

华安宝利配置证券投资基金 2009 年半年度报告

2009 年 6 月 30 日

基金管理人：华安基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
送出日期：2009 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2009 年 8 月 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及其更新。

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

§ 1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§ 2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§ 4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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
§ 5 托管人报告.....	11
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.....	11
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.....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1 资产负债表.....	11
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
§ 7 投资组合报告.....	29
7.1 期末基金资产组合情况.....	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	29
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.....	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	32
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.....	34
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.....	34
7.9 投资组合报告附注.....	35
§ 8 基金份额持有人信息.....	35
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
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.....	36
§ 9 开放式基金份额变动.....	36
§ 10 重大事件揭示.....	36
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	36
10.4 基金投资策略的改变.....	36
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	36
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.....	36
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 其他重大事件.....	38
§ 11 备查文件目录.....	41

§ 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	
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	
报告期末基金份额总额	4,237,033,206.42 份	

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 (简称“华安基金”)	交通银行股份有限公司 (简称“交通银行”)
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-68888917
	电子邮箱	fengying@huaan.com.c	zhangyd@bankcomm.com

	n	
客户服务电话	40088-50099	95559
传真	021-68863414	021-58408842
注册地址	上海市浦东南路 360 号 新上海国际大厦 38 楼	上海市银城中路 188 号
办公地址	上海市浦东南路 360 号 新上海国际大厦 2 楼、 37 楼、38 楼	上海市银城中路 188 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	俞妙根	胡怀邦

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	华安基金管理有限公司
办公地址	上海市浦东南路 360 号新上海国际大厦 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（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	511,488,315.91
本期利润	1,105,026,882.91
加权平均基金份额本期利润	0.2601
本期加权平均净值利润率	31.38%
本期基金份额净值增长率	37.90%
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	-938,641,559.43
期末可供分配基金份额利润	-0.2215
期末基金资产净值	4,006,393,879.22
期末基金份额净值	0.946
3.1.3 累计期末指标	报告期（2009 年 1 月 1 日-2009 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	350.28%

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，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	6.17%	0.64%	4.97%	0.49%	1.20%	0.15%
过去三个月	14.53%	0.95%	10.31%	0.68%	4.22%	0.27%
过去六个月	37.90%	1.16%	32.13%	0.83%	5.77%	0.33%
过去一年	15.37%	1.41%	12.73%	0.95%	2.64%	0.46%
过去三年	147.51%	1.48%	69.41%	1.10%	78.10%	0.38%
自基金合同生效起至今	350.28%	1.28%	108.35%	0.93%	241.93%	0.35%

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%。

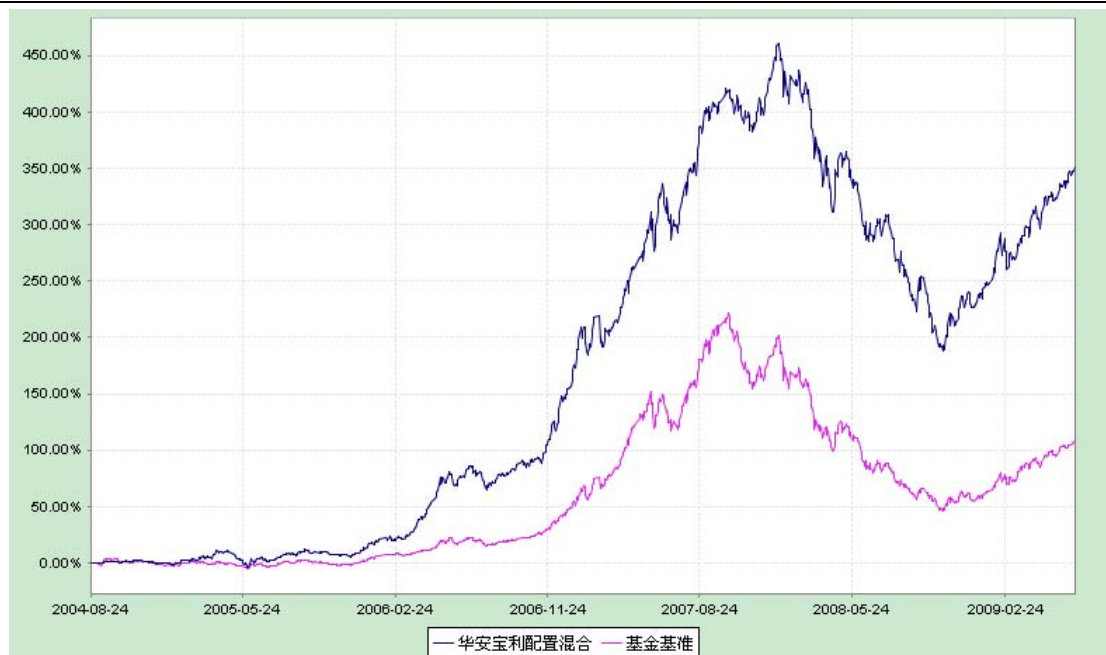
截至 2009 年 6 月 30 日，本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的比例为 12.19%，其中所对应的基础股票的投资比例为资产净值的 5.67%；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的比例为 17.17%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的比例为 63.79%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2004 年 8 月 24 日至 2009 年 6 月 30 日）



注：根据《华安宝利配置证券投资基金基金合同》规定，本基金已自基金合同生效之日起 90 个工作日内使基金的投资组合比例符合基金合同第十二部分（三）投资范围、（八）投资限制的有关规定。

§ 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		
邓跃辉	本基金的基金	2008 年 4 月 25 日	—	6 年	经济学硕士，CFA，CPA，6 年基金行业从业经历。2003 年 4 月加入华安基

	经理				金管理公司，曾任研究发展部高级研究员，2008 年 2 月起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 月起同时任本基金的基金经理。
沈雪峰	本基金的基金经理	2008 年 10 月 11 日	-	15 年	经济学硕士，15 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，并于 2008 年 10 月 11 日任本基金的基金经理，2009 年 6 月 25 日起同时担任华安中小盘成长股票基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日。

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《华安宝利配置证券投资基金基金合同》、《华安宝利配置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《交易端基金间公平交易管理办法》进行管理。

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

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

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

按照华安宝利配置混合的基金合同，华安宝利配置混合属于配置型基金，其投资方向及投资风格与其它基金有较大的差异。目前，华安旗下基金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

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

(1) 行情回顾

经历了百年一遇的金融危机和08年全球股市的暴跌，2009年1-6月，A股市场以单边上涨的方式展开了报复性反弹，沪深300指数上涨74.20%，本轮A股反弹速度之快、幅度之大再次超出了大部分市场投资人的预期。

适度宽松的货币政策、积极的财政政策、前期跌幅巨大的市场、逐步复苏的国内及全球经济造就了本轮A股轰轰烈烈的上涨，将近1/3的股票接近或超过其07年最高股价。

(2) 操作回顾

华安宝利配置基金上半年加仓幅度较大，仓位从08年年底的不到50%，提升到年中的近70%，期间基金单位净值上涨37.90%，比较基准上涨32.13%，超越基准5.77个百分点。

本基金开年之后很快就进行了一轮较大幅度的加仓，但随着市场的上涨，更主要是出于对海外经济再次恶化、海外股市迭创新低的担心，2月中下旬又进行了一次较大幅度的减仓，事后证明这次减仓效果不甚理想，这也是本基金上半年操作最大的失误所在。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经过大幅上涨的A股，目前估值已然不算便宜，但作为新兴市场的中国，增长潜力显著，加之全球经济复苏迹象日益清晰，同时预计适度宽松的货币政策在可预见的未来仍将持续，中国产业升级也需要得到繁荣资本市场的支持，我们对下半年行情仍谨慎乐观。

经历了国内需求的强劲复苏，我们下半年更多关注外需逐步复苏给相关行业带来的投资机会，在资源价格仍处于相对低位，而需求稳步复苏的背景下，中游产业的利润改善也日益显著，创业板下半年或将推出，融资融券、股指期货等渐行渐进，相关的投资机会我们都将积极关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

关于长期停牌的股票估值说明

1、估值政策及重大变化：

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及本报告期损益的影响：

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述：

(1) 公司方面

公司建立基金估值委员会，组成人员包括：首席投资官、基金投资部总经理、研究发展部总经理、固定收益部负责人、金融工程部负责人、基金运营部总经理及相关负责人员。

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

宋磊，研究发展部总经理，工学硕士，曾在大鹏证券、上海申银万国证券研究所从事证券研究工作，2000 年 2 月加入华安基金管理公司，在基金研究发展部从事化工行业研究，现任研究发展部总经理。

黄勤，固定收益部负责人，经济学硕士，13 年银行、基金从业经历。曾在上海银行资金部从事债券投资、交易工作。2004 年 8 月加入华安基金管理公司，曾任固定收益部债券投资经理，现任华安富利基金的基金经理、固定收益部负责人。

许之彦，金融工程部负责人，理学博士，曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作，2005 年加入华安基金管理有限公司，曾任研究发展部数量策略分析师，现任华安中国 A 股基金经理，金融工程部负责人。

朱永红，基金运营部总经理，经济学学士，ACCA 英国特许公认会计师公会会员，CPA 中国注册会计师协会非执业会员。曾在上海众华沪银会计师事务所工作。2000 年 10 月加入华安基金管理公司，现任基金运营部总经理。

(2) 托管银行

托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，并且认真核查公司采用的估值政策和程序。

(3) 会计师事务所

对相关估值模型、假设及参数的适当性出具审核意见和报告。

4、基金经理参与或决定估值的程度：

本基金的基金经理未参与基金的估值。

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

本报告期由于基金投资当期亏损，不进行收益分配。

§ 5 托管人报告**5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

2009 年上半年度，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

2009 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。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2009 年上半年度，由华安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关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：2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
资 产:			
银行存款	6. 4. 6. 1	771, 355. 53	290, 056, 396. 20
结算备付金		266, 328, 640. 58	2, 490, 643. 56
存出保证金		3, 202, 234. 46	1, 492, 773. 59
交易性金融资产	6. 4. 6. 2	3, 731, 677, 422. 59	2, 625, 127, 750. 08
其中: 股票投资		2, 782, 860, 628. 39	1, 459, 486, 558. 53
基金投资		-	-
债券投资		948, 816, 794. 20	1, 165, 641, 191. 55
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 6. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 6. 4	-	-
应收证券清算款		15, 251, 370. 87	12, 928, 099. 59
应收利息	6. 4. 6. 5	16, 040, 180. 35	13, 216, 153. 16
应收股利		-	-
应收申购款		12, 110, 484. 86	6, 094, 981. 29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 6. 6	-	20, 000. 00
资产总计		4, 045, 381, 689. 24	2, 951, 426, 797. 47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009 年 6 月 30 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		10, 741, 701. 63	22, 387, 620. 99
应付赎回款		15, 460, 826. 32	27, 229, 236. 27
应付管理人报酬	6. 4. 9. 2. 1	3, 853, 381. 46	3, 006, 473. 01
应付托管费	6. 4. 9. 2. 2	802, 787. 81	626, 348. 57
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6. 4. 6. 7	6, 813, 640. 91	2, 461, 795. 34
应交税费		575, 764. 60	536, 312. 40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 6. 8	739, 707. 29	606, 061. 07
负债合计		38, 987, 810. 02	56, 853, 847. 65
所有者权益:			
实收基金	6. 4. 6. 9	4, 237, 033, 206. 42	4, 217, 954, 911. 77
未分配利润	6. 4. 6. 10	-230, 639, 327. 20	-1, 323, 381, 961. 95
所有者权益合计		4, 006, 393, 879. 22	2, 894, 572, 949. 82

负债和所有者权益总计		4,045,381,689.24	2,951,426,797.47
------------	--	------------------	------------------

注：1、报告截止日 2009 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.946 元，基金份额总额 4,237,033,206.42 份。

2、后附 6.4 报表附注为本财务报表的组成部分。

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

6.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2009 年 6 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
一、收入		1,150,457,799.33	-1,346,480,331.84
1. 利息收入		16,081,301.60	25,718,388.28
其中：存款利息收入	6.4.6.11	1,856,337.45	3,612,074.47
债券利息收入		14,224,964.15	22,106,313.81
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		540,018,868.37	-622,122,386.67
其中：股票投资收益	6.4.6.12	498,710,417.82	-635,565,523.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.6.13	31,904,157.83	-182,390.36
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.6.14	-	2,422,400.10
股利收益	6.4.6.15	9,404,292.72	11,203,127.26
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.6.16	593,538,567.00	-751,401,087.89
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.6.17	819,062.36	1,324,754.44
二、费用（以“-”号填列）		-45,430,916.42	-64,197,991.02
1. 管理人报酬	6.4.9.2.1	-20,830,167.81	-26,520,167.02
2. 托管费	6.4.9.2.2	-4,339,618.31	-5,525,034.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.6.18	-20,052,024.51	-25,761,724.96
5. 利息支出		-7,000.00	-6,182,372.13
其中：卖出回购金融资产支出		-7,000.00	-6,182,372.13
6. 其他费用	6.4.6.19	-202,105.79	-208,692.09

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1, 105, 026, 882. 91	-1, 410, 678, 322. 86
所得税费用（以“-”号填列）		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1, 105, 026, 882. 91	-1, 410, 678, 322. 86

注：1、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：华安宝利配置证券投资基金

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）	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, 105, 026, 882. 91	1, 105, 026, 882. 91
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）	19, 078, 294. 65	-12, 284, 248. 16	6, 794, 046. 49
其中：1. 基金申购款	909, 636, 425. 17	-134, 389, 763. 16	775, 246, 662. 01
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-890, 558, 130. 52	122, 105, 515. 00	-768, 452, 615. 52
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, 237, 033, 206. 42	-230, 639, 327. 2	4, 006, 393, 879. 22
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	2, 815, 001, 464. 89	419, 898, 532. 24	3, 234, 899, 997. 13

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-1,410,678,322.86	-1,410,678,322.86
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)	1,967,226,381.68	243,904,897.59	2,211,131,279.27
其中:1.基金申购款	3,111,292,429.85	236,153,975.16	3,347,446,405.01
2.基金赎回款(以“-”号填列)	-1,144,066,048.17	7,750,922.43	-1,136,315,125.74
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)	-	-113,819,868.53	-113,819,868.53
五、期末所有者权益(基金净值)	4,782,227,846.57	-860,694,761.56	3,921,533,085.01

注:1、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

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 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》、《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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2009 年 6 月 30 日的财务状况以及 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(b) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
活期存款	771,355.53
定期存款	-
其他存款	-
合计	771,355.53

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 6 月 30 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		2,420,972,984.52	2,782,860,628.39	361,887,643.87
债券	交易所市场	442,132,483.81	470,336,794.20	28,204,310.39
	银行间市场	476,424,747.94	478,480,000.00	2,055,252.06
	合计	918,557,231.75	948,816,794.20	30,259,562.45
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,339,530,216.27	3,731,677,422.59	392,147,206.32

6.4.6.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末(2009 年 6 月 30 日)衍生金融资产/负债余额为零。

6.4.6.4 买入返售金融资产

6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末(2009 年 6 月 30 日)买入返售金融资产余额为零。

6.4.6.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末(2009 年 6 月 30 日)无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,816.46
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	108,027.70
应收债券利息	15,923,092.01
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	7,211.60
其他	32.58
合计	16,040,180.35

6.4.6.6 其他资产

单位：人民币元

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

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	6,810,865.91
银行间市场应付交易费用	2,775.00
合计	6,813,640.91

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	51,270.00
预提费用	188,437.29
合计	739,707.29

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,217,954,911.77	4,217,954,911.77
本期申购	909,636,425.17	909,636,425.17
本期赎回	-890,558,130.52	-890,558,130.52
本期末	4,237,033,206.42	4,237,033,206.42

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.6.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

上年度末	-1,443,466,708.78	120,084,746.83	-1,323,381,961.95
本期利润	511,488,315.91	593,538,567.00	1,105,026,882.91
本期基金份额交易产生的变动数	-6,663,166.56	-5,621,081.60	-12,284,248.16
其中：基金申购款	-249,771,902.34	115,382,139.18	-134,389,763.16
基金赎回款	243,108,735.78	-121,003,220.78	122,105,515.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-938,641,559.43	708,002,232.23	-230,639,327.20

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	159,785.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,676,752.4
其他	19,799.82
合计	1,856,337.45

6.4.6.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,488,513,625.34
卖出股票成本总额	-5,989,803,207.52
买卖股票差价收入	498,710,417.82

6.4.6.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交金额	1,467,833,404.76
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-1,410,564,243.03
应收利息总额	-25,365,003.90
债券投资收益	31,904,157.83

6.4.6.14 衍生工具收益

本基金本期（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）无衍生工具收益。

6.4.6.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	9,404,292.72
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,404,292.72

6.4.6.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	
——股票投资	614,883,546.31
——债券投资	-21,344,979.31
——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	593,538.567.00

6.4.6.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	804,977.59
印花税手续费返还	7,030.06
债券差价补偿收入	-
其他	7,054.71
合计	819,062.36

注：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。基金之间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。

6.4.6.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	20,041,424.51
银行间市场交易费用	10,600.00
合计	20,052,024.51

6.4.6.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
审计费用	49,588.57
信息披露费	138,848.72
银行托管帐户维护费	9,000.00
银行汇划费用	4,668.50
合计	202,105.79

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

无。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.8 关联方关系

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

本报告期内未发生变化。

6.4.8.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华安基金管理有限公司(“华安基金”)	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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.9.1.1 股票交易

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

6.4.9.1.2 权证交易

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

6.4.9.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日)均无应支付关联方的佣金。

6.4.9.2 关联方报酬

6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的管理费	20,830,167.81	26,520,167.02
其中：当期已支付	16,976,786.35	22,493,037.46
期末未支付	3,853,381.46	4,027,129.56

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。

6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
当期应支付的托管费	4,339,618.31	5,525,034.82
其中：当期已支付	3,536,830.50	4,686,049.45
期末未支付	802,787.81	838,985.37

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.9.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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）均没有与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.9.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日
期初持有的基金份额	107,108,669.21	103,499,278.50
期间认购总份额	—	—
期间申购/买入总份额	—	3,609,390.71
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	107,108,669.21	107,108,669.21
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.53%	2.24%

6.4.9.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

基金管理公司主要股东及其控制的机构本报告期末（2009 年 6 月 30 日）和上年度末（2008 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

6.4.9.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	771,355.53	159,785.23	112,865,150.13	2,146,076.05

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息。于 2009 年 6 月 30 日的相关余额在资产负债表中的结算备付金”科目中单独列示(2008 年 6 月 30 日：同)。

6.4.9.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内（2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日）和上年度可比期间（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日）均不存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10 利润分配情况

6.4.10.1 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份 基金份额分红数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	利润分配 合计	备注
-	-	-	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-	-	-

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

6.4.11.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.11.1.1 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 流通受限	12.67	10.76	1,500,000	19,005,000.00	16,140,000.00
600169	太原重工	2009-5-25	预计 2009-12-29	非公开发行 送股转增部分	-	10.76	900,000	-	9,684,000.00
000887	中鼎	2009-2-12	预计	非公开发行	6.16	6.89	3,000,000	18,480,000.00	20,670,000.00

	股份		2010-2-22	流通受限					
000887	中鼎股份	2009-6-12	预计 2010-2-22	非公开发行 送股转增部 分	-	6.89	600,000	-	4,134,000.00
600239	云南城投	2009-4-14	预计 2010-4-12	非公开发行 流通受限	15.18	13.34	4,000,000	60,720,000.00	53,360,000.00
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	2,000,000	-	26,680,000.00

注：本报告期内本基金未持有流通受限债券以及其他证券类别。

6.4.11.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末（2009 年 6 月 30 日）未持有暂时停牌股票。

6.4.11.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金期末无正回购余额，因此没有债券作为抵押。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 风险管理政策和组织架构

本基金是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分析管理、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。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内。

6.4.12.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.12.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险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。

6.4.12.4 市场风险

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

6.4.12.4.1 利率风险

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

响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009 年 6 月 30 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	771,355.53	-	-	-	771,355.53
结算备付金	266,328,640.58	-	-	-	266,328,640.58
存出保证金	103,913.63	-	-	3,098,320.83	3,202,234.46
交易性金融资产	389,679,867.10	447,870,927.10	111,266,000.00	2,782,860,628.39	3,731,677,422.59
应收证券清算款	-	-	-	15,251,370.87	15,251,370.87
应收利息	-	-	-	16,040,180.35	16,040,180.35
应收申购款	10,191,569.47	-	-	1,918,915.39	12,110,484.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	667,075,346.31	447,870,927.10	111,266,000.00	2,819,169,415.83	4,045,381,689.24
负债					
应付证券清算款	-	-	-	10,741,701.63	10,741,701.63
应付赎回款	-	-	-	15,460,826.32	15,460,826.32
应付管理人报酬	-	-	-	3,853,381.46	3,853,381.46
应付托管费	-	-	-	802,787.81	802,787.81
应付交易费用	-	-	-	6,813,640.91	6,813,640.91
应交税费	-	-	-	575,764.60	575,764.60
其他负债	-	-	-	739,707.29	739,707.29
负债总计	-	-	-	38,987,810.02	38,987,810.02
利率敏感度缺口	667,075,346.31	447,870,927.10	111,266,000.00	2,780,181,605.81	4,006,393,879.22
本期末 2008 年 12 月 31 日	1 年以内	1 至 5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	290,056,396.20	-	-	-	290,056,396.20
结算备付金	2,490,643.56	-	-	-	2,490,643.56
存出保证金	101,282.05	-	-	1,391,491.54	1,492,773.59
交易性金融资产	117,468,591.50	866,561,751.71	181,610,848.34	1,459,486,558.53	2,625,127,750.08
应收证券清算款	-	-	-	12,928,099.59	12,928,099.59
应收利息	-	-	-	13,216,153.16	13,216,153.16

应收申购款	5,591,647.72	-	-	503,333.57	6,094,981.29
其他资产	-	-	-	20,000.00	20,000.00
资产总计	415,708,561.03	866,561,751.71	181,610,848.34	1,487,545,636.39	2,951,426,797.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	22,387,620.99	22,387,620.99
应付赎回款	-	-	-	27,229,236.27	27,229,236.27
应付管理人报酬	-	-	-	3,006,473.01	3,006,473.01
应付托管费	-	-	-	626,348.57	626,348.57
应付交易费用	-	-	-	2,461,795.34	2,461,795.34
应交税费	-	-	-	536,312.40	536,312.40
其他负债	-	-	-	606,061.07	606,061.07
负债总计	-	-	-	56,853,847.65	56,853,847.65
利率敏感度缺口	415,708,561.03	866,561,751.71	181,610,848.34	1,430,691,788.74	2,894,572,949.82

6.4.12.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：万元）	
		本期末（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 94	增加约 1,155
	2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 93	下降约 1,135

6.4.12.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.12.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中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%。

6.4.12.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 6 月 30 日		上年度末 2008 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	2,782,860,628.39	69.46	1,459,486,558.53	50.42
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,782,860,628.39	69.46	1,459,486,558.53	50.42

6.4.12.4.3.2 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：亿元）	
		本期末（2009 年 6 月 30 日）	上年度末（2008 年 12 月 31 日）
	1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 1.95	增加约 0.97
	2. 业绩比较基准下降 5%	下降约 1.93	下降约 0.97

6.4.13 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项
无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,782,860,628.39	68.79
	其中：股票	2,782,860,628.39	68.79
2	固定收益投资	948,816,794.20	23.45
	其中：债券	948,816,794.20	23.45
	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	267,099,996.11	6.60
6	其他资产	46,604,270.54	1.15
7	合计	4,045,381,689.24	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	12,730,000.00	0.32
B	采掘业	50,655,000.00	1.26
C	制造业	932,860,795.91	23.28
C0	食品、饮料	89,965,174.55	2.25
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	65,447,439.10	1.63
C5	电子	15,897,502.85	0.40
C6	金属、非金属	169,764,288.91	4.24
C7	机械、设备、仪表	348,952,197.89	8.71
C8	医药、生物制品	207,396,442.61	5.18
C99	其他制造业	35,437,750.00	0.88
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	42,568,124.76	1.06
F	交通运输、仓储业	137,210,659.28	3.42
G	信息技术业	85,162,000.00	2.13
H	批发和零售贸易	273,715,213.97	6.83
I	金融、保险业	703,500,861.38	17.56
J	房地产业	296,478,137.52	7.40
K	社会服务业	92,602,886.20	2.31
L	传播与文化产业	47,236,328.97	1.18
M	综合类	108,140,620.40	2.70
	合计	2,782,860,628.39	69.46

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	3,300,000	163,218,000.00	4.07
2	600837	海通证券	7,502,700	123,419,415.00	3.08
3	000002	万科A	9,000,000	114,750,000.00	2.86
4	600036	招商银行	5,000,000	112,050,000.00	2.80
5	601166	兴业银行	2,700,000	100,197,000.00	2.50
6	600690	青岛海尔	7,000,000	92,820,000.00	2.32
7	002202	金风科技	2,780,436	83,746,732.32	2.09

8	600239	云南城投	6,000,000	80,040,000.00	2.00
9	000061	农 产 品	6,268,000	71,329,840.00	1.78
10	000069	华侨城 A	3,293,918	68,842,886.20	1.72
11	600739	辽宁成大	1,957,798	64,842,269.76	1.62
12	002024	苏宁电器	4,000,000	64,280,000.00	1.60
13	601333	广深铁路	12,000,000	61,320,000.00	1.53
14	600320	振华重工	5,848,959	60,829,173.60	1.52
15	601169	北京银行	3,500,000	56,910,000.00	1.42
16	601398	工商银行	10,000,000	54,200,000.00	1.35
17	000839	中信国安	3,500,000	51,590,000.00	1.29
18	002233	塔牌集团	3,482,929	51,512,519.91	1.29
19	600162	香江控股	5,574,232	47,994,137.52	1.20
20	600016	民生银行	6,000,000	47,520,000.00	1.19
21	600479	千金药业	2,738,805	47,381,326.50	1.18
22	000917	电广传媒	3,073,281	47,236,328.97	1.18
23	601601	中国太保	2,054,801	45,986,446.38	1.15
24	000895	双汇发展	1,275,692	45,924,912.00	1.15
25	601186	中国铁建	4,136,844	42,568,124.76	1.06
26	002080	中材科技	1,504,983	41,086,035.90	1.03
27	000028	一致药业	2,128,400	40,226,760.00	1.00
28	000538	云南白药	1,074,720	37,615,200.00	0.94
29	600549	厦门钨业	2,011,522	37,313,733.10	0.93
30	601899	紫金矿业	3,500,000	35,700,000.00	0.89
31	002017	东信和平	3,095,000	35,437,750.00	0.88
32	600770	综艺股份	2,448,993	34,041,002.70	0.85
33	600570	恒生电子	2,800,000	33,572,000.00	0.84
34	600223	ST 万杰	3,665,095	33,205,760.70	0.83
35	600415	小商品城	800,000	32,912,000.00	0.82
36	600195	中牧股份	1,584,441	32,560,262.55	0.81
37	600869	三普药业	2,132,245	32,282,189.30	0.81
38	600683	银泰股份	2,850,000	31,692,000.00	0.79
39	600169	太原重工	2,825,869	31,671,181.37	0.79
40	600748	上实发展	1,800,000	31,104,000.00	0.78
41	000423	东阿阿胶	1,700,000	30,498,000.00	0.76
42	600428	中远航运	2,654,000	27,521,980.00	0.69
43	601919	中国远洋	2,000,000	27,140,000.00	0.68
44	000422	湖北宜化	2,300,000	26,335,000.00	0.66
45	000887	中鼎股份	3,600,000	24,804,000.00	0.62
46	600527	江南高纤	3,990,500	24,541,575.00	0.61
47	600236	桂冠电力	3,000,000	23,760,000.00	0.59
48	000951	中国重汽	993,000	23,732,700.00	0.59

49	000709	唐钢股份	3,000,000	23,460,000.00	0.59
50	600694	大商股份	700,099	22,956,246.21	0.57
51	600325	华发股份	1,000,000	22,590,000.00	0.56
52	600087	长航油运	3,429,512	21,228,679.28	0.53
53	600196	复星医药	1,338,369	19,392,966.81	0.48
54	600280	南京中商	1,169,275	18,614,858.00	0.46
55	600399	抚顺特钢	2,400,000	16,392,000.00	0.41
56	002055	得润电子	2,133,893	15,897,502.85	0.40
57	002152	广电运通	600,000	15,420,000.00	0.38
58	601088	中国神华	500,000	14,955,000.00	0.37
59	600486	扬农化工	453,921	14,570,864.10	0.36
60	002028	思源电气	599,920	13,156,245.60	0.33
61	100598	北大荒	1,000,000	12,730,000.00	0.32
62	000568	泸州老窖	400,000	11,480,000.00	0.29
63	600858	银座股份	401,300	7,981,857.00	0.20
64	600587	新华医疗	209,220	2,772,165.00	0.07

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

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	600030	中信证券	204,783,139.93	7.07
2	601318	中国平安	202,111,523.52	6.98
3	000002	万科A	160,144,965.05	5.53
4	600028	中国石化	150,256,691.46	5.19
5	601601	中国太保	138,950,807.25	4.80
6	002024	苏宁电器	128,250,858.98	4.43
7	601919	中国远洋	125,179,942.47	4.32
8	000527	美的电器	119,533,638.70	4.13
9	601186	中国铁建	117,638,172.33	4.06
10	600690	青岛海尔	114,833,745.35	3.97
11	601169	北京银行	111,691,154.80	3.86
12	600837	海通证券	109,511,990.68	3.78
13	601398	工商银行	106,793,285.28	3.69
14	600001	邯郸钢铁	98,144,316.25	3.39
15	600016	民生银行	96,348,293.06	3.33
16	600000	浦发银行	96,072,443.73	3.32
17	600739	辽宁成大	89,865,647.54	3.10
18	600635	大众公用	85,088,813.96	2.94
19	601166	兴业银行	84,399,689.94	2.92

20	000061	农产品	79,425,767.36	2.74
21	600598	北大荒	75,822,604.13	2.62
22	002202	金风科技	73,282,687.71	2.53
23	601939	建设银行	71,908,829.96	2.48
24	600123	兰花科创	70,812,803.74	2.45
25	601628	中国人寿	69,114,923.29	2.39
26	601333	广深铁路	67,747,870.61	2.34
27	600048	保利地产	63,917,906.08	2.21
28	000069	华侨城 A	63,505,472.54	2.19
29	600239	云南城投	60,720,000.00	2.10
30	000024	招商地产	60,208,161.02	2.08
31	600694	大商股份	58,225,632.64	2.01

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。

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	244,968,432.89	8.46
2	601088	中国神华	215,990,704.25	7.46
3	600028	中国石化	158,994,767.69	5.49
4	601601	中国太保	149,182,575.69	5.15
5	000527	美的电器	133,934,781.01	4.63
6	600000	浦发银行	113,396,367.22	3.92
7	600001	邯郸钢铁	108,788,911.85	3.76
8	601919	中国远洋	105,277,386.00	3.64
9	601398	工商银行	97,146,876.54	3.36
10	600598	北大荒	95,556,148.54	3.30
11	600635	大众公用	94,463,544.71	3.26
12	601186	中国铁建	93,669,877.85	3.24
13	600048	保利地产	91,189,770.26	3.15
14	601169	北京银行	88,977,053.17	3.07
15	000002	万科 A	84,228,301.57	2.91
16	002024	苏宁电器	83,464,029.46	2.88
17	600123	兰花科创	81,237,642.32	2.81
18	601666	平煤股份	80,688,669.67	2.79
19	000792	盐湖钾肥	72,639,080.99	2.51
20	601628	中国人寿	71,219,484.21	2.46
21	000024	招商地产	70,797,073.30	2.45
22	601939	建设银行	69,615,976.90	2.41
23	600037	歌华有线	68,792,305.81	2.38
24	600026	中海发展	67,693,772.08	2.34

25	601318	中国平安	66,036,590.10	2.28
26	600415	小商品城	65,918,027.55	2.28
27	600352	浙江龙盛	60,570,060.94	2.09
28	000898	鞍钢股份	60,242,883.49	2.08
29	601009	南京银行	59,557,980.92	2.06
30	600005	武钢股份	58,502,090.30	2.02

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	6,698,293,731.07
卖出股票收入（成交）总额	6,488,513,625.34

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	209,227,982.00	5.22
2	央行票据	152,735,000.00	3.81
3	金融债券	202,099,000.00	5.04
	其中：政策性金融债	202,099,000.00	5.04
4	企业债券	265,906,799.10	6.64
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	118,848,013.10	2.97
7	其他	-	-
8	合计	948,816,794.20	23.68

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	009908	99 国债(8)	937,220	94,378,054.00	2.36
2	010203	02 国债(3)	753,520	76,406,928.00	1.91
3	126002	06 中化债	698,870	64,198,198.20	1.60
4	088050	08 渝城投债	500,000	52,440,000.00	1.31
5	0801017	08 央票 17	500,000	52,295,000.00	1.31

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，在报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	3,202,234.46
2	应收证券清算款	15,251,370.87
3	应收股利	—
4	应收利息	16,040,180.35
5	应收申购款	12,110,484.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	46,604,270.54

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	110002	南山转债	49,069,976.00	1.22
2	110003	新钢转债	32,229,769.60	0.80
3	110598	大荒转债	27,955,542.60	0.70
4	128031	巨轮转债	6,637,024.90	0.17
5	125960	锡业转债	2,955,700.00	0.07

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	80,040,000.00	2.00	非公开发行股票

§ 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

185,307	22,864.94	797,570,963.48	18.82%	3,439,462,242.94	81.18%
---------	-----------	----------------	--------	------------------	--------

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	185,938.42	0.0044%

§ 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
报告期期初基金份额总额	4,217,954,911.77
报告期期间基金总申购份额	909,636,425.17
报告期期间基金总赎回份额	-890,558,130.52
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	4,237,033,206.42

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

10.5 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。

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

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

10.7 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	
渤海证券有限责任公司	1	516,127,035.90	3.94%	438,708.97	3.99%	—
长城证券有限责任公司	1	258,857,266.57	1.97%	220,027.31	2.00%	—
中银国际证券有限责任公司	1	799,045,680.85	6.10%	679,194.75	6.17%	—
海通证券股份有限公司	1	2,478,933,303.08	18.91%	2,014,150.57	18.31%	—
红塔证券股份有限公司	1	3,101,910,076.78	23.66%	2,636,613.10	23.96%	—
中信建投证券有限责任公司	1	1,247,545,701.23	9.52%	1,013,640.36	9.21%	—
申银万国证券股份有限公司	1	1,946,064,744.22	14.85%	1,654,149.73	15.03%	—
兴业证券股份有限公司	1	1,738,699,487.28	13.26%	1,477,880.40	13.43%	—
中信证券股份有限公司	1	1,020,969,310.50	7.79%	867,818.99	7.89%	—

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购交易		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	
渤海证券有限责任公司	1	13,888,630.30	2.27%	—	—	—
长城证券有限责任公司	1	1,722,276.00	0.28%	—	—	—
中银国际证券有限责任公司	1	59,515,756.80	9.74%	50,000,000.00	25.00%	—
海通证券股份有限公司	1	39,859,645.31	6.52%	—	—	—
红塔证券股份有限公司	1	88,910,010.30	14.54%	60,000,000.00	30.00%	—
中信建投证券有限责任公司	1	48,116,393.25	7.87%	—	—	—
申银万国证券股份有限公司	1	106,082,786.80	17.35%	90,000,000.00	45.00%	—

兴业证券股份 有限公司	1	39,238,441.70	6.42%	—	—	—
中信证券股份 有限公司	1	213,955,509.00	35.00%	—	—	—

注：1、本报告期内，本基金交易单元没有变更。

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/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。

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	关于新增上海银行为华安宝利配置证券投资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	2009-01-08
2	关于参加深圳发展银行基金定期定额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	2009-01-09
3	关于新增东海证券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	2009-01-09
4	关于参加中国光大银行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》	2009-01-20

		和公司网站	
5	关于基金电子直销推出中国农业银行金穗卡持有人定期定额申购业务及相关交易费率调整的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-01-21
6	关于新增江南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	2009-01-21
7	关于新增上海农村商业银行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	2009-02-05
8	关于提请投资者及时更新身份证明文件的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-02-14
9	关于旗下基金投资中鼎股份（000887）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-02-14
10	关于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	2009-02-25
11	关于参加中国工商银行股份有限公司基智定投业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-02-26
12	关于新增恒泰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	2009-03-12
13	关于参加江海证券经纪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	2009-03-13
14	关于新增江海证券经纪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	2009-03-13
15	关于新增兴业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	2009-03-18
16	关于参加兴业银行股份有限公司电子渠道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	2009-03-18
17	关于新增国盛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	2009-03-24
18	关于新增国金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	2009-03-26

19	关于在山西证券股份有限公司开通旗下基金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	2009-03-26
20	关于开通电子直销平台后端定期定额投资业务及调低旗下开放式基金定期定额投资申购金额下限的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-03-31
21	关于参加中国工商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	2009-03-31
22	关于旗下基金投资云南城投（600239）非公开发行股票的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-04-16
23	关于新增天相投资顾问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	2009-05-07
24	关于电子直销平台开通“华安-建行 e 付通”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	2009-05-15
25	关于在中国银行开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-05-20
26	关于新增爱建证券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	2009-06-02
27	关于新增临商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	2009-06-09
28	关于参加兴业银行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	2009-06-10
29	关于电子直销平台开通“定期不定额”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	2009-07-01
30	关于在中国邮政储蓄银行有限责任公司延长定期定额投资优惠活动时间公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-07-01
31	关于新增华夏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	2009-07-08
32	关于电子直销平台“华安—民生银基通”基金电子交易业务升级的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-07-20
33	关于参加华夏银行网上银行基金申购	《上海证券报》、《证券	2009-07-21

	费率优惠活动和定期定额申购费率优惠活动的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
34	关于在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-07-23
35	关于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	2009-08-03
36	关于在渤海证券股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-08-06
37	关于在华夏银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-08-06
38	关于运用固有资金进行开放式基金投资的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-08-20
39	关于新增中国国际金融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	2009-08-22
40	关于调整旗下部分开放式基金前端申购费率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2009-08-22

§ 11 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；
- 9、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