,500.00	0.09%	100,000,000.00	2.31%	-	-

11.8 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	关于旗下部分基金参加中国邮储银行网上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	2010-01-04
2	关于旗下部分基金参加中国工商银行“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-04
3	关于新增广发华福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	2010-01-14

		国证券报》和公司网站	
4	关于参加广发华福证券有限责任公司网上交易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	2010-01-14
5	关于旗下部分基金参加深圳发展银行定期定额申购费率优惠、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	2010-01-18
6	关于电子直销平台开通“华安-交行网上直销”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-01-18
7	关于新增第一创业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	2010-03-24
8	关于新增渤海银行股份有限公司为旗下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	2010-03-29
9	关于旗下基金在国海证券有限责任公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-03-29
10	关于参加华夏银行延长网上银行基金申购费率优惠及定投申购费率优惠活动期限的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-04-01
11	关于参加中国工商银行开展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	2010-04-01
12	关于新增乌鲁木齐市商业银行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	2010-04-09
13	关于新增中天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	2010-04-13

		国证券报》和公司网站	
14	关于新增厦门证券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	2010-04-20
15	关于新增东莞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	2010-04-28
16	关于新增西南证券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	2010-05-12
17	关于旗下基金参加中信银行股份有限公司网上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	2010-06-01
18	关于新增大通证券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	2010-06-02
19	关于旗下基金在申银万国证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-04
20	关于北京分公司办公地址变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-06-18
21	关于旗下部分基金参加交通银行网上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	2010-06-30
22	关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行网上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	2010-06-30
23	关于旗下基金持有的“中国平安”股票估值调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中	2010-07-02

		国证券报》和公司网站	
24	关于新增英大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	2010-07-07
25	关于旗下基金在信达证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-07-19
26	关于参加信达证券股份有限公司网上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	2010-07-19
27	关于旗下部分基金参加国泰君安证券股份有限公司网上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	2010-08-18
28	关于旗下基金参加中信建投证券定投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	2010-08-25
29	关于旗下基金参加中信建投证券有限责任公司网上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	2010-08-25
30	关于新增东吴证券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	2010-08-26
31	关于新增温州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	2010-09-06
32	关于旗下基金持有的“中国平安”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	2010-09-06
33	关于旗下基金参加华泰证券股份有限公司定期定额申购费率优惠活动的公	《上海证券报》、《证券时报》、《中	2010-09-17

	告	国证券报》和公司网站	
34	关于电子直销平台开通“趋势定投”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-18
35	关于电子直销平台开通“自动停损”基金电子交易业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-09-18
36	关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司网上银行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	2010-10-08
37	关于新增天风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	2010-10-22
38	关于新增日信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	2010-11-01
39	关于新增新时代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	2010-11-26
40	关于电子直销平台开通“天天盈账户”第三方支付业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-11-29
41	关于设立华安资产管理（香港）有限公司的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-03
42	关于广州分公司办公地址变更的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-17
43	关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金申购	《上海证券报》、《证券时报》、《中	2010-12-31

	费率优惠活动的公告	国证券报》和公司网站	
44	关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定期定额投资优惠活动的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2010-12-31
45	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	2011-01-04
46	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	2011-01-04
47	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	2011-01-11
48	关于参加温州银行股份有限公司个人网上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	2011-01-31
49	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	2011-01-31
50	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	2011-02-14
51	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	2011-02-19
52	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	2011-03-10

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。

§12 备查文件目录

12.1 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；

12.2 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。

12.3 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

二〇一一年三月二十六日