

华安宝利配置证券投资基金 更新的招募说明书摘要

2009 年第 2 号

基金发起人：华安基金管理有限公司

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

基金类型： 契约型开放式

日 期：2009 年 9 月

目 录

一、 基金合同的生效日期.....	1
二、 重要提示.....	1
三、 基金管理人.....	1
四、 基金托管人.....	5
五、 相关服务机构.....	7
六、 基金的名称.....	26
七、 基金的类型.....	27
八、 基金的投资目标.....	27
九、 基金的投资方向.....	27
十、 基金的投资策略.....	27
十一、 基金的业绩比较基准.....	32
十二、 基金的风险收益特征.....	32
十三、 基金的投资组合报告.....	32
十四、 基金的业绩.....	35
十五、 费用概览.....	36
十六、 对招募说明书更新部分的说明.....	37

一、基金合同的生效日期

华安宝利配置证券投资基金经中国证监会 2004 年 7 月 2 日证监基金字[2004]97 号文件《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》批准发起设立，基金合同于 2004 年 8 月 24 日正式生效。

二、重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书已经本基金托管人复核。除特别说明外，本招募说明书所载内容截止日为 2009 年 8 月 16 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 6 月 30 日（未经审计）。

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

1. 名称：华安基金管理有限公司
2. 住所：上海市浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 38 楼
3. 设立日期：1998 年 6 月 4 日
4. 法定代表人：俞妙根
5. 办公地址：上海市浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 2 楼、37 楼、38 楼
6. 联系电话：(021) 38969999
7. 联系人：冯颖

8. 注册资本：1.5 亿元人民币

9. 股权结构：

上海电气（集团）总公司持股 20%、上海国际信托有限公司持股 20%、上海工业投资（集团）有限公司持股 20%、上海锦江国际投资管理有限公司持股 20%、上海沸点投资发展有限公司持股 20%。

（二）主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

（1）董事会：

徐建国先生，研究生学历，高级经济师及上海财经大学兼职教授。历任上海日用化学工业公司副经理，上海市轻工业局局长助理、副局长、党委书记，上海市经济委员会副主任，上海市宝山区区长，上海市黄浦区区长，上海市人民政府副秘书长、上海市经济委员会主任，现任上海电气（集团）总公司董事长。

俞妙根先生，大学学历，高级经济师。历任上海国际信托投资公司驻德国汉堡办事处总代表、AIT 公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理，上海国际信托投资有限公司副总经理。2006 年 11 月加入华安基金管理有限公司，并主持公司日常经营工作，现任华安基金管理有限公司总裁，副董事长。

冯祖新先生，研究生学历。历任上海市经济委员会办公室副主任科员、主任科员，上海市经济委员会信息中心副主任、主任，上海市工业投资公司副总经理、总经理，上海工业投资（集团）有限公司副总裁，现任上海工业投资（集团）有限公司总裁、法定代表人、党委副书记。

陈兵先生，研究生学历，高级经济师。历任安徽岳西监察局监察干事，上海浦东发展银行大连分行资金财务部总经理、总行资金财务部总经理助理、个人银行总部管理会计部总经理、财富管理部总经理，现任上海国际信托有限公司副总经理、董事会秘书。

马名驹先生，大学学历，高级会计师。历任上海凤凰自行车股份有限公司副董事长兼总经理，上海东方上市企业博览中心副总经理，上海锦江国际投资管理有限公司董事兼总经理，锦江国际（集团）有限公司副总裁及计划财务部经理、金融事业部总经理、上海锦沧文华大酒店董事长、锦江麦德龙现购自运有限公司副董事长、北京昆仑饭店董事、上海锦江国际旅馆投资有限公司董事、锦江之星旅馆有限公司董事、锦江国际集团财务有限责任公司董事兼财务总监。

独立董事：

萧灼基先生，研究生学历，教授。现任全国政协委员，政协经济委员会委员，北京大学

经济学院教授，博士生导师，北京市、云南省、吉林省、成都市，武汉市等省市专家顾问，北京市场经济研究所所长，《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生，大学学历，一级律师，曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书科长、上海市第一律师事务所副主任、上海市金茂律师事务所主任、上海市律师协会副会长。现任上海市金茂律师事务所高级合伙人、上海仲裁委员会仲裁员、上海市律师协会顾问。

夏大慰先生，研究生学历，教授。历任上海财经大学科研处处长，上海财经大学南德管理学院院长，上海财经大学常务副校长，现任上海国家会计学院院长、党委书记，APEC 金融与发展项目执行秘书处秘书长，兼任香港中文大学荣誉教授、中国工业经济研究与开发促进会副会长、中国会计学会副会长、财政部会计准则委员会咨询专家、上海证交所上市公司专家委员会委员、上海工业经济专业研究会主任委员等职务。

（2）监事会：

谢伟民先生，研究生学历，副教授。历任上海市城建沪南工务所干部，空军政治学院训练部中共党史研究室正营级教员、讲师，上海市计委直属机关党委干事，中共上海市综合经济工作委员会组织处干部、宣传员（副处级）、副处长，中共上海市金融工作党委组织处（宣传处）副处长兼机关党委副书记、机关纪委书记（正处级）。

陈涵女士，研究生学历，经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务部副科长，现任上海国际信托投资有限公司资产管理总部投资业务部科长。

柳振铎先生，研究生学历，高级经济师。历任上海良工阀门厂团委书记、车间主任、副厂长，上海机电工业管理局办公室副主任、规划处处长，现任上海电气（集团）总公司副总裁兼上海机电股份公司党委书记、总经理。

徐丹女士，研究生学历，高级会计师，中国注册税务师。历任上海石化总厂计财处会计、财务副科长，中石化上海金山实业公司财务处副处长，上海金山实业投资发展有限公司总会计师兼财务部主任，上海金山区财政局副局长，中石化上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实华经济发展公司财务部经理，现任上海工业投资（集团）有限公司总会计师。

李梅清女士，大专学历，会计师。历任上海新亚（集团）股份有限公司财务部副经理、上海新亚（集团）有限公司财务部副经理，锦江国际（集团）有限公司计划财务部副经理及上市公司部副经理，上海锦江国际投资管理有限公司财务总监、金融事业部财务总监。

蒋位先生，研究生学历，经济师。曾在上海财经大学任讲师，上海市发展计划委员会工作，现任上海沸点投资发展有限公司投资部高级经理。

赵敏先生，研究生学历，助理研究员。曾在上海社会科学院人口与发展研究所工作，历任华安基金管理有限公司综合管理部总经理、电子商务部总经理、上海营销总部总经理，现

任华安基金管理有限公司客户服务与电子商务部总经理。

诸慧女士，研究生学历，经济师。历任华安基金管理有限公司监察稽核部高级监察员，集中交易部总监助理，现任华安基金管理有限公司集中交易部总经理。

(3) 高级管理人员：

俞妙根先生，大学学历，高级经济师。历任上海国际信托投资公司驻德国汉堡办事处总代表、AIT 公司董事会董事总经理、信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部经理，上海国际信托投资有限公司副总经理。2006 年 11 月加入华安基金管理有限公司，并主持公司日常经营工作，现任华安基金管理有限公司总裁，副董事长。

邵杰军先生，研究生学历，15 年证券、基金从业经验。曾任申银万国证券股份有限公司基金管理总部总经理助理，现任华安基金管理有限公司常务副总裁。

韩勇先生，研究生学历。先后在中国人民大学、中国人民银行总行研究生部、北京大学学习，分别获经济学学士、金融学硕士和经济学博士学位，美国杜克大学访问学者。15 年证券、期货、基金从业经验。曾在君安证券有限公司和华夏证券有限公司从事投资银行工作；在中国证券监督管理委员会从事监管工作，历任副主任科员、主任科员、副处长、处长。现任华安基金管理有限公司副总裁。

李炳旺先生，研究生学历，23 年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理，现任华安基金管理有限公司副总裁。

章国富先生，研究生学历，22 年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师，上海大华会计师事务所会计师、中国诚信证券评估有限公司上海分公司副总经理、上海华虹（集团）有限公司财务部副部长（主持工作）、上海信虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资有限公司财务总监，现任华安基金管理有限公司督察长。

2. 基金经理介绍

现任基金经理：

邓跃辉先生，硕士，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 4 月 25 日至今担任本基金的基金经理。

沈雪峰女士，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 日任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。2008 年 6 月重新加入华安基金管理公司。2008 年 10 月 11 日至今担任本基金的基金经理。

历任基金经理：

汤礼辉先生，自 2005 年 5 月 25 日至 2007 年 4 月 18 日担任本基金基金经理。

袁蓓女士，自 2004 年 8 月 24 日至 2008 年 4 月 25 日担任本基金基金经理。

3. 本公司采取集体投资决策制度，投资决策委员会成员的姓名和职务如下：

俞妙根先生，总裁

王国卫先生，首席投资官

孙志方先生，总裁助理

尚志民先生，基金投资部总经理

宋 磊先生，研究发展部总经理

诸 慧女士，集中交易部总经理

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

四、基金托管人

（一）基金托管人概况

公司法定中文名称：交通银行股份有限公司（简称：交通银行）

公司法定英文名称：BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人：胡怀邦

住所：上海市浦东新区银城中路 188 号

邮政编码：200120

注册时间：1987 年 3 月 30 日

注册资本：489.94 亿元

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]25 号

联系人：张咏东

电话：021-68888917

交通银行是中国第一家全国性国有股份制商业银行，自 1987 年重新组建以来，交通银行各项业务和机构建设持续健康发展，目前我国 156 个城市设有 2600 多营业网点，全行员工 7 万余人。按国际财务报告准则审计口径，截止 2008 年 6 月 30 日，交通银行资产总额达到人民币 24,308.59 亿元，实现净利润人民币 155.08 亿元。2005 年 6 月 23 日，交通银行成功在香港主板市场上市，成为首家在境外上市的内地商业银行；2006 年 11 月 18 日，交通银行成为中国 2010 年上海世博会商业银行全球合作伙伴；2007 年 5 月 15 日，交通银行成功在上海证券交易所上市。2007 年，根据英国《银行家》杂志发布的“2007 年世界 1000 家银行”排名，交通银行总资产排名第 69 位，一级资本排名第 68 位；被国际权威杂志《欧洲货币》评为 2007 年度“中国最佳私人财富管理银行”。

交通银行总行设资产托管部，现有员工 100 余人。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验，具备基金从业资格，并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称，员工的学历层次较高，专业分布合理，职业技能优良，职业道德素质过硬，是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

（二）主要人员情况

李军先生，交通银行行长，华中理工大学经济学硕士，高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、行长，交通银行总稽核、董事、常务董事、执行董事、副行长；2006 年 9 月担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生，交通银行副行长，主管交通银行资产托管业务，南开大学经济学博士，高级经济师。曾任交通银行北京分行副行长、交通银行天津分行行长、交通银行北京分行行长。2006 年 1 月至今任交通银行副行长、党委委员兼北京分行党委书记。

谷娜莎女士，交通银行资产托管部总经理。大学学历，经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员、交通银行信托部代理业务处副处长、交通银行证券投资基金托管部规划处副处长、交通银行证券投资基金托管部内控巡查处处长；2001 年 1 月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理，2002 年 5 月起任交通银行资产托管部副总经理，2007 年 12 月起任交通银行资产托管部总经理。

（三）基金托管业务经营情况

截止 2008 年 12 月末，交通银行共托管证券投资基金 42 只，包括基金普惠、基金安顺、

基金汉兴、基金科瑞、建信优势动力、华安创新基金、国泰金鹰增长基金、华夏债券基金、泰达荷银合丰系列基金（成长、周期、稳定）、鹏华普天系列基金（债券、收益）、海富通精选基金、博时现金收益基金、易方达 50 指数基金、融通行业景气基金、鹏华中国 50 基金、金鹰中小盘精选基金、富国天益价值基金、华安宝利基金、中海优质成长基金、银河银富货币市场基金、银华货币市场基金、泰达荷银风险预算基金、万家公用事业基金、天治核心成长基金、汇丰晋信 2016 生命周期基金、摩根士丹利华鑫货币市场基金、汇丰晋信龙腾基金、长城久富核心成长基金、汇丰晋信动态策略基金、华夏蓝筹核心基金、博时新兴成长基金、华安策略优选基金、易方达科讯基金、易方达科汇基金、天治创新先锋基金、金鹰红利价值基金、农银汇理行业成长基金、农银汇理恒久增利基金、汇丰晋信平稳增利基金。此外，还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等 12 类产品，托管资产规模超过四千亿元。

五、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

（1）华安基金管理有限公司上海投资理财中心

地址：上海市浦东新区浦东南路 360 号新上海国际大厦 2 楼

电话：(021) 38969981

传真：(021) 58403723

联系人：张剑云

（2）华安基金管理有限公司北京投资理财中心

地址：北京市西城区金融街 23 号平安大厦 106 室

电话：(010) 66219999

传真：(010) 66214060

联系人：刘彦竹

（3）华安基金管理有限公司广州投资理财中心

地址：广州市天河区天河路 228 号广晟大厦 2202 室

电话：(020) 38350158 转 88 分机

传真：(020) 38350259

联系人：王新光

(4) 华安基金管理有限公司电子交易平台

华安电子交易网站：www.huaan.com.cn

华安电子交易手机网站：wap.huaan.com.cn

华安电子交易热线：40088-50099

传真电话：(021) 33626962

联系人：韩晓华

2、代销机构

(1) 交通银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

电话：(021) 58781234

传真：(021) 58408842

客户服务电话：95559

网址：www.bankcomm.com

(2) 中国银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 1 号

法定代表人：肖钢

电话：(010) 66594909

传真：(010) 66594853

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

(3) 中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

传真：(010) 66107914

网址：www.icbc.com.cn

(4) 中国建设银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼（长安兴融中心）

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：www.ccb.com

(5) 中国农业银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 69 号

法定代表人：项俊波

客户服务电话：95599

网址：www.95599.cn

(6) 招商银行股份有限公司

注册地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人：秦晓

电话：(0755) 83198888

传真：(0755) 83195049

客户服务电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(7) 中信银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

电话：(010) 65557013

传真：(010) 65550827

客户服务电话：95558

网址: bank.ecitic.com

(8) 中国光大银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门外大街 6 号光大大厦

法定代表人: 唐双宁

传真: (010) 68560661

客户服务电话: 95595

网址: www.cebbank.com

(9) 中国邮政储蓄银行有限责任公司

注册地址: 北京市西城区宣武门西大街 131 号

办公地址: 北京市西城区宣武门西大街 131 号

法定代表人: 刘安东

客户服务电话: 11185

传真: (010) 66415194

网址: www.psbc.com

(10) 上海银行股份有限公司

注册地址: 上海市中山东二路 585 号

办公地址: 上海市中山东二路 585 号

法定代表人: 陈辛

电话: (021) 962888

传真: (021) 63370777

客户服务电话: (021) 63370888

网址: www.bankofshanghai.com

(11) 深圳发展银行股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

办公地址: 广东省深圳市深南东路 5047 号深圳发展银行大厦

法定代表人: 法兰克纽曼

电话: (0755) 82088888

传真: (0755) 82080714

客户服务电话: 95501

网址: www.sdb.com.cn

(12) 中国民生银行股份有限公司

注册地址: 北京市东城区正义路甲 4 号

办公地址: 北京市东城区正义路甲 4 号

法定代表人: 董文标

客户服务电话: 95568

传真: (010) 58560794

网址: www.cmbc.com.cn

(13) 北京银行股份有限公司

注册地址: 北京市金融大街丙 17 号北京银行大厦

办公地址: 北京市金融大街丙 17 号北京银行大厦

法定代表人: 闫冰竹

电话: (010) 66223251

传真: (010) 66226045

客户服务电话: (010) 96169

网址: www.bankofbeijing.com.cn

(14) 深圳平安银行股份有限公司

注册地址: 深圳市深南中路 1099 号平安银行大厦

法定代表人: 孙建一

联系电话: (0755) 25859591

传真号码: (0755) 25878304

客户服务电话: 40066-99999

网址: www.18ebank.com

(15) 广东发展银行股份有限公司

注册地址: 广州市农林下路 83 号

法定代表人: 李若虹

传真: (020) 87311780

客户服务电话: (020) 38322974 或 (020) 38322542

网址: ebank.gdb.com.cn

(16) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址：上海市延安西路 728 号华敏大厦 26 楼

法定代表人：李秀仑

电话：(021) 62126969

传真：(021) 62521689

客户服务电话：(021) 962999

网址：www.shrcb.com

(17) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福建省福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

电话：(0591) 87839338

传真：(0591) 87841932

客户服务电话：95561

网址：www.cib.com.cn

(18) 临商银行股份有限公司

注册地址：山东省临沂市沂蒙路 336 号

法定代表人：王傢玉

电话：(0539) 8311353

客户服务电话：40069-96588

网址：www.lsbchina.com

(19) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

办公地址：北京市东城区建国门内大街 22 号

法定代表人：翟鸿祥

电话：(010) 85238680

传真：(010) 85238680

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

(20) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

法定代表人：祝幼一

电话：(021) 62580818

传真：(021) 62583439

客户服务电话：800-820-6888

网址：www.gtja.com

(21) 中信建投证券有限责任公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

电话：(010) 65183888

传真：(010) 65182261

客户服务电话：400-8888-108

网址：www.csc108.com

(22) 国信证券有限责任公司

注册地址：深圳市红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 层

法定代表人：何如

电话：(0755) 82130833 转 2181

传真：(0755) 82133302

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(23) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：(0755) 82943511

传真：(0755) 82943237

客户服务热线：400-8888-111；(0755) 26951111

网站：www.newone.com.cn

(24) 广发证券股份有限公司

注册地址：广州市天河北路 183 号大都会广场 36 楼

法定代表人：王志伟

电话：(020) 87555888

传真：(020) 87555305

网址：www.gf.com.cn

(25) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市罗湖区湖贝路 1030 号海龙王大厦

办公地址：北京市新源南路 6 号京城大厦 3 楼

法定代表人：王东明

电话：(010) 84588888

传真：(010) 84865560

网址：www.ecitic.com

(26) 中国银河证券股份有限公司

注册地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：朱利

电话：(010) 66568888

传真：(010) 66568536

客户服务电话：800-820-1868

网址：www.chinastock.com.cn

(27) 海通证券股份有限公司

注册地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：(021) 23219000

传真：(021) 63410456

客户服务电话：400-8888-001；(021) 962503

网址：www.htsec.com

(28) 联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市罗湖区深南东路 5047 号深圳发展银行大厦 10、25 层

法定代表人：王政

电话：(0755) 82492000

传真：(0755) 82492962

客户服务电话：400-8888-555；(0755) 25125666

网址：www.lhzq.com

(29) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：丁国荣

电话：(021) 54033888

传真：(021) 54035333

客户服务电话：(021) 962505

网址：www.sw2000.com.cn

(30) 兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

电话：(021) 68419974

传真：(021) 68419867

客户服务电话：(021) 68419974

网址：www.xyzq.com.cn

(31) 长江证券股份有限公司

注册地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：400-8888-999

网址：www.95579.com

(32) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：(021) 68801217

传真：(021) 68801119

网址：www.essences.com.cn

(33) 中信金通证券有限责任公司

注册地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

办公地址：浙江省杭州市中河南路 11 号万凯庭院商务楼 A 座

法定代表人：刘军

联系电话：(0571) 85783715

传真号码：(0571) 85783771

客户服务电话：(0571) 96598

网址：www.bigsun.com.cn

(34) 湘财证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市黄兴中路 63 号中山国际大厦 12 楼

办公地点：上海市浦东陆家嘴环路 958 号华能联合大厦 5 楼

法定代表人：陈学荣

电话：(021) 68634518

传真：(021) 68865938

客户服务电话：(021) 68865020

网址：www.xcsc.com

(35) 国元证券股份有限公司

注册地址：安徽省合肥市寿春路 179 号

法定代表人：凤良志

电话：(0551) 2207114

客户服务电话：4008-888-777

网址：www.gyzq.com.cn

(36) 渤海证券股份有限公司

注册地址：天津市经济技术开发区第一大街 29 号

法定代表人：张志军

电话：(022) 28455588

客户服务电话：(022) 28451883

网址：www.ewww.com.cn

(37) 华泰证券有限责任公司

注册地址：江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

电话：(025) 84457777

客户服务电话：(025) 95597

网址：www.htsc.com.cn

(38) 山西证券股份有限公司

注册地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

办公地址：山西省太原市府西街 69 号山西国贸中心东塔楼

法定代表人：侯巍

电话：(0351) 8686703

传真：(0351) 8686619

客户服务电话：400-666-1618

网址：www.i618.com.cn

(39) 中信万通证券有限责任公司

注册地址：青岛市崂山区香港东路 316 号

办公地址：青岛市东海西路 28 号

法定代表人：史洁民

电话：(0532) 85022026

传真：(0532) 85022026

客户服务电话：(0532) 96577

网址：www.zxwt.com.cn

(40) 东方证券有限责任公司

注册地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

办公地址：上海市中山南路 318 号 2 号楼 22 层-29 层

法定代表人：王益民

电话：(021) 63325888

传真：(021) 63326173

客户服务电话：(021) 962506、400-8888-506

网址：www.dfzq.com.cn

(41) 长城证券有限责任公司

注册地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 16、17 层

办公地址：深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 14、16、17 层

法定代表人：魏云鹏

电话：(0755) 83516094

传真：(0755) 83516199

客户服务电话：(0755) 82288968

网址：www.cc168.com.cn

(42) 光大证券股份有限公司

注册地址：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：徐浩明

电话：(021) 68816000-1876

传真：(021) 68815009

客户服务电话：10108998

网址：www.ebscn.com

(43) 广州证券有限责任公司

注册地址：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼五楼

法定代表人：吴志明

电话：(020) 87322668

传真：(020) 87325036

客户服务电话：961303

网址：www.gzs.com.cn

(44) 东北证券股份有限公司

注册地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：(0431) 85096709

传真：(0431) 85096795

客户服务电话：(0431) 96688

网址: www.nesc.cn

(45) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市九江路 111 号

法定代表人: 蒋元真

电话: (021) 62470304

传真: (021) 65213164

客户服务电话: 800-6200-071

网址: www.962518.com

(46) 国联证券股份有限公司

注册地址: 无锡市县前东街 168 号国联大厦

法定代表人: 范炎

电话: (0510) 82831662

传真: (0510) 82830162

客户服务电话: 400-888-5288

网址: www.glsc.com.cn

(47) 平安证券有限责任公司

注册地址: 深圳市福田区八卦三路平安大厦 3 楼

法定代表人: 叶黎成

电话: (0755) 22627802

传真: (0755) 82433794

客户服务电话: 95511

网址: www.PA18.com

(48) 华安证券有限责任公司

注册地址: 安徽省合肥市长江中路 357 号

法定代表人: 李工

电话: (0551) 5161666

传真: (0551) 5161600

客户服务电话: (0551) 5161671

网址: www.hazq.com

(49) 国海证券有限责任公司

注册地址：广西南宁市滨湖路 46 号

法定代表人：张雅锋

电话：(0771) 5539262

传真：(0771) 5539033

客户服务电话：全国：400-8888-100 广西：96100

网址：www.ghzq.com.cn

(50) 财富证券有限责任公司

注册地址：湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财富中心 26-27 层

法定代表人：蒋永明

电话：(0731) 4403343

传真：(0731) 4403439

客户服务电话：(0731) 4403343

网址：www.cfzq.com

(51) 东莞证券有限责任公司

注册地址：东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼

法定代表人：游锦辉

电话：(0769) 22119351

传真：(0769) 22119423

客户服务电话：961130

网址：www.dgzq.com.cn

(52) 中原证券股份有限公司

注册地址：许昌市南关大街 38 号

办公地址：郑州市经三路 15 号广汇国贸 11 楼

法定代表人：张建刚

电话：(0371) 65585670

传真：(0371) 65585670

客户服务电话：(0371) 967218

网址：www.ccnew.com

(53) 国都证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格广场 45 层

办公地址：北京市东城区安外大街 2 号安贞大厦 3 层

法定代表人：王少华

电话：(010) 84183389

传真：(010) 64482090

客户服务电话：800-810-8809

网址：www.guodu.com

(54) 中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F

电话：(021) 68604866

传真：(021) 58883554

客户服务电话：4006208888

网址：www.bocichina.com

(55) 宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆乌鲁木齐建设路 2 号

办公地址：北京市海淀区西直门北大街甲 43 号金运大厦 B 座 6 层

法定代表人：汤世生

联系电话：(010) 62267799

传真号码：(010) 62294470

客户服务电话：(0991) 96562、(010) 62294600

网址：www.ehongyuan.com

(56) 齐鲁证券有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

传真：(0531) 81283735

客户服务电话：95538

网址：www.qlzq.com.cn

(57) 世纪证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 楼

法定代表人：卢长才

电话：(0755) 83199511

传真：(0755) 83199545

客户服务电话：(0755) 83199511

网址：www.csc.com.cn

(58) 德邦证券有限责任公司

注册地址：上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼

法定代表人：王军

电话：(021) 68761616

传真：(021) 68767981

客户服务电话：(021) 68761616-8125

网址：www.tebon.com.cn

(59) 西部证券股份有限公司

注册地址：陕西省西安市东大街 232 号陕西信托大厦 16—17 层

法定代表人：刘建武

电话：(029) 87406172

客户服务电话：96708

网址：www.westsecu.com.cn

(60) 华龙证券有限责任公司

注册地址：甘肃省兰州市静宁路 308 号

法定代表人：李晓安

电话：(0931) 4890100

传真：(0931) 4890118

客户服务电话：(0931) 4890100

网址：www.hlzqgs.com

(61) 瑞银证券有限责任公司

注册地址：北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层

法定代表人：刘弘

电话：(010) 59226788

传真：(010) 59226799

客户服务电话：400-887-8827

网址：www.ubssecurities.com

(62) 中国建银投资证券有限责任公司

注册地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

办公地址：深圳福田区益田路与福华三路交界处深圳国际商会中心 48-50 层

法定代表人：杨小阳

电话：(0755) 82026521

传真：(0755) 82056539

客户服务电话：4006-008-008

网址：www.cjis.cn

(63) 中山证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区益田路江苏大厦 B 座 15 层

法定代表人：吴泳良

电话：(0755) 82943755

传真：(0755) 82940511

客户服务电话：(0755) 82943750

网址：www.zszq.com.cn

(64) 红塔证券股份有限公司

注册地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

办公地址：云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼

法定代表人：况雨林

电话：(0871) 3577930

传真：(0871) 3578827

客户服务电话：(0871) 3577930

网址：www.hongtazq.com

(65) 东海证券有限责任公司

注册地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18 楼

法定代表人：朱科敏

电话：(021) 50586660-8636

传真：(021) 50586660-8611

客户服务电话：(021) 52574550

网址：www.longone.com.cn

(66) 江南证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

办公地址：江西省南昌市抚河北路 291 号

法定代表人：朱科敏

电话：(0791) 6768763

传真：(0791) 6789414

客户服务电话：(0791) 6768763

网址：www.scstock.com

(67) 国盛证券有限责任公司

注册地址：江西省南昌市永叔路 15 号

办公地址：江西省南昌市永叔路 15 号信达大厦 10-13 楼

法定代表人：管荣升

电话：(0791) 6289771

传真：(0791) 6289395

网址：www.gsstock.com

(68) 恒泰证券股份有限公司

注册地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

办公地址：内蒙古呼和浩特市新城区新华东街 111 号

法定代表人：刘汝军

电话：(0471) 4913998

传真：(0471) 4930707

客户服务电话：(0471) 4961259

网址：www.cnht.com.cn

(69) 江海证券有限公司

注册地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

办公地址：黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号

法定代表人：孙名扬

电话：(0451) 82336863

传真：(0451) 82287211

客户服务电话：40066-62288

网址：www.jhzq.com.cn

(70) 国金证券股份有限公司

注册地址：成都市青羊区东城根上街 95 号

办公地址：成都市青羊区东城根上街 95 号 16 楼

法定代表人：雷波

电话：(028) 86690125

传真：(028) 86690126

客户服务电话：(028) 95105111

网址：www.china598.com.cn

(71) 天相投资顾问有限公司

注册地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人：林义相

电话：(010) 66045566

传真：(010) 66574468

客户服务电话：(010) 66045566

网址：www.txsec.com

(72) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市南京西路 758 号 24 楼

办公地址：上海市南京西路 758 号博爱大厦 20 层—25 层

法定代表人：张建华

电话：(021) 32229888

传真：(021) 62878701

客户服务电话：(021) 63340678

网址：www.ajzq.com

(二) 基金注册与过户登记人

名称：华安基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 360 号，新上海国际大厦 38 楼

法定代表人：俞妙根

电话：(021) 38969999

传真：(021) 33627990

联系人：朱永红

客户服务中心电话：40088-50099

(三) 律师事务所和经办律师

名称：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号上海证券大厦南塔 21 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 68818100

传真：(021) 68816880

经办律师：韩炯、秦悦民

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区东昌路 568 号 (200120)

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 61238888

传真：(021) 61238800

经办注册会计师：薛竞、汪棣

六、基金的名称

本基金名称：华安宝利配置证券投资基金。

七、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

八、基金的投资目标

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。

九、基金的投资方向

本基金主要投资于中国证监会认可的具有良好流动性的金融工具，如债券（包括可转换债券、国债、金融债、企业债）、股票、短期金融工具（含央行票据、债券回购）等，并根据开放式基金的申购和赎回情况，保留适当比例的现金。具体的投资范围如下表：

投资品种	目标比例	最高比例	最低比例	备注
可转换债券及其对应的基础股票	45%	70%	10%	可转换债券所对应的基础股票的投资比例不超过基金净资产的20%
其它债券（除可转换债券外）	30%	65%	10%	
其它股票（除可转换债券所对应的基础股票外）	20%	65%	10%	

十、基金的投资策略

（一）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。

1、整体投资组合策略

（1）资产配置策略

本基金将通过宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测，并利用公司研究开发的各种数量模型工具，分析和比较不同证券子市场和不同金融工具的收益及风险特征，积极寻找各种可能的套利和价值增长的机会，以确定基金资产的分配比例，如股票市场、债券市场和短期资金市场的资产配置比例；可转换债券在债券投资中的配置比例；债券投资中的市场配置比例；股票和可转换债投资中的行业配置比例等。

同时基金管理人将根据预先的研究和判断，对不同的证券子市场和金融工具设定收益目标，主动实现投资收益。

（2）资产调控策略

基金管理人将在深入分析和研究基础上，通过适时的债券回购和逆回购操作，提高基金资产的使用效率。此外，在获得有关监管机关的同意或许可后，本基金也将充分利用开放式回购等资产调控工具，在严格的风险管理基础上，以获得更多的投资收益，实现在市场上升和下跌时都可能为投资人获取收益的目标。如在市场价格处于上升过程中，本基金可以通过开放式回购交易等资产调控产品达到融资的效果；在市场价格处于下降过程中，本基金可以通过开放式回购交易等资产调控工具达到为投资人获取收益的效果；在市场价格不确定时，本基金可通过开放式逆回购等资产调控工具，将融入的固定收益类证券与现券进行对冲，实现套期保值，锁定收益；在市场资金紧张，短、长期回购成本倒置时，本基金可以通过回购利率组合进行套利。

本基金采用资产调控策略的资金余额不得超过基金净资产的40%，若未来有关监管机构有新规定的，按照有关监管机构的规定执行。

2、具体品种投资策略

（1）可转换债券及其对应的基础股票的投资策略

可转换债券同时具有债券、股票和期权的相关特性，结合了股票的长期增长潜力和债券的相对安全、收益固定的优势，并有利于从资产整体配置上分散利率风险并提高收益水平。本基金将重点从可转换债券的内在债券价值（如票面利息、利息补偿及无条件回售价格）、保护条款的适用范围、期权价值的大小、基础股票的质地和成长性、基础股票的流通性等方

面进行研究，在公司自行开发的可转债定价分析系统的支持下，充分发掘投资价值，并积极寻找各种套利机会，以获取更高的投资收益。

具体的投资方法包括但不限于：新券申购以获取一、二级市场的无风险收益；根据可转债的转股溢折价率，结合转债条款、股票基本面和流通性，确定可转债与其对应股票之间的配置比例，并利用转股期内基础股票转换价格与转债价格的定价偏差进行套利；当股市良好时，持有可转换债券或逢高卖出，以享受股市上升的利益；股市低迷时，持有可转换债券获取固定利息。

可转换债券及其对应的基础股票是本基金重要的投资品种。

（2）国债、企业债等其它固定收益类证券的投资策略

利率预期调整方法为本基金进行国债、企业债等其它固定收益类证券投资的核心策略。基金管理人将通过利率预期调整方法，确定整体投资组合。

在利率预期调整方法的基础上，基金管理人通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估，合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例。并灵活地采用收益率曲线方法、市场和品种选择方法等以组建一个有效的固定收益类证券组合。力求这些有效的固定收益类证券组合，在一定的风险度下能提供最大的预期收益，或者在确定收益率上承担最小的风险。

（3）其它股票的投资策略

本基金除了投资可转换债券所对应的基础股票外，还将通过基本面研究和数量分析相结合的方法，在公司开发的条件特征选股模型的支持下，选择具有良好投资价值的股票。

股票选择的过程如下：首先通过初步筛选选定研究目标，然后结合实地调研进行深入的基本面分析，并完成财务分析预测及价值评估模型，在力求获得准确的估值结果的基础上，形成明确的投资建议，最终纳入基金股票库。在形成基金股票库的过程中，本基金还将参考条件特征选股模型所给出的分析，以求进一步完善。条件特征模型是基于对大量股票价格正常及异常变动的研究，对包括行业差异等诸多因素进行分析，以获取评估公司内在价值的相关参数，从而确定被市场高估或低估的行业和公司。

此外，本基金还将分析、判断新股的二级市场定价，评估新股一、二级市场间的差价幅度。对于认定有投资价值的新股进行认购。

（二）投资管理的基本程序

1、投资决策

投资决策委员会定期召开会议，对阶段性的投资组合整体风险水平和资产分配比例做出讨论和决议；

2、研究支持

金融工程小组利用集成市场预测模型和风险控制模型对市场、行业、个券、个股进行分析和预期收益测算，研究部门从基本面分析对行业、个券、个股和市场走势提出研究报告，开放式基金注册部门提供申购、赎回与转换的动态情况，供基金经理参考；

3、构建组合

基金经理根据投资决策委员会决议及金融工程小组的研究成果，以及申购、赎回的动态情况，在综合判断的基础上，在授权范围内设计和调整投资组合；

4、交易执行

基金经理利用电子交易系统和银行间债券交易系统向独立的交易部门下达交易指令；

5、归因分析

金融工程小组利用公司开发的归因分析系统对投资组合中整体资产配置、股票行业配置、债券产品和期限配置、个股和个券选择、买卖成本等因素对整体业绩的贡献进行分析。该归因分析系统将为基金经理进行积极投资风险的控制和调整提供依据；

6、监察稽核

监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

（三）投资操作程序

1、决策流程

投资决策委员会将最终决策下达至基金经理，由基金经理落实投资决策委员会的决定。根据投资决策委员会的决定，基金经理必须组织研究部和金融工程小组开展进一步策划，对单个投资品种及权重，期限构成和数量等进行进一步的细化，提出完整的操作规划。

2、交易过程

基金经理将投资指令下达给集中交易部，由交易员组织实施具体操作，操作过程中交易员须提出完成组合投资的时间安排和价格控制目标，并开展交易。

3、评估过程

基金运作进行评估，主要包括两方面的内容，一是对投资组合构建执行情况的评估，主

要是评估交易完成进度、交易价格目标的实现情况、构建过程中市场流动性等变化对基金建仓成本的影响等；二是组合投资构建后对整个组合风险、收益等的综合评估。

4、归因分析与调整

基金经理在归因分析报告的基础上，根据宏观经济、市场走势和投资品种收益率等变化对投资组合进行调整，并根据调整要求对交易员下达投资指令，交易员完成投资指令、实现投资组合的调整。

（四）投资限制

基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金：

1、本基金投资组合应遵循下列规定：

(1) 本基金投资于股票、债券的比例，不低于本基金资产总值的 80%；

(2) 本基金持有 1 家上市公司的股票，不超过本基金资产净值的 10%；

(3) 本基金与由基金管理人管理的其它基金持有 1 家公司发行的证券的总和，不超过该证券的 10%；

(4) 中国证监会的其它比例限制。

法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，从其规定。

2、禁止用本基金资产从事以下行为：

(1) 承销证券；

(2) 向他人贷款或者提供担保；

(3) 从事承担无限责任的投资；

(4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；

(5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

(6) 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者其基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券；

(7) 从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

（五）基金的融资

本基金可以根据有关法律法规和政策的规定进行融资。

十一、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准 = 35% × 天相转债指数收益率 + 30% × 天相 280 指数收益率 + 30% × 天相国债全价指数收益率 + 5% × 金融同业存款利率

十二、基金的风险收益特征

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。

十三、基金的投资组合报告（未经审计）

1 报告期末基金资产组合情况

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

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	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

4 报告期末按券种品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	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

5 报告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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	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

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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 报告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 投资组合报告附注

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

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

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
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

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	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

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	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

十四、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。

(一) 基金净值表现

历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较

(截至时间 2009 年 6 月 30 日)

阶段	净值增长率①	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
自 2004-8-24 (合同生效日) 至 2004-12-31	0.20%	0.32%	-1.66%	0.52%	1.86%	-0.20%
2005-1-1 至 2005-12-31	12.75%	0.79%	3.14%	0.49%	9.61%	0.30%
2006-1-1 至 2006-12-31	124.82%	1.15%	48.50%	0.61%	76.32%	0.54%
2007-1-1 至	108.00%	1.53%	80.75%	1.25%	27.25%	0.28%

2007-12-31						
2008-1-1 至						
2008-12-31	-38.20%	1.68%	-30.84%	1.22%	-7.36%	0.46%
2009-1-1 至						
2009-6-30	37.90%	1.16%	32.13%	0.83%	5.77%	0.33%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十五、费用概览

（一）与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

（1）基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的年费率1.2%计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

（3）投资交易费用

（4）基金信息披露费用

（5）基金份额持有人大会费用

（6）与基金相关的会计师费和律师费

(7) 按照国家有关规定可以列入的其他费用

上述基金费用中第(3)至(7)项费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

2、不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

3、费用调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

(二) 与基金销售有关的费用

与基金销售有关的费用主要包括基金的申购费、赎回费、转换费等,上述费用具体的费率、计算公式、收取使用方式等内容请参见本基金更新的招募说明书“八、基金份额的申购、赎回与转换”。

(三) 基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律法规执行。

十六、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

章节	主要更新内容
三、基金管理人	更新了“主要人员情况”。
四、基金托管人	更新了基金托管人的有关资料。
五、相关服务机构	更新了直销机构的联系电话; 更新了TA的传真号; 更新了代销机构的有关资料。
六、基金日常申购、赎回及基金转换	更新了“(二)日常申购、赎回与转换的场所” 直销机构的相关信息,简化了代销机构信息;

	更新了“(三)日常申购、赎回与转换的开放日及时间”的相关信息； 新增了“(七)申购与赎回的费用”，新增“对特定交易方式(如网上交易、电话交易等)，基金管理人可以调低基金申购费率和基金赎回费率。”； 其余序号依次顺延。
九、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
十、基金的业绩	更新了基金合同生效以来的投资业绩。
十四、基金的费用与税收	简化了“(二)与基金销售有关的费用”。
二十一、对基金份额持有人的服务	更新了“(一)持有人注册登记服务”的相关信息； 更新了“(二)持有人投资记录邮寄服务”的相关信息； 更新了“(四)定期定额投资计划”的代销机构信息； 更新了“(五)基金转换”的代销机构信息； 更新了“(六)基金电子交易”的相关信息。 更新了“(十一)资讯服务”的相关信息。
二十二、其他应披露事项	披露了自2009年2月25日至2009年8月24日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司

二〇〇九年九月三十日