

华安宝利配置证券投资基金 2009 年年度报告摘要

2009 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：2010 年 3 月 29 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 2010 年 3 月 20 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安宝利配置混合	
基金主代码	040004	
交易代码	040004（前端）	041004（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004 年 8 月 24 日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,331,460,220.77 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司 (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	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-32169999

人	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话	40088-50099	95559	
传真	021-68863414	021-62701216	

2.4 信息披露方式

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

§ 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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	1,252,151,502.70	-1,629,775,432.98	1,609,630,194.39
本期利润	1,797,990,724.66	-2,037,254,863.10	1,634,175,911.37
加权平均基金份额本期利润	0.4227	-0.4516	0.8792
本期基金份额净值增长率	60.64%	-38.20%	108.00%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0481	-0.3422	0.0436
期末基金资产净值	4,771,627,751.49	2,894,572,949.82	3,234,899,997.13
期末基金份额净值	1.102	0.686	1.149

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	18.75%	1.30%	9.50%	0.75%	9.25%	0.55%
过去六个月	16.49%	1.54%	4.47%	1.22%	12.02%	0.32%
过去一年	60.64%	1.37%	39.49%	1.05%	21.15%	0.32%
过去三年	106.50%	1.54%	44.74%	1.19%	61.76%	0.35%
过去五年	423.48%	1.35%	125.63%	0.99%	297.85%	0.36%
自基金合同	424.53%	1.31%	120.34%	0.96%	304.19%	0.35%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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%。

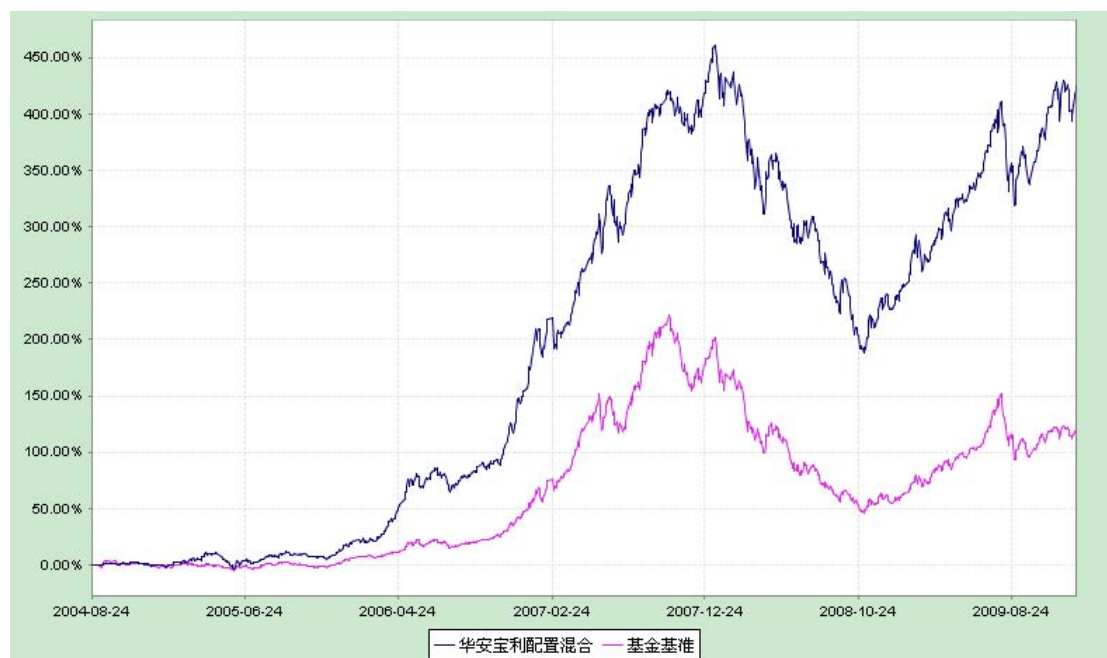
截至 2009 年 12 月 31 日，本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的比例为 25.83%，其中所对应的基础股票的投资比例为资产净值的 18.57%；除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的比例为 10.58%；除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的比例为 58.46%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

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

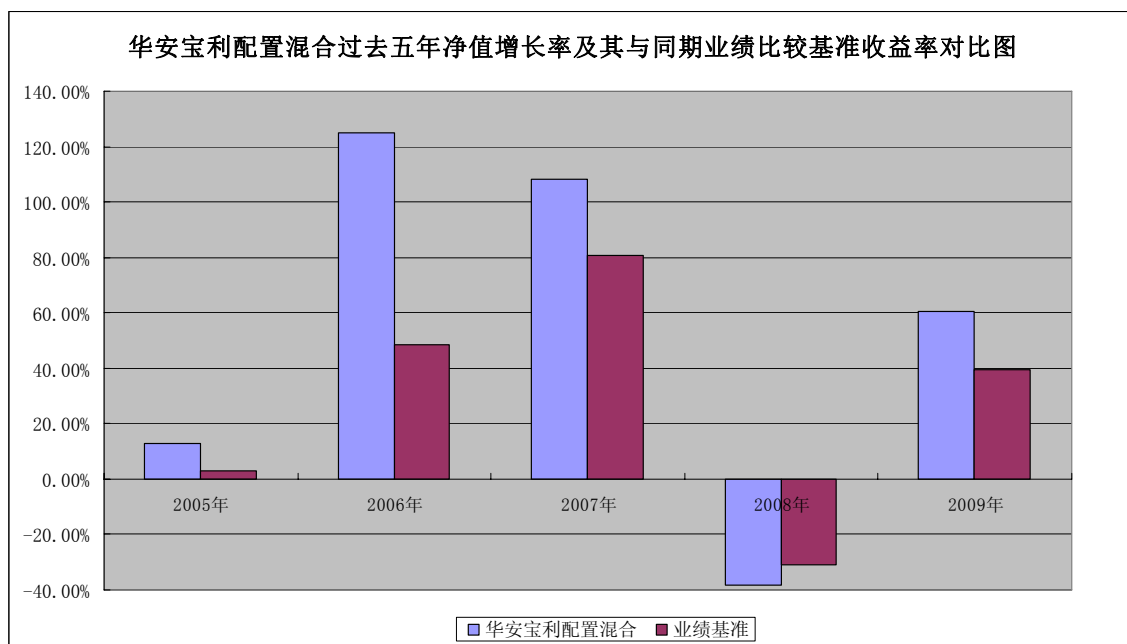
华安宝利配置证券投资基金

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 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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
2009 年	—	—	—	—	—
2008 年	0.400	53,862,625.81	59,957,242.72	113,819,868.53	为 2007 年度批准、公告但在 2008 年度实施的利润分配。
2007 年	11.000	758,088,305.17	979,328,218.05	1,737,416,523.22	—
合计	11.400	811,950,930.98	1,039,285,460.77	1,851,236,391.75	—

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为上海电气（集团）总公司、上海国际信托有限公司、上海工业投资（集团）有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。

截至 2009 年 12 月 31 日，公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭 2 只封闭式证券投资基金，华安创新混合、华安中国 A 股增强指数、华安宝利配置混合、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

动态灵活配置混合、华安上证 180ETF 联接、华安国际配置(QDII)等 14 只开放式基金，管理资产规模达到 930.18 亿人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邓跃辉	本基金的 基金经理	2008年4月 25日	2010年3 月19日	7年	经济学硕士，CFA，CPA，7 年基金行业从业经历。2003 年 4 月加入华安基金管理公司，曾任研究发展部高级研究员，2008 年 2 月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	—	16年	经济学硕士，16 年证券、基金行业从业经历。历任安徽省国际信托投资公司投资银行部业务主办、股票自营部投资经理；华安基金管理有限公司研究发展部高级研究员；亚洲证券资产管理总部副总经理兼固定收益证券管理总部副总经理、研究所副所长；华富基金管理公司资深研究员、投研部副总监等职。2006 年 6 月 21 日至 2007 年 10 月 27 日任华富

					货币市场基金基金经理，2007 年 5 月 12 日至 2008 年 5 月 17 日同时任华富成长趋势股票型证券投资基金基金经理。2008 年 6 月重新加入华安基金管理公司，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，即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易，公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”，并按此原则开发上线了基金（账户）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《交易端公平交易管理办法-银行间业务》以及《基金（账户）参与新股询价与申购业务管理办法》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

本报告期没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年, 全球几乎同步实施了经济刺激政策, 我国则实施了适度宽松的货币政策和积极的财政政策, M1、M2 增速一度创出了多年来的新高, 经济复苏步伐稳健, 全球资金逐步从发达市场流入新兴市场, 海内、外股市屡创新高, 我们在 2008 年报告中曾用“悲情”来回首“2008”, 用“期待”来展望“2009”, 实际上, 2009 年的走势之好是超过大部分投资者预期的。

基于对 2009 年行情的较为乐观的判断, 本基金从 2009 年初就提高了基金仓位并逐步加大了周期性股票的配置比重, 虽然在 3、4 月份有一次错误的大幅度减仓行为, 但很快就进行了纠正, 全年来看, 本基金仓位基本维持在较高水平, 并在四季度把握了几次波段机会; 行业配置方面, 虽对某些景气行业有所偏重, 但偏离基准幅度不大, 为基金带来的超额收益也不算显著, 基金超额收益主要来自于仓位判断和个股选择, 基金投资人在未来的基金投资中需在行业投资力度上有所加强。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日, 本基金份额净值为 1.102, 本报告期净值增长率 60.64%, 同期业绩比较基准收益率为 39.49%。

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 2010 年, 形势较 2009 年显著复杂, 一方面, 面临着经济刺激政策逐步退出的现实, 央行行长周小川也表示今年要高度关注通货膨胀, 另外随着流通市值和直接融资比例的加大, 系统性估值进一步提升的可能性越来越小; 另一方面, 有了 2008 年的紧缩效应, 央行行业周小川明确表示货币政策会根据经济指标动态调整, 加之宏观经济复苏明确, 甚至还出现了“民工荒”、“电荒”等过热现象, 企业效益改善显著, 市场大幅下跌也缺乏必要条件。

我们将按照国家经济结构调整的方向, 努力寻找“大科技”、“大消费”中低估的品种, 同时积极进行波段操作, 争取为投资人取得良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、估值政策及重大变化

无。

2、估值政策重大变化对基金资产净值及当期损益的影响

无。

3、有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

(1) 公司方面

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

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

相关人员专业胜任能力及工作经历：

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

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

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

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

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

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有限公司，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

本报告期由于基金无可供分配利润，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 年度，华安基金管理有限公司在华安宝利配置证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2009 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

本报告期基金财务报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，注册会计师马颖施、金毅签字出具了普华永道中天审字(2010)第 20110 号标准无保留意见的审计报告。投资者欲查看审计报告全文，应阅读年度报告正文。

§ 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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资 产：		
银行存款	10,383,234.23	290,056,396.20
结算备付金	387,389,138.88	2,490,643.56
存出保证金	4,713,203.60	1,492,773.59
交易性金融资产	4,526,764,778.15	2,625,127,750.08
其中：股票投资	3,675,690,304.48	1,459,486,558.53
基金投资	-	-
债券投资	851,074,473.67	1,165,641,191.55
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	30,003,619.69	12,928,099.59
应收利息	8,177,822.52	13,216,153.16
应收股利	-	-
应收申购款	1,697,911.16	6,094,981.29
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	20,000.00
资产总计	4,969,129,708.23	2,951,426,797.47
负债和所有者权益	本期末 2009年12月31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	99,999,650.00	-
应付证券清算款	67,811,056.09	22,387,620.99
应付赎回款	14,147,980.03	27,229,236.27
应付管理人报酬	4,784,991.60	3,006,473.01
应付托管费	996,873.26	626,348.57
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,070,424.10	2,461,795.34
应交税费	918,852.60	536,312.40
应付利息	4,323.97	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	767,805.09	606,061.07
负债合计	197,501,956.74	56,853,847.65
所有者权益：		
实收基金	4,331,460,220.77	4,217,954,911.77

未分配利润	440,167,530.72	-1,323,381,961.95
所有者权益合计	4,771,627,751.49	2,894,572,949.82
负债和所有者权益总计	4,969,129,708.23	2,951,426,797.47

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.102 元，基金份额总额 4,331,460,220.77 份。

7.2 利润表

会计主体：华安宝利配置证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2009年1月1日至2009 年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年 12月31日
一、收入	1,905,246,090.50	-1,935,047,523.05
1. 利息收入	28,031,142.67	48,530,394.32
其中：存款利息收入	4,013,344.29	5,618,696.80
债券利息收入	24,012,501.46	42,911,697.52
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	5,296.92	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	1,329,705,030.24	-1,578,121,343.50
其中：股票投资收益	1,270,462,016.96	-1,605,087,999.28
基金投资收益	-	-
债券投资收益	42,794,716.75	8,278,158.68
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	292,820.80	2,684,471.49
股利收益	16,155,475.73	16,004,025.61
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	545,839,221.96	-407,479,430.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,670,695.63	2,022,856.25
减：二、费用	107,255,365.84	102,207,340.05
1、管理人报酬	46,929,309.19	46,415,668.49
2、托管费	9,776,939.40	9,669,930.98
3、销售服务费	-	-
4、交易费用	49,494,561.35	39,298,760.73
5、利息支出	639,921.13	6,413,894.33
其中：卖出回购金融资产支出	639,921.13	6,413,894.33
6、其他费用	414,634.77	409,085.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,797,990,724.66	-2,037,254,863.10

减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损“-”号填列）	1,797,990,724.66	-2,037,254,863.10

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：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,217,954,911.77	-1,323,381,961.95	2,894,572,949.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,797,990,724.66	1,797,990,724.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	113,505,309.00	-34,441,231.99	79,064,077.01
其中：1、基金申购款	1,938,839,958.05	-126,106,101.85	1,812,733,856.20
2、基金赎回款	-1,825,334,649.05	91,664,869.86	-1,733,669,779.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,331,460,220.77	440,167,530.72	4,771,627,751.49
	上年度可比期间 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	-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
-----------------	------------------	-------------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署

俞妙根

李炳旺

朱永红

基金管理公司负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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 2010 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券

业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和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 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

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

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

7.4.7 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、基金注册登记机构、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
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海沸点投资发展有限公司	基金管理人的原股东(2009年11月4日以前)
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东(自2009年11月4日起)
上海工业投资(集团)有限公司	基金管理人的股东

注：根据华安基金管理有限公司于 2009 年 11 月 4 日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监许可[2009]1087 号文批准，公司原股东上海沸点投资发展有限公司将其持有的华安基金管理有限公司 20%股权全部转让给国泰君安投资管理股份有限公司。

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期(2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 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 12 月 31 日)和上年度可比期间(2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日)均无应支付关联方的佣金。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	46,929,309.19	46,415,668.49
其中：支付销售机构的客户维护费	8,368,357.84	8,131,087.93

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	9,776,939.40	9,669,930.98

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。

7.4.8.3 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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的 各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金 额	利息收 入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	107,108,669.21	103,499,278.50
期间申购/买入总份额	19,291,532.69	3,609,390.71
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	126,400,201.90	107,108,669.21
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.92%	2.54%

注：基金管理人华安基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托申银万国证券股份有限公司办理，认购费为 1,000.00 元。

7.4.8.4.2 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 12 月 31 日）和上年度末（2008 年 12 月 31 日）均无投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 1 月 1 日至 2008 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	10,383,234.23	392,024.42	290,056,396.20	2,831,910.98

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

2. 本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按约定利率计息。于 2009 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(2008 年 12 月 31 日：同)。

7.4.8.6 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 12 月 31 日）和上年度可比期间内（2008 年 1 月 1 日至 2008 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009 年 12 月 29 日	2010 年 1 月 7 日	新股网上认购	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
601888	中国国旅	2009 年 9 月 25 日	2010 年 1 月 15 日	新股网下认购	11.78	20.94	89,359	1,052,649.02	1,871,177.46	-
601139	深圳燃气	2009 年 12 月 15 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	6.95	16.78	96,131	668,110.45	1,613,078.18	-
600239	云南城投	2009 年 4 月 14 日	预计 2010 年 4 月 12 日	非公开发行	15.18	22.79	4,000,000	60,720,000.00	91,160,000.00	-
600239	云南城投	2009 年 6 月 16 日	预计 2010 年 4 月 12 日	非公开发行-转增	-	22.79	2,000,000	-	45,580,000.00	-
600770	综艺股份	2009 年 12 月 21 日	预计 2010 年 12 月 17 日	非公开发行	12.00	12.20	1,400,000	16,800,000.00	17,080,000.00	-
002304	洋河股份	2009 年 10 月 29 日	2010 年 2 月 8 日	新股网下认购	60.00	113.99	18,559	1,113,540.00	2,115,540.41	-
002322	理工监测	2009 年 12 月 11 日	2010 年 3 月 18 日	新股网下认购	40.00	61.88	13,632	545,280.00	843,548.16	-
002326	永太科技	2009 年 12 月 15 日	2010 年 3 月 22 日	新股网下认购	20.00	31.27	33,895	677,900.00	1,059,896.65	-
002327	富安娜	2009 年 12 月 22 日	2010 年 3 月 30 日	新股网下认购	30.00	39.66	15,960	478,800.00	632,973.60	-
002331	皖通科技	2009 年 12 月 25 日	预计 2010 年 4 月 7 日	新股网下认购	27.00	27.00	26,748	722,196.00	722,196.00	-

002332	仙琚制药	2009 年 12 月 30 日	预计 2010 年 4 月 13 日	新股网下认购	8.20	8.20	57,145	468,589.00	468,589.00	-
000887	中鼎股份	2009 年 2 月 12 日	2010 年 2 月 25 日	非公开发行	6.16	13.96	3,000,000	18,480,000.00	41,880,000.00	-
000887	中鼎股份	2009 年 6 月 12 日	2010 年 2 月 25 日	非公开发行-送股	-	13.96	600,000	-	8,376,000.00	-
300002	神州泰岳	2009 年 9 月 29 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	58.00	105.20	45,557	2,642,306.00	4,792,596.40	-
300014	亿纬锂能	2009 年 10 月 15 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	18.00	39.55	32,686	588,348.00	1,292,731.30	-
300017	网宿科技	2009 年 10 月 15 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	-
300027	华谊兄弟	2009 年 10 月 19 日	2010 年 2 月 1 日	新股网下认购	28.58	55.43	55,467	1,585,246.86	3,074,535.81	-
300029	天龙光电	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	18.18	29.10	15,997	290,825.46	465,512.70	-
300030	阳普医疗	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 26 日	新股网下认购	25.00	35.10	25,052	626,300.00	879,325.20	-
300031	宝通带业	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	38.00	56.43	14,526	551,988.00	819,702.18	-
300032	金龙机电	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	19.00	29.80	29,419	558,961.00	876,686.20	-
300033	同花顺	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	52.80	70.86	13,084	690,835.20	927,132.24	-
300034	钢研高纳	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	19.53	34.53	67,656	1,321,321.68	2,336,161.68	-
300036	超图软件	2009 年 12 月 18 日	2010 年 3 月 25 日	新股网下认购	19.60	38.31	19,208	376,476.80	735,858.48	-
300039	上海凯宝	2009 年 12 月 18 日	预计 2010 年 4 月 9 日	新股网下认购	38.00	38.00	20,640	784,320.00	784,320.00	-
300040	九洲电气	2009 年 12 月 28 日	预计 2010 年 4 月 9 日	新股网下认购	33.00	33.00	26,074	860,442.00	860,442.00	-

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

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000709	唐钢股份	2009 年 12 月 16 日	资产重组	7.09	2010 年 1 月 25 日	6.60	10,000,000	72,068,953.86	70,900,000.00	复牌后更名为河北钢铁。

注：本基金截至 2009 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 99,999,650.00 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
060202	06 国开 02	2010 年 1 月 7 日	100.11	500,000	50,055,000.00
0801005	08 央票 05	2010 年 1 月 7 日	102.52	500,000	51,260,000.00
合计				1,000,000	101,315,000.00

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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	3,675,690,304.48	73.97
	其中：股票	3,675,690,304.48	73.97
2	固定收益投资	851,074,473.67	17.13
	其中：债券	851,074,473.67	17.13
	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	397,772,373.11	8.00
6	其他资产	44,592,556.97	0.90
7	合计	4,969,129,708.23	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

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	195,229,203.75	4.09
B	采掘业	358,795,148.14	7.52
C	制造业	1,404,691,063.35	29.44
C0	食品、饮料	206,024,449.32	4.32
C1	纺织、服装、皮毛	68,569,490.84	1.44
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	128,707,326.61	2.70

C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,879,598.83	0.04
C5	电子	2,169,417.50	0.05
C6	金属、非金属	409,946,802.33	8.59
C7	机械、设备、仪表	395,944,241.24	8.30
C8	医药、生物制品	191,449,736.68	4.01
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	69,385,610.78	1.45
E	建筑业	75,596,020.00	1.58
F	交通运输、仓储业	143,325,808.80	3.00
G	信息技术业	183,457,671.70	3.84
H	批发和零售贸易	99,781,180.24	2.09
I	金融、保险业	836,766,634.24	17.54
J	房地产业	246,938,164.52	5.18
K	社会服务业	28,579,263.15	0.60
L	传播与文化产业	3,074,535.81	0.06
M	综合类	30,070,000.00	0.63
	合计	3,675,690,304.48	77.03

8.3 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

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	601788	光大证券	8,515,209	217,308,133.68	4.55
2	600598	北大荒	12,801,915	195,229,203.75	4.09
3	601318	中国平安	2,820,000	155,353,800.00	3.26
4	600036	招商银行	8,600,000	155,230,000.00	3.25
5	600028	中国石化	10,500,078	147,946,099.02	3.10
6	600585	海螺水泥	2,951,453	147,159,446.58	3.08
7	600239	云南城投	6,000,000	136,740,000.00	2.87
8	600519	贵州茅台	770,000	130,761,400.00	2.74
9	002022	科华生物	5,741,216	125,675,218.24	2.63
10	601166	兴业银行	2,483,880	100,125,202.80	2.10

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.huaan.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	467,340,418.95	16.15
2	600028	中国石化	460,053,780.01	15.89
3	600030	中信证券	382,120,955.78	13.20
4	600016	民生银行	359,876,665.55	12.43

5	601601	中国太保	329,370,638.39	11.38
6	002024	苏宁电器	279,617,516.38	9.66
7	600598	北大荒	266,933,203.47	9.22
8	601166	兴业银行	250,315,348.81	8.65
9	601668	中国建筑	240,378,262.24	8.30
10	600036	招商银行	236,159,532.68	8.16
11	601788	光大证券	234,808,441.54	8.11
12	600808	马钢股份	213,537,611.57	7.38
13	002202	金风科技	211,476,997.09	7.31
14	002022	科华生物	202,352,288.13	6.99
15	000002	万科A	201,832,626.94	6.97
16	600585	海螺水泥	200,057,584.66	6.91
17	600269	赣粤高速	199,959,752.75	6.91
18	600162	香江控股	194,689,436.36	6.73
19	601009	南京银行	188,411,483.25	6.51
20	600770	综艺股份	188,235,106.64	6.50
21	601919	中国远洋	178,785,739.56	6.18
22	600519	贵州茅台	174,210,532.39	6.02
23	601088	中国神华	171,896,511.90	5.94
24	000960	锡业股份	165,319,545.76	5.71
25	600428	中远航运	158,962,375.56	5.49
26	600048	保利地产	155,011,928.96	5.36
27	600000	浦发银行	153,515,599.64	5.30
28	600489	中金黄金	150,508,831.63	5.20
29	000069	华侨城A	148,234,488.14	5.12
30	600050	中国联通	144,675,583.53	5.00
31	600123	兰花科创	144,134,256.89	4.98
32	000709	唐钢股份	140,950,421.00	4.87
33	601186	中国铁建	131,417,595.61	4.54
34	000061	农产品	127,442,587.87	4.40
35	600795	国电电力	123,025,513.18	4.25
36	600256	广汇股份	122,853,933.69	4.24
37	600690	青岛海尔	121,838,015.67	4.21
38	600500	中化国际	121,373,871.68	4.19
39	000527	美的电器	119,533,638.70	4.13
40	600383	金地集团	118,058,755.20	4.08
41	600019	宝钢股份	117,573,386.44	4.06
42	600837	海通证券	114,977,990.68	3.97
43	000422	湖北宣化	114,415,049.85	3.95
44	601666	平煤股份	113,951,352.00	3.94
45	601169	北京银行	111,691,154.80	3.86
46	601168	西部矿业	111,418,621.23	3.85
47	601398	工商银行	106,793,285.28	3.69
48	600325	华发股份	101,826,613.26	3.52
49	000680	山推股份	101,485,693.07	3.51
50	601006	大秦铁路	99,967,631.19	3.45
51	600001	邯郸钢铁	98,144,316.25	3.39

52	600761	安徽合力	96,294,134.16	3.33
53	000707	双环科技	95,363,063.42	3.29
54	000651	格力电器	95,145,944.13	3.29
55	002078	太阳纸业	94,374,145.16	3.26
56	601899	紫金矿业	93,753,012.30	3.24
57	000952	广济药业	93,539,125.17	3.23
58	600555	九龙山	92,953,870.40	3.21
59	600320	振华重工	91,740,138.28	3.17
60	000895	双汇发展	89,984,723.24	3.11
61	600739	辽宁成大	89,865,647.54	3.10
62	600523	贵航股份	87,193,136.66	3.01
63	600100	同方股份	86,190,911.51	2.98
64	000402	金融街	85,998,339.10	2.97
65	600635	大众公用	85,088,813.96	2.94
66	002233	塔牌集团	83,286,026.54	2.88
67	000951	中国重汽	83,174,791.78	2.87
68	600284	浦东建设	81,507,188.17	2.82
69	600089	特变电工	78,344,286.93	2.71
70	600395	盘江股份	77,573,610.93	2.68
71	000983	西山煤电	73,423,545.47	2.54
72	600352	浙江龙盛	73,333,139.08	2.53
73	601628	中国人寿	72,713,343.89	2.51
74	601939	建设银行	71,908,829.96	2.48
75	600219	南山铝业	68,770,367.30	2.38
76	000677	山东海龙	68,737,168.81	2.37
77	601333	广深铁路	67,747,870.61	2.34
78	600856	长百集团	66,878,350.49	2.31
79	002191	劲嘉股份	64,897,590.58	2.24
80	600735	新华锦	62,650,762.27	2.16
81	600815	厦工股份	62,403,611.51	2.16
82	002133	广宇集团	61,918,439.83	2.14
83	601988	中国银行	61,417,192.31	2.12
84	000060	中金岭南	61,087,935.57	2.11
85	600239	云南城投	60,720,000.00	2.10
86	000024	招商地产	60,208,161.02	2.08
87	600887	*ST 伊利	60,171,728.51	2.08
88	000009	中国宝安	59,376,970.69	2.05
89	000550	江铃汽车	59,354,328.12	2.05
90	000839	中信国安	59,168,698.04	2.04
91	600694	大商股份	58,225,632.64	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600030	中信证券	413,569,509.25	14.29

2	601318	中国平安	382,327,030.01	13.21
3	601088	中国神华	361,171,929.14	12.48
4	600028	中国石化	354,758,856.11	12.26
5	601601	中国太保	337,316,865.67	11.65
6	600016	民生银行	331,949,463.37	11.47
7	002024	苏宁电器	317,360,431.47	10.96
8	002202	金风科技	266,972,442.65	9.22
9	000002	万科A	250,414,364.31	8.65
10	601166	兴业银行	197,950,060.71	6.84
11	601919	中国远洋	188,485,360.69	6.51
12	600036	招商银行	187,793,632.12	6.49
13	600048	保利地产	181,545,598.30	6.27
14	600770	综艺股份	180,309,297.45	6.23
15	600000	浦发银行	174,735,078.95	6.04
16	000069	华侨城A	169,012,008.22	5.84
17	601668	中国建筑	163,557,091.48	5.65
18	600269	赣粤高速	157,487,059.55	5.44
19	000422	湖北宜化	154,866,339.09	5.35
20	601398	工商银行	149,551,447.00	5.17
21	601186	中国铁建	149,303,136.99	5.16
22	600162	香江控股	143,483,311.48	4.96
23	601169	北京银行	142,820,842.47	4.93
24	600837	海通证券	141,669,478.45	4.89
25	600690	青岛海尔	139,698,456.52	4.83
26	000061	农产品	137,800,338.72	4.76
27	000527	美的电器	133,934,781.01	4.63
28	600808	马钢股份	130,722,911.64	4.52
29	600256	广汇股份	130,163,612.08	4.50
30	600123	兰花科创	127,372,913.67	4.40
31	600383	金地集团	127,248,993.61	4.40
32	600683	京投银泰	121,602,293.66	4.20
33	600019	宝钢股份	119,790,320.20	4.14
34	600050	中国联通	115,756,797.63	4.00
35	600739	辽宁成大	113,488,866.60	3.92
36	600598	北大荒	111,152,303.10	3.84
37	600761	安徽合力	110,608,100.07	3.82
38	002022	科华生物	108,816,806.05	3.76
39	600001	邯郸钢铁	108,788,911.85	3.76
40	601009	南京银行	107,958,392.19	3.73
41	601006	大秦铁路	107,079,380.20	3.70
42	600325	华发股份	104,586,445.01	3.61
43	000983	西山煤电	103,695,484.03	3.58
44	000895	双汇发展	101,976,612.16	3.52
45	600585	海螺水泥	101,675,308.47	3.51
46	600352	浙江龙盛	101,293,320.20	3.50
47	000952	广济药业	100,880,331.90	3.49
48	601168	西部矿业	100,328,364.61	3.47

49	000651	格力电器	100,207,909.09	3.46
50	601899	紫金矿业	98,397,828.62	3.40
51	600415	小商品城	97,134,851.58	3.36
52	600635	大众公用	94,463,544.71	3.26
53	600100	同方股份	93,977,681.76	3.25
54	600489	中金黄金	93,628,683.51	3.23
55	000960	锡业股份	93,458,685.90	3.23
56	600320	振华重工	91,587,237.49	3.16
57	000060	中金岭南	90,155,808.98	3.11
58	600428	中远航运	88,577,753.13	3.06
59	002233	塔牌集团	87,903,160.50	3.04
60	600523	贵航股份	86,649,996.45	2.99
61	000707	双环科技	82,924,474.95	2.86
62	600887	*ST 伊利	81,110,902.75	2.80
63	601666	平煤股份	80,688,669.67	2.79
64	600738	兰州民百	75,816,276.37	2.62
65	601628	中国人寿	75,199,194.41	2.60
66	600284	浦东建设	74,999,262.27	2.59
67	600479	千金药业	74,207,042.16	2.56
68	002191	劲嘉股份	73,988,432.42	2.56
69	002080	中材科技	73,100,619.65	2.53
70	000792	盐湖钾肥	72,639,080.99	2.51
71	000677	山东海龙	71,347,820.48	2.46
72	601333	广深铁路	71,059,238.24	2.45
73	000024	招商地产	70,797,073.30	2.45
74	000538	云南白药	70,266,283.57	2.43
75	601939	建设银行	69,615,976.90	2.41
76	600037	歌华有线	68,792,305.81	2.38
77	600026	中海发展	67,693,772.08	2.34
78	000839	中信国安	67,168,664.09	2.32
79	600649	城投控股	65,362,928.97	2.26
80	600219	南山铝业	64,884,540.18	2.24
81	600309	烟台万华	63,349,156.83	2.19
82	002106	莱宝高科	63,217,134.53	2.18
83	000709	唐钢股份	61,286,639.05	2.12
84	000898	鞍钢股份	60,242,883.49	2.08
85	600169	太原重工	59,645,417.72	2.06
86	600005	武钢股份	58,502,090.30	2.02
87	601988	中国银行	58,472,303.20	2.02
88	600694	大商股份	58,449,129.15	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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额：	16,481,094,774.88
卖出股票的收入（成交）总额：	16,103,981,803.13

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	69,796,537.50	1.46
2	央行票据	208,935,000.00	4.38
3	金融债券	110,700,000.00	2.32
	其中：政策性金融债	110,700,000.00	2.32
4	企业债券	229,188,344.30	4.80
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	232,454,591.87	4.87
7	其他	-	-
8	合计	851,074,473.67	17.84

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	0901036	09 央票 36	1,000,000	98,290,000.00	2.06
2	126002	06 中化债	560,000	51,497,600.00	1.08
3	0801005	08 央票 05	500,000	51,260,000.00	1.07
4	060202	06 国开 02	500,000	50,055,000.00	1.05
5	110003	新钢转债	350,000	48,153,000.00	1.01

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

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

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

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	4,713,203.60
2	应收证券清算款	30,003,619.69
3	应收股利	-
4	应收利息	8,177,822.52
5	应收申购款	1,697,911.16
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	44,592,556.97

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	110003	新钢转债	48,153,000.00	1.01
2	110598	大荒转债	39,353,268.80	0.82
3	125709	唐钢转债	22,219,194.69	0.47
4	125960	锡业转债	21,051,800.00	0.44
5	110567	山鹰转债	9,819,600.00	0.21

8.9.5.1 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	136,740,000.00	2.87	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
174,933	24,760.68	1,253,857,083.32	28.95%	3,077,603,137.45	71.05%

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	111,182.58	0.0026%
--------------------------	------------	---------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2004 年 8 月 24 日）基金份额总额	1,130,480,770.08
本报告期期初基金份额总额	4,217,954,911.77
本报告期基金总申购份额	1,938,839,958.05
减：本报告期基金总赎回份额	1,825,334,649.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,331,460,220.77

§ 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). 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。

(3). 2009 年 11 月 17 日，本基金管理人发布关于董事长变更的公告，经本公司董事会会议审议通过，同意徐建国同志辞去本公司董事长职务，并选举俞妙根同志任本公司董事长。俞妙根同志的董事长任职资格已经中国证券监督管理委员会证监许可[2009]1144 号文核准。在公司总经理招聘工作尚未完成之前，俞妙根同志将兼任公司总经理职务。。

(4). 2010 年 1 月 16 日，本基金管理人发布关于关于董事变更的公告，经本公司股东会审议通过，选举董鑑华先生、王松先生担任本公司董事，徐建国先生不再担任本公司董事。

(5). 2010 年 3 月 19 日，本基金管理人发布关于基金经理变更的公告，鉴于邓跃辉先生因个人原因提出辞职，经华安基金管理有限公司研究，同意其辞职申请，并免去其华安宝利配置证券投资基金与华安策略优选股票型证券投资基金的基金经理职务。

2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬情况为人民币 101,000.00 元。

目前的审计机构已提供审计服务的连续年限：自基金合同生效日起至今。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内无管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况：

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券有限责任公司	1	516,127,035.90	1.59%	438,708.97	1.61%	—
长城证券有限责任公司	1	1,032,963,976.03	3.19%	878,015.39	3.23%	—
中银国际证券有限责任公司	1	1,132,956,467.81	3.50%	963,017.56	3.54%	—
海通证券股份有限公司	1	8,056,177,898.11	24.88%	6,545,708.60	24.08%	—
红塔证券股份有限公司	1	9,117,434,468.46	28.15%	7,749,788.43	28.51%	—
中信建投证券有限责任公司	1	1,247,545,701.23	3.85%	1,013,640.36	3.73%	—
申银万国证券股份有限公司	1	1,987,122,554.39	6.14%	1,689,046.98	6.21%	—
兴业证券股份有限公司	1	4,207,456,947.74	12.99%	3,576,313.84	13.16%	—
中信证券股份有限公司	1	5,086,963,031.10	15.71%	4,323,888.54	15.91%	—

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	回购交易		债券交易		权证交易	
		成交金额	占当期回购成交总额的比例	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	1.08%	—	—
长城证券有限责任公司	1	—	—	9,612,776.00	0.75%	—	—
中银国际证券有限责任公司	1	50,000,000.00	3.92%	63,421,225.30	4.92%	—	—

海通证券股份有限公司	1	-	-	154,030,057.94	11.94%	-	-
红塔证券股份有限公司	1	468,600,000.00	36.78%	358,444,717.50	27.79%	-	-
中信建投证券有限责任公司	1	-	-	48,116,393.25	3.73%	-	-
申银万国证券股份有限公司	1	90,000,000.00	7.06%	118,716,791.80	9.20%	-	-
兴业证券股份有限公司	1	386,600,000.00	30.35%	235,249,931.40	18.24%	-	-
中信证券股份有限公司	1	278,700,000.00	21.88%	288,274,060.00	22.35%	791,999.61	100%

注：1、本报告期内，本基金交易单元未发生变更情况。

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。

华安基金管理有限公司
2010 年 3 月 29 日