

华安宝利配置证券投资基金 2008 年年度报告

2008 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
送出日期：2009 年 3 月 26 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 2009 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2008 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、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合规守信情况的说明.....	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.....	11
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.....	13
§ 5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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
§ 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.....	19
§ 8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	38
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	43
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.....	43
8.9 投资组合报告附注.....	43
§ 9 基金份额持有人信息.....	44
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
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.....	44
§ 10 开放式基金份额变动.....	44
§ 11 重大事件揭示.....	44
11.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4 基金投资策略的改变.....	45
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
11.8 其他重大事件.....	47
§ 12 备查文件目录.....	53

§ 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	
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	4,217,954,911.77 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.cn	zhangyd@bankcomm.com
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://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	会计师事务所	注册登记机构
名称	普华永道中天会计师事务所有限公司	华安基金管理有限公司
办公地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼	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、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	2008 年	2007 年	2006 年
本期已实现收益	-1,629,775,432.98	1,609,630,194.39	714,888,931.66
本期利润	-2,037,254,863.10	1,634,175,911.37	838,068,249.74
加权平均基金份额本期利润	-0.4516	0.8792	1.0880
本期加权平均净值利润率	-52.95%	65.12%	75.15%
本期基金份额净值增长率	-38.20%	108.00%	124.82%
3.1.2 期末数据和指标	2008 年	2007 年	2006 年

期末可供分配利润	-1,443,466,708.78	122,680,051.48	43,861,245.25
期末可供分配基金份额利润	-0.3422	0.0436	0.0298
期末基金资产净值	2,894,572,949.82	3,234,899,997.13	1,699,034,787.31
期末基金份额净值	0.686	1.149	1.153
3.1.3 累计期末指标	2008 年	2007 年	2006 年
基金份额累计净值增长率	226.52%	428.34%	154.01%

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
过去三个月	-7.55%	1.60%	-5.10%	1.07%	-2.45%	0.53%
过去六个月	-16.34%	1.59%	-11.15%	1.03%	-5.19%	0.56%
过去一年	-38.20%	1.68%	-30.84%	1.22%	-7.36%	0.46%
过去三年	189.01%	1.49%	54.49%	1.08%	134.52%	0.41%
自基金合同生效起至今	226.52%	1.30%	54.33%	0.94%	172.19%	0.36%

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 2008 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

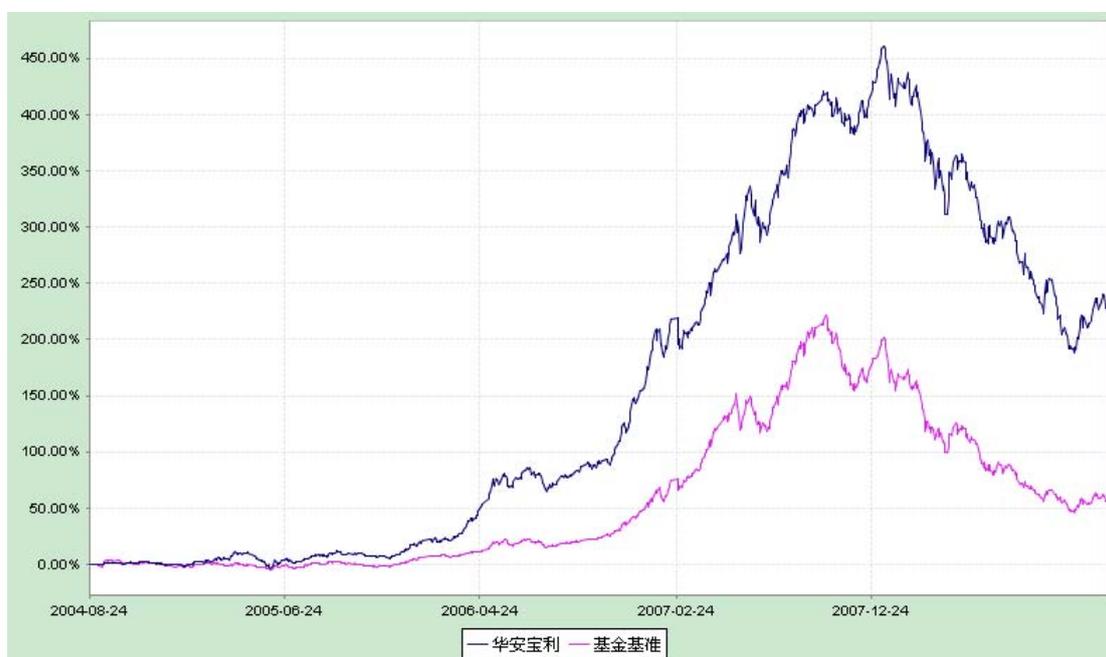
基金资产净值的比例为 11.83%，其中所对应的基础股票的投资比例为资产净值的 6.15%；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的比例为 34.59%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的比例为 44.27%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

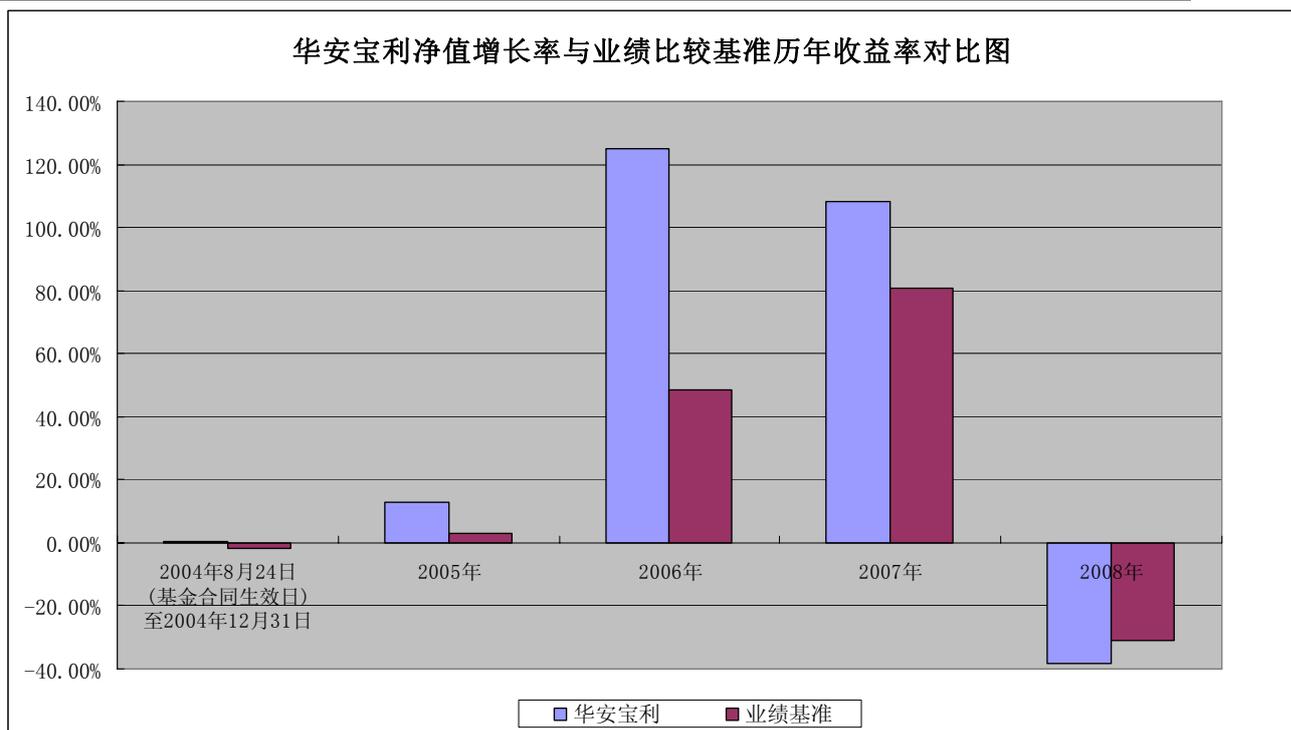
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2004 年 8 月 24 日至 2008 年 12 月 31 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。

3.2.3 自基金合同生效以来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



注：基金合同生效以来未满 5 年，图示为基金合同生效以来各年度的数据，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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
2008年	0.400	53,862,625.81	59,957,242.72	113,819,868.53	为2007年度批准、公告但在本年度实施的利润分配。
2007年	11.000	758,088,305.17	979,328,218.05	1,737,416,523.22	-
2006年	10.900	333,818,379.78	287,645,883.12	621,464,262.90	-
合计	22.300	1,145,769,310.76	1,326,931,343.89	2,472,700,654.65	-

§ 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 2008 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了基金安信、基金安顺 2 只封闭式证券投资基金，华安创新、华安中国 A 股、华安富利、华安宝利、上证 180ETF、华安宏利、华安中小盘成长、华安策略优选、华安核心优选、华安稳定收益、华安国际配置(QDII)等 11 只开放式基金，管理资产规模达到 694.94 亿人民币、0.97 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		
袁蓓	本基金的基金经理	2004 年 8 月 24 日	2008 年 4 月 25 日	8 年	经济学学士，8 年证券从业经历。曾在中国平安保险（集团）股份有限公司投资管理中心工作，任首席交易员、债券交易室主任、债券投资组副主任。2003 年 1 月加入华安基金管理有限公司，在基金投资部从事证券投资和研究工作，自 2004 年 7 月至 2008 年 4 月任本基金的基金经理。
邓跃辉	本基金的基金经理	2008 年 4 月 25 日	-	6 年	毕业于上海财经大学，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
--	--	--	--	--

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

按照华安宝利的基金合同，华安宝利属于配置型基金，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

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

(1) 行情回顾

2008年的A股市场经历了有史以来的最大跌幅，沪深300指数下跌65.95%，全年而言，下跌几乎以单边走低的方式完成，幅度之大超出了大部分投资人的预期。

高估的A股市场、大小非的持续减持、金融危机的逐步蔓延等综合因素导致了本年度不同寻常的深度调整。

(2) 操作回顾

本基金全年单位净值下跌38.20%，虽在同类基金中排名居前，但无论下跌幅度还是净值缩水的绝对金额都相当可观，我们有许多经验值得总结。

全年而言，本基金操作整体以控制仓位为先，年初和4月份两次较大幅度的减仓行为为净值表现做出了主要贡献，但9月底本基金有次较大幅度的加仓，时机略显偏早，海外市场的深幅下跌一定程度上超出了我们的预期，证券市场的全球化是我们未来基金投资操作中越来越需要关注的变量。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2009年，世界经济仍将步履蹒跚。欧美等发达国家遭遇了巨额财富缩水，去杠杆化趋势或许将对其消费习惯产生深远影响，我国出口形势不容乐观，产能过剩将在未来相当一段时间困扰中国企业。

另一方面，力度越来越大的经济刺激政策陆续出台，四万亿投资计划及日益宽松的货币政策为寒冬中的经济带来了丝丝暖意，政府随时准备出手更坚决有力的措施也给我们的投资增强了信心。

我们认为，中国企业经历了多年的风风雨雨，资质日益优良，中国作为世界制造中心具有绝对的竞争优势，金融危机一方面将促使了企业的产业升级，另一方面也有利于先进技术的引进消化，虽然A股仍面临短期业绩的困扰，但已深幅调整的A股市场、日益宽松的货币政策和空间尚存的财政政策让我们日益乐观，如果以“伤情”来回首“2008”，那就让我们用“期待”来展望“2009”。

2009年我们关注深度回调后的优质龙头企业、关注整合并购的投资机会、也关注新行业、新模式、新技术等投资方向。

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，公司合规监察工作以保障公司合规运作、维护基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部对公司后台运行、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，强化员工的合规意识，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) 积极配合公司管理层深化“主动合规”的管理理念，在完善公司合规政策的同时，颁布了公司《合规手册》，进一步明确了公司董事会、管理层、各部门的合规职责，细化了公司在业务运作、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合规标准；

(2) 推行合规员制度，在各业务部门设立了部门合规员岗位，将合规控制、风险管理落实在业务第一线；

(3) 合规监察稽核部门经常性地组织员工进行法律法规的学习与培训，提高员工的合规意识；

(4) 组织投资、研究、交易等相关部门落实中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，开展基金交易价差分析，防范利益输送；

(5) 进一步完善投资交易系统控制功能, 提高合规监察效率;

(6) 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外, 还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

关于长期停牌的股票估值说明

1、估值政策及重大变化:

根据中国证监会 [2008] 年 38 号公告《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》, 经与托管银行协商, 自 2008 年 9 月 16 日起, 对本基金的估值原则作如下调整:

(1) 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, 以最近交易日的收盘价估值。

(2) 估值日无交易, 且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件, 使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的, 参考《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》, 采用指数收益法, 调整最近交易日收盘价, 确定公允价值进行估值。

如有确凿证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实反映股票的公允价值, 基金将与基金托管行协商采用其它估值方法, 对停牌股票进行估值。

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, 12 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

1、2007 年度批准、公告但在本年度实施的利润分配:

向全体持有人按每 10 份基金份额收益分配金额 0.40 元。红利发放的公告日: 2007

年 12 月 27 日，权益登记日、除息日：2008 年 1 月 7 日，红利划出日、红利再投资日：2008 年 1 月 8 日。

2、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

2008 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

2008 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，该基金本报告期内利润分配共计 113,819,868.53 元。

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

2008 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(2009)第 20106 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 2008 年 12 月 31 日的资产负债表、2008 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、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允许的基金行业实务操作的有关规定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。

二、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。

三、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中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华安宝利配置基金 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 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 薛 竞

中国·上海市
2009 年 3 月 25 日

注册会计师 金 毅

§ 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：2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
资 产：			

银行存款	7.4.7.1	290,056,396.20	114,223,202.81
结算备付金		2,490,643.56	217,804,209.03
存出保证金		1,492,773.59	1,842,527.51
交易性金融资产	7.4.7.2	2,625,127,750.08	2,887,457,269.02
其中：股票投资		1,459,486,558.53	2,020,380,319.72
基金投资		-	-
债券投资		1,165,641,191.55	867,076,949.30
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	495,534.08
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		12,928,099.59	6,659,692.17
应收利息	7.4.7.5	13,216,153.16	15,157,692.50
应收股利		-	-
应收申购款		6,094,981.29	17,071,494.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	20,000.00	-
资产总计		2,951,426,797.47	3,260,711,621.79
负债和所有者权益	附注号	本期末 2008年12月31日	上年度末 2007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		22,387,620.99	3,880,673.22
应付赎回款		27,229,236.27	15,459,201.95
应付管理人报酬	7.4.10.2.1	3,006,473.01	3,135,729.05
应付托管费	7.4.10.2.2	626,348.57	653,276.89
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,461,795.34	1,353,713.87
应交税费		536,312.40	505,937.20
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	606,061.07	823,092.48
负债合计		56,853,847.65	25,811,624.66
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,217,954,911.77	2,815,001,464.89
未分配利润	7.4.7.10	-1,323,381,961.95	419,898,532.24
所有者权益合计		2,894,572,949.82	3,234,899,997.13
负债和所有者权益总计		2,951,426,797.47	3,260,711,621.79

注：1、报告截止日 2008 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.686 元，基金份额总额 4,217,954,911.77

份。

2、后附 7.4 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

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：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
一、收入		-1,935,047,523.05	1,706,590,978.99
1. 利息收入		48,530,394.32	22,499,913.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,618,696.80	4,207,021.23
债券利息收入		42,911,697.52	18,199,655.02
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	93,237.47
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,578,121,343.50	1,651,829,727.41
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,605,087,999.28	1,531,768,585.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,278,158.68	81,665,800.49
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	2,684,471.49	29,257,932.69
股利收益	7.4.7.15	16,004,025.61	9,137,408.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-407,479,430.12	24,545,716.98
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	2,022,856.25	7,715,620.88
二、费用（以“-”号填列）		-102,207,340.05	-72,415,067.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	-46,415,668.49	-29,968,161.26
2. 托管费	7.4.10.2.2	-9,669,930.98	-6,243,366.88
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	-39,298,760.73	-27,329,264.25
5. 利息支出		-6,413,894.33	-8,467,529.75
其中：卖出回购金融资产支出		-6,413,894.33	-8,467,529.75

6. 其他费用	7. 4. 7. 19	-409, 085. 52	-406, 745. 48
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2, 037, 254, 863. 10	1, 634, 175, 911. 37
所得税费用(以“-”号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2, 037, 254, 863. 10	1, 634, 175, 911. 37

注：1、后附 7.4 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

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：2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 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）	2, 815, 001, 464. 89	419, 898, 532. 24	3, 234, 899, 997. 13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-2, 037, 254, 863. 10	-2, 037, 254, 863. 10
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, 402, 953, 446. 88	407, 794, 237. 44	1, 810, 747, 684. 32
其中：1. 基金申购款	3, 379, 001, 544. 06	164, 665, 788. 43	3, 543, 667, 332. 49
2. 基金赎回款（以“-”号填列）	-1, 976, 048, 097. 18	243, 128, 449. 01	-1, 732, 919, 648. 17
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, 217, 954, 911. 77	-1, 323, 381, 961. 95	2, 894, 572, 949. 82
项目	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 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)	1, 473, 522, 718. 96	225, 512, 068. 35	1, 699, 034, 787. 31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1, 634, 175, 911. 37	1, 634, 175, 911. 37
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, 341, 478, 745. 93	297, 627, 075. 74	1, 639, 105, 821. 67
其中: 1. 基金申购款	4, 158, 604, 984. 81	1, 248, 839, 032. 09	5, 407, 444, 016. 90
2. 基金赎回款(以“-”号填列)	-2, 817, 126, 238. 88	-951, 211, 956. 35	-3, 768, 338, 195. 23
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)	-	-1, 737, 416, 523. 22	-1, 737, 416, 523. 22
五、期末所有者权益 (基金净值)	2, 815, 001, 464. 89	419, 898, 532. 24	3, 234, 899, 997. 13

注: 1、后附 7.4 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

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 2009 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如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2008 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 2008 年 12 月 31 日的财务状况以及 2008 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

(i) 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。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、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。

(ii) 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。本基金目前暂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；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，应当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。

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，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：

(i) 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。

(ii) 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。

(iii) 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利得/(损失)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也可按直线法计算。

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 其他重要的会计政策和会计估计

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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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。

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》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) 基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 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 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
活期存款	290,056,396.20	114,223,202.81
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	290,056,396.20	114,223,202.81

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2008 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		1,712,482,460.97	1,459,486,558.53	-252,995,902.44
债券	交易所市场	321,705,148.15	341,581,191.55	19,876,043.40
	银行间市场	792,331,501.64	824,060,000.00	31,728,498.36
	合计	1,114,036,649.79	1,165,641,191.55	51,604,541.76
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,826,519,110.76	2,625,127,750.08	-201,391,360.68
项目		上年度末 2007 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		1,812,242,639.35	2,020,380,319.72	208,137,680.37
债券	交易所市场	115,553,841.74	113,760,949.30	-1,792,892.44
	银行间市场	753,594,916.67	753,316,000.00	-278,916.67
	合计	869,148,758.41	867,076,949.30	-2,071,809.11
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,681,391,397.76	2,887,457,269.02	206,065,871.26

注：于 2008 年 12 月 31 日，债券投资中银行间同业市场交易债券均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公司独立提供；采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动收益为 32,007,415.03 元(2007 年度：公允价值变动损失为 281,224.28 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2007 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注（投资 成本）
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	495,534.08	-	473,335.90
权证	-	495,534.08	-	473,335.90
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	495,534.08	-	473,335.90

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(2008 年 12 月 31 日)及比较报告期末(2007 年 12 月 31 日)买入返售金融资产余额为零。

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(2008 年 12 月 31 日)及比较报告期末(2007 年 12 月 31 日)均无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	19,883.69	49,864.25
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	81,162.96	99,140.20
应收债券利息	13,114,584.27	14,993,514.44
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	476.64	15,128.01
其他	45.6	45.60
合计	13,216,153.16	15,157,692.50

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
其他应收款	20,000.00	-
待摊费用	-	-
合计	20,000.00	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	2,452,895.34	1,342,002.00
银行间市场应付交易费用	8,900.00	11,711.87
合计	2,461,795.34	1,353,713.87

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2008 年 12 月 31 日	上年度末 2007 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	6,061.07	63,092.48
预提费用	100,000.00	260,000.00
合计	606,061.07	823,092.48

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,815,001,464.89	2,815,001,464.89
本期申购	3,379,001,544.06	3,379,001,544.06
本期赎回	-1,976,048,097.18	-1,976,048,097.18
本期末	4,217,954,911.77	4,217,954,911.77

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	122,680,051.48	297,218,480.76	419,898,532.24
本期利润	-1,629,775,432.98	-407,479,430.12	-2,037,254,863.10
本期基金份额交易产生的变动数	177,448,541.25	230,345,696.19	407,794,237.44
其中：基金申购款	-49,620,215.67	214,286,004.10	164,665,788.43
基金赎回款	227,068,756.92	16,059,692.09	243,128,449.01
本期已分配利润	-113,819,868.53	-	-113,819,868.53
本期末	-1,443,466,708.78	120,084,746.83	-1,323,381,961.95

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	2,831,910.98	2,742,175.12
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	2,656,963.79	1,164,345.96
其他	129,822.03	300,500.15
合计	5,618,696.80	4,207,021.23

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	7,308,234,044.64	4,412,168,182.90
卖出股票成本总额	-8,913,322,043.92	-2,880,399,597.03
买卖股票差价收入	-1,605,087,999.28	1,531,768,585.87

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2008年1月1日至2008年12 月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007年12 月31日
卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成交金额	4,403,979,689.35	1,894,397,801.59
卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	-4,337,334,549.24	-1,779,276,117.18
应收利息总额	-58,366,981.43	-33,455,883.92
债券投资收益	8,278,158.68	81,665,800.49

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 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
卖出权证成交金额	9,937,106.12	135,225,332.08
卖出权证成本总额	-7,252,634.63	-105,967,399.39
买卖权证差价收入	2,684,471.49	29,257,932.69

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	16,004,025.61	9,137,408.36
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	16,004,025.61	9,137,408.36

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产		
——股票投资	-461,133,582.81	41,440,954.16
——债券投资	53,676,350.87	-9,682,814.21
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具		
——权证投资	-22,198.18	-7,212,422.97
3. 其他	-	-
合计	-407,479,430.12	24,545,716.98

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,009,074.26	4,566,211.49
印花税手续费返还	13,781.99	-
债券差价补偿收入	-	3,141,293.94
其他	-	8,115.45
合计	2,022,856.25	7,715,620.88

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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12

	月 31 日	月 31 日
交易所市场交易费用	39,268,123.23	27,302,597.60
银行间市场交易费用	30,637.50	26,666.65
合计	39,298,760.73	27,329,264.25

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	260,000.00	260,000.00
银行托管帐户维护费	18,000.00	18,000.00
银行汇划费用	31,085.52	28,745.48
合计	409,085.52	406,745.48

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

无。

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(“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
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
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	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

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(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 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(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2007 年 1 月 1 日至 2007 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（2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日）和上年度可比期间（2007 年 1 月 1 日至 2007 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 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的管理费	46,415,668.49	29,968,161.26
其中：当期已支付	43,409,195.48	26,832,432.21
期末未支付	3,006,473.01	3,135,729.05

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 12 月 31 日
当期应支付的托管费	9,669,930.98	6,243,366.88
其中：当期已支付	9,043,582.41	5,590,089.99
期末未支付	626,348.57	653,276.89

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。

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 2008 年 1 月 1 日至 2008 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	105,973,986.71	61,432,897.94	-	-	198,000,000.00	46,981.56
上年度可比期间 2007 年 1 月 1 日至 2007 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	-	99,939,600.00	-	-	753,800,000.00	703,242.71
------------	---	---------------	---	---	----------------	------------

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 2008年1月1日至2008 年12月31日	上年度可比期间 2007年1月1日至2007 年12月31日
期初持有的基金份额	103,499,278.50	50,000,000.00
期间认购总份额	-	-
期间申购/买入总份额	3,609,390.71	53,499,278.50
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	103,499,278.50
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.54%	3.68%

注：本年度华安基金公司持有的基金份额增加皆为红利再投资所获得。1月9日分红4,139,971.14元，转份额3,609,390.71份。

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（2008年12月31日）和上年度末（2007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 2008年1月1日至2008年12月31日		上年度可比期间 2007年1月1日至2007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	290,056,396.20	2,831,910.98	114,223,202.81	2,742,175.12

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2008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（2007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（2008年1月1日至2008年12月31日）和上年度可比期间内（2007年1月1日至2007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。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 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
1	2008-0 1-07	2008-0 1-07	0.400	53,862,625.81	59,957,242.72	113,819,868.53	2007 年度批准、公告但在 本年度实施的利润分配。 红利发放的公告日：2007 年 12 月 27 日
合计	-	-	0.400	53,862,625.81	59,957,242.72	113,819,868.53	-

7.4.12 期末（2008 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
002257	立立 电子	2008-06-30	未知	新股网上申 购	21.81	21.81	25,000	545,250.00	545,250.00
600169	太原 重工	2008-12-31	2009-12-29	非公开发 行 流通受限	12.67	12.68	1,500,000	19,005,000.00	19,020,000.00

注：1、根据宁波立立电子股份有限公司 2008 年 7 月 7 日发布的公告，有关监管部门要求保荐人等中介机构对媒体报道的有关问题进行核查，上市日期待定。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末（2008 年 12 月 31 日）未持有暂时停牌股票。

7.4.12.3 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。

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。

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%。

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 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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

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

单位：人民币元

上年度末 2007 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	114,223,202.81	-	-	-	114,223,202.81
结算备付金	217,804,209.03	-	-	-	217,804,209.03
存出保证金	101,282.05	-	-	1,741,245.46	1,842,527.51
交易性金融资产	753,316,000.00	110,386,695.10	3,374,254.20	2,020,380,319.72	2,887,457,269.02
衍生金融资产	-	-	-	495,534.08	495,534.08
应收证券清算款	-	-	-	6,659,692.17	6,659,692.17
应收利息	-	-	-	15,157,692.50	15,157,692.50
应收申购款	15,248,661.14	-	-	1,822,833.53	17,071,494.67
资产总计	1,100,693,355.03	110,386,695.10	3,374,254.20	2,046,257,317.46	3,260,711,621.79
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,880,673.22	3,880,673.22
应付赎回款	-	-	-	15,459,201.95	15,459,201.95
应付管理人报酬	-	-	-	3,135,729.05	3,135,729.05
应付托管费	-	-	-	653,276.89	653,276.89
应付交易费用	-	-	-	1,353,713.87	1,353,713.87
应交税费	-	-	-	505,937.20	505,937.20
其他负债	-	-	-	823,092.48	823,092.48
负债总计	-	-	-	25,811,624.66	25,811,624.66
利率敏感度缺口	1,100,693,355.03	110,386,695.10	3,374,254.20	2,020,445,692.80	3,234,899,997.13

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：万元）	
		本期末（2008 年 12 月 31 日）	上年度末（2007 年 12 月 31 日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	增加约 1,155	增加约 173
2. 市场利率上升 25 个基点	下降约 1,135	下降约 173	

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。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%。

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 2008 年 12 月 31 日		上年度末 2007 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	1,459,486,558.53	50.42	2,020,380,319.72	62.46
衍生金融资产-权证投资	-	-	495,534.08	0.02
其他	-	-	-	-
合计	1,459,486,558.53	50.42	2,020,875,853.80	62.48

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（2008 年 12 月 31 日）	上年度末（2007 年 12 月 31 日）
1. 业绩比较基准上升 5%	增加约 0.97	增加约 1.09	
2. 业绩比较基准下降 5%	下降约 0.97	下降约 1.09	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项无。

§ 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	1,459,486,558.53	49.45
	其中：股票	1,459,486,558.53	49.45
2	固定收益投资	1,165,641,191.55	39.49
	其中：债券	1,165,641,191.55	39.49
	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	292,547,039.76	9.91
6	其他资产	33,752,007.63	1.14
7	合计	2,951,426,797.47	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	35,209,204.32	1.22
B	采掘业	174,634,587.72	6.03
C	制造业	607,453,617.91	20.99
C0	食品、饮料	63,912,381.94	2.21
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	48,330,912.03	1.67
C5	电子	8,009,680.35	0.28
C6	金属、非金属	126,721,457.04	4.38
C7	机械、设备、仪表	213,248,760.43	7.37
C8	医药、生物制品	147,230,426.12	5.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	52,916,000.96	1.83
E	建筑业	44,420,000.00	1.53
F	交通运输、仓储业	24,085,966.60	0.83
G	信息技术业	83,425,384.20	2.88
H	批发和零售贸易	60,181,105.72	2.08
I	金融、保险业	155,881,868.61	5.39
J	房地产业	21,133,468.80	0.73
K	社会服务业	57,499,613.84	1.99
L	传播与文化产业	28,831,654.41	1.00
M	综合类	113,814,085.44	3.93
	合计	1,459,486,558.53	50.42

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	601088	中国神华	7,856,818	137,808,587.72	4.76
2	600415	小商品城	1,618,788	88,839,085.44	3.07
3	600169	太原重工	3,740,569	50,836,079.80	1.76
4	600036	招商银行	4,000,000	48,640,000.00	1.68
5	600271	航天信息	1,692,270	42,662,126.70	1.47
6	600849	上海医药	5,432,881	39,116,743.20	1.35
7	601398	工商银行	11,000,000	38,940,000.00	1.35
8	000538	云南白药	1,114,538	38,351,252.58	1.32
9	002202	金风科技	1,500,000	37,875,000.00	1.31
10	600054	黄山旅游	2,759,108	36,916,865.04	1.28
11	600649	城投控股	4,000,000	32,960,000.00	1.14
12	600598	北大荒	3,000,000	32,190,000.00	1.11
13	600683	银泰股份	6,737,509	31,598,917.21	1.09
14	600585	海螺水泥	1,200,749	31,135,421.57	1.08
15	600037	歌华有线	3,038,109	28,831,654.41	1.00
16	601601	中国太保	2,390,179	26,578,790.48	0.92
17	002204	华锐铸钢	1,715,739	26,079,232.80	0.90
18	600479	千金药业	1,344,570	26,057,766.60	0.90
19	600600	青岛啤酒	1,291,398	25,815,046.02	0.89
20	000028	一致药业	1,538,994	25,254,891.54	0.87

21	600895	张江高科	2,500,000	24,975,000.00	0.86
22	600720	祁连山	3,500,000	24,115,000.00	0.83
23	000418	小天鹅 A	5,179,900	23,205,952.00	0.80
24	601186	中国铁建	2,200,000	22,088,000.00	0.76
25	600015	华夏银行	3,000,000	21,810,000.00	0.75
26	000731	四川美丰	3,400,000	21,726,000.00	0.75
27	002088	鲁阳股份	2,150,709	21,507,090.00	0.74
28	002073	青岛软控	2,000,000	21,020,000.00	0.73
29	600026	中海发展	2,572,364	20,964,766.60	0.72
30	600005	武钢股份	4,300,000	20,554,000.00	0.71
31	600323	南海发展	2,500,752	19,956,000.96	0.69
32	600030	中信证券	1,108,129	19,913,078.13	0.69
33	600580	卧龙电气	2,625,249	18,560,510.43	0.64
34	002251	步步高	431,043	18,146,910.30	0.63
35	000060	中金岭南	2,200,000	17,160,000.00	0.59
36	600588	用友软件	746,100	16,414,200.00	0.57
37	002194	武汉凡谷	949,155	15,661,057.50	0.54
38	600737	中粮屯河	1,751,859	15,433,877.79	0.53
39	000933	神火股份	1,100,000	14,410,000.00	0.50
40	000651	格力电器	700,000	13,608,000.00	0.47
41	000978	桂林旅游	2,030,117	12,992,748.80	0.45
42	002122	天马股份	234,780	12,520,817.40	0.43
43	002216	三全食品	449,477	12,446,018.13	0.43
44	002080	中材科技	603,743	12,249,945.47	0.42
45	000597	东北制药	1,000,000	12,190,000.00	0.42
46	600068	葛洲坝	1,300,000	11,492,000.00	0.40
47	600048	保利地产	795,727	11,458,468.80	0.40
48	601390	中国中铁	2,000,000	10,840,000.00	0.37
49	600028	中国石化	1,500,000	10,530,000.00	0.36
50	600511	国药股份	365,253	10,435,278.21	0.36
51	600887	伊利股份	1,277,180	10,217,440.00	0.35
52	600309	烟台万华	986,100	9,861,000.00	0.34
53	000002	万科 A	1,500,000	9,675,000.00	0.33
54	600582	天地科技	697,600	9,543,168.00	0.33
55	002065	东华合创	600,000	8,688,000.00	0.30
56	000983	西山煤电	700,000	8,162,000.00	0.28
57	000422	湖北宣化	1,000,000	7,730,000.00	0.27
58	002140	东华科技	300,000	7,590,000.00	0.26
59	002008	大族激光	1,275,971	7,464,430.35	0.26
60	002030	达安基因	852,830	6,259,772.20	0.22
61	600352	浙江龙盛	900,000	5,670,000.00	0.20

62	600489	中金黄金	100,000	3,724,000.00	0.13
63	000698	沈阳化工	567,727	3,343,912.03	0.12
64	600561	江西长运	510,000	3,121,200.00	0.11
65	600467	好当家	571,819	3,019,204.32	0.10
66	002257	立立电子	25,000	545,250.00	0.02

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

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	601088	中国神华	397,491,166.90	12.29
2	601318	中国平安	251,176,384.21	7.76
3	600028	中国石化	245,455,925.46	7.59
4	600005	武钢股份	223,048,123.00	6.90
5	601006	大秦铁路	207,429,268.18	6.41
6	601186	中国铁建	190,402,227.70	5.89
7	601919	中国远洋	186,389,538.15	5.76
8	601939	建设银行	185,245,021.21	5.73
9	000983	西山煤电	168,911,308.87	5.22
10	600036	招商银行	155,209,156.93	4.80
11	601166	兴业银行	147,959,576.55	4.57
12	600009	上海机场	147,451,126.06	4.56
13	600026	中海发展	135,710,324.66	4.20
14	600000	浦发银行	134,331,313.74	4.15
15	600825	新华传媒	132,824,486.71	4.11
16	000002	万科A	129,788,065.71	4.01
17	600030	中信证券	119,913,532.66	3.71
18	600050	中国联通	118,153,859.20	3.65
19	600519	贵州茅台	117,165,283.22	3.62
20	601390	中国中铁	113,183,597.71	3.50
21	600500	中化国际	100,538,459.84	3.11
22	000651	格力电器	97,362,169.86	3.01
23	600037	歌华有线	93,376,913.07	2.89
24	600585	海螺水泥	88,384,686.73	2.73
25	000422	湖北宜化	87,894,545.98	2.72
26	600824	益民商业	85,287,687.53	2.64
27	600415	小商品城	84,657,142.10	2.62
28	600737	中粮屯河	83,646,988.80	2.59
29	600271	航天信息	83,344,928.87	2.58
30	000723	美锦能源	82,826,926.58	2.56

31	601398	工商银行	81,149,512.04	2.51
32	600649	城投控股	77,007,341.19	2.38
33	600104	上海汽车	76,810,866.33	2.37
34	000635	英力特	76,507,518.16	2.37
35	600078	澄星股份	75,012,483.29	2.32
36	600808	马钢股份	74,675,345.54	2.31
37	600683	银泰股份	72,969,946.68	2.26
38	600761	安徽合力	70,983,951.92	2.19
39	600489	中金黄金	70,199,615.99	2.17
40	600875	东方电气	70,115,111.56	2.17
41	600856	长百集团	68,111,376.99	2.11
42	600169	太原重工	67,506,216.43	2.09
43	002073	青岛软控	65,108,187.61	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。

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	601919	中国远洋	249,104,740.54	7.70
2	600028	中国石化	247,498,120.97	7.65
3	601318	中国平安	229,753,226.70	7.10
4	601006	大秦铁路	199,370,215.72	6.16
5	601939	建设银行	172,927,062.35	5.35
6	601186	中国铁建	169,672,904.48	5.25
7	601088	中国神华	168,103,617.30	5.20
8	600000	浦发银行	139,984,909.37	4.33
9	000581	威孚高科	135,922,681.59	4.20
10	000983	西山煤电	134,629,626.21	4.16
11	600825	新华传媒	125,653,865.40	3.88
12	600005	武钢股份	115,682,798.09	3.58
13	601390	中国中铁	113,807,651.12	3.52
14	000002	万科A	111,098,750.48	3.43
15	601166	兴业银行	110,189,439.42	3.41
16	600050	中国联通	107,917,424.51	3.34
17	600009	上海机场	105,670,595.34	3.27
18	600030	中信证券	104,350,496.99	3.23
19	600830	香溢融通	104,180,901.65	3.22
20	600500	中化国际	92,222,833.02	2.85
21	600036	招商银行	91,230,348.36	2.82
22	002092	中泰化学	90,403,886.62	2.79

23	600026	中海发展	89,617,053.53	2.77
24	000651	格力电器	87,048,603.43	2.69
25	600519	贵州茅台	86,815,143.80	2.68
26	600383	金地集团	82,305,236.75	2.54
27	600037	歌华有线	79,182,112.46	2.45
28	002022	科华生物	77,187,664.87	2.39
29	000723	美锦能源	74,595,806.26	2.31
30	600875	东方电气	72,238,153.15	2.23
31	600406	国电南瑞	70,070,417.26	2.17
32	600078	澄星股份	68,029,084.33	2.10
33	600309	烟台万华	67,051,203.42	2.07
34	600489	中金黄金	66,418,685.10	2.05

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

买入股票成本（成交）总额	8,813,561,865.54
卖出股票收入（成交）总额	7,308,234,044.64

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	188,191,825.50	6.50
2	央行票据	297,115,000.00	10.26
3	金融债券	465,514,000.00	16.08
	其中：政策性金融债	465,514,000.00	16.08
4	企业债券	201,737,191.05	6.97
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	13,083,175.00	0.45
7	其他	-	-
8	合计	1,165,641,191.55	40.27

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	0801062	08 央票 62	1,000,000	107,170,000.00	3.70
2	0801050	08 央票 50	1,000,000	106,940,000.00	3.69
3	080222	08 国开 22	1,000,000	101,200,000.00	3.50

4	010203	02 国债(3)	753,520	77,130,307.20	2.66
5	080308	08 进出 08	600,000	64,704,000.00	2.24

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。

8.9.2 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。

8.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,492,773.59
2	应收证券清算款	12,928,099.59
3	应收股利	-
4	应收利息	13,216,153.16
5	应收申购款	6,094,981.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	20,000.00
9	合计	33,752,007.63

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	128031	巨轮转债	5,234,823.00	0.18
2	110002	南山转债	3,729,808.80	0.13
3	125528	柳工转债	347,755.20	0.01

8.9.5 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	600169	太原重工	19,020,000.00	0.66	非公开发行股票

§ 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
182,570	23,103.22	716,896,862.27	17.00%	3,501,058,049.50	83.00%

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	279,572.61	0.0066%

§ 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
报告期期初基金份额总额	2,815,001,464.89
报告期期间基金总申购份额	3,379,001,544.06
报告期期间基金总赎回份额	1,976,048,097.18
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	4,217,954,911.77

§ 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) 2008年4月25日，本基金管理人发布关于调整基金经理的公告，袁蓓女士不再担任华安宝利配置证券投资基金的基金经理，聘任邓跃辉先生为华安宝利配置证券投资基金的基金经理。

(2) 2008年6月10日，本基金管理人发布关于董事和监事变更的公告，经本公司股东会审议，选举马名驹先生担任本公司董事，顾培柱先生不再担任本公司董事；选举李梅清女士担任本公司监事，戴金宝先生不再担任本公司监事。

(3) 2008年10月11日，本基金管理人发布关于调整基金经理的公告，增聘沈雪峰女士为华安宝利配置证券投资基金的基金经理，与该基金现任基金经理邓跃辉先生一起共同负责该基金的投资运作。

(4) 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。

(5) 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。

11.3 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。

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如下: 100,000.00 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

报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 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	869,260,214.78	5.45%	738,865.52	5.51%	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	165,726,825.33	1.04%	140,867.48	1.05%	-
海通证券股份有限公司	1	2,667,792,384.58	16.72%	2,167,602.92	16.15%	-
红塔证券股份有限公司	1	321,903,236.86	2.02%	273,615.86	2.04%	-
中信建投证券有限责任公司	1	1,242,864,216.36	7.79%	1,009,838.37	7.53%	-
申银万国证券股份有限公司	1	5,390,550,377.71	33.78%	4,581,948.86	34.15%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,486,696,755.56	9.32%	1,263,687.55	9.42%	-
中信证券股份有限公司	1	3,814,031,889.28	23.90%	3,241,909.56	24.16%	-

券商名称	交易单元数量	债券交易		权证交易		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	18,151,879.20	1.78%	-	-	-
长城证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	1	40,188,231.70	3.93%	-	-	-
海通证券股份有限公司	1	63,070,645.58	6.17%	1,490,865.20	15%	-
红塔证券股份有限公司	1	1,001,238.00	0.10%	-	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	11,738,593.76	1.15%	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	465,335,008.40	45.52%	6,276,876.41	63.17%	-
兴业证券股份有限公司	1	249,639,979.33	24.42%	1,135,037.39	11.42%	-
中信证券股份有限公司	1	173,244,446.10	16.95%	1,034,327.12	10.41%	-

注：1、本报告期内，本基金交易单元变更情况如下：

新增中银国际证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增长城证券有限责任公司上海交易单元1个；

新增红塔证券股份有限公司上海交易单元1个。

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。

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	关于新增中国民生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	2008-01-15
2	关于参加建设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	2008-01-25
3	关于新增中国光大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	2008-01-28
4	关于参加建设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	2008-01-28
5	关于新增华安宝利配置证券投资基金参加中国光大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	2008-01-29
6	关于新增安信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	2008-01-31
7	关于在建设银行开通旗下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	2008-02-25
8	关于新增中原证券股份有限公司为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-03-03
9	关于新增深圳平安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	2008-03-21
10	关于调整华安宝利配置证券投资基金电子直销申购费率的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2008-03-24

		和公司网站	
11	关于网上交易系统开通中信银行等银行网上支付的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-03-24
12	关于新增华安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	2008-03-24
13	关于新增华泰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	2008-03-24
14	关于参加中国建设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》和公司网站	2008-03-31
15	关于新增东莞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	2008-04-11
16	关于新增平安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	2008-04-17
17	关于新增广东发展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	2008-05-05
18	关于参加民生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	2008-05-08
19	关于参加北京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	2008-06-03
20	关于开通北京银行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	2008-06-03
21	关于寻找地震受灾地区基金份额持有人的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-06-03
22	关于网上交易系统开通招商银行网上直销业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-06-17
23	关于新增广州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	2008-06-25
24	关于参加中信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	2008-06-26

25	关于新增瑞银证券有限责任公司为开放式基金代销机构及参加瑞银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	2008-06-27
26	关于在中国民生银行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	2008-07-10
27	关于新增中国农业银行为代销机构的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-07-14
28	关于新增中银国际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	2008-07-21
29	关于参加广州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	2008-07-22
30	关于参加长江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	2008-07-25
31	关于新增中山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	2008-07-25
32	关于参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动与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	2008-08-01
33	关于新增齐鲁证券有限公司为开放式基金代销机构及参加齐鲁证券有限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	2008-08-13
34	关于推出手机基金交易/查询业务的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-09-01
35	关于暂停参加齐鲁证券有限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	2008-09-03
36	关于新增国联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	2008-09-08
37	关于旗下证券投资基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》的提示性公告,自2008年9月16日起,对我公司所管理的相关基金的估值原则作如	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-09-16

	<p>下调整:</p> <p>1、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,以最近交易日的收盘价估值。</p> <p>2、估值日无交易,且最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件,使投资品种潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的,参考《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》,采用指数收益法,调整最近交易日收盘价,确定公允价值进行估值。如有确凿证据表明采用指数收益法计算得到的停牌股票价值不能真实反映股票的公允价值,本基金管理人可以与基金托管人协商采用其它估值方法,对停牌股票进行估值。</p> <p>本基金管理人将聘请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。</p>		
38	关于旗下基金执行《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》对基金净值影响的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-09-17
39	关于新增西部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	2008-09-17
40	关于参加齐鲁证券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	2008-09-25
41	关于新增东北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	2008-10-06
42	关于新增国元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	2008-10-15
43	关于参加光大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	2008-10-27
44	关于在广东发展银行开通旗下基	《上海证券报》、《证券	2008-11-03

	金定期定额投资业务的公告	时报》、《中国证券报》和公司网站	
45	关于新增华龙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	2008-11-17
46	关于新增中国建银投资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	2008-11-25
47	关于新增山西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	2008-12-03
48	关于旗下部分基金开通基金定期定额投资业务后端收费模式和调整赎回适用持有期的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-10
49	关于参加深圳平安银行股份有限公司网上申购费率优惠活动和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	2008-12-13
50	关于新增红塔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	2008-12-18
51	关于参加中国工商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	2008-12-30
52	关于参加中国建设银行定期定额申购长期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	2008-12-31
53	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时间的公告	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》和公司网站	2008-12-31
54	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
55	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
56	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
57	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》和公司网站	2009-01-20
58	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	《上海证券报》、《证券时报》、《中国证券报》	2009-01-21

	业务及相关交易费率调整的公告	和公司网站	
59	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
60	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
61	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
62	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
63	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
64	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
65	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
66	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
67	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
68	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
69	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
70	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

§ 12 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3月26日