华安宝利配置证券投资基金

2011 年度报告摘要

基金管理人:华安基金管理有限公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一二年三月二十九日

§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2012年3月19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2011年1月1日起至12月31日止。

§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	4,530,296,380.93份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	张咏东
	联系电话	021-38969999	021-32169999
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701216

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	www.huaan.com.cn
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、32层

§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	2011年	2010年	2009年
本期已实现收益	95,010,097.80	285,782,104.55	1,252,151,502.70
本期利润	-809,763,133.41	257,563,703.27	1,797,990,724.66
加权平均基金份额本期利润	-0.2079	0.0669	0.4227
本期基金份额净值增长率	-15.12%	7.53%	60.64%
3.1.2 期末数据和指标	2011年末	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0330	0.0482	-0.0481
期末基金资产净值	4,380,620,519.54	3,395,966,210.58	4,771,627,751.49
期末基金份额净值	0.967	1.185	1.102

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	-7.46%	0.98%	-0.34%	0.61%	-7.12%	0.37%
过去六个月	-16.85%	0.93%	-9.97%	0.61%	-6.88%	0.32%
过去一年	-15.12%	1.01%	-11.14%	0.55%	-3.98%	0.46%
过去三年	46.62%	1.20%	10.26%	0.79%	36.36%	0.41%
过去五年	88.48%	1.38%	15.85%	1.00%	72.63%	0.38%
自基金合同生效起至今	378.75%	1.26%	70.24%	0.88%	308.51%	0.38%

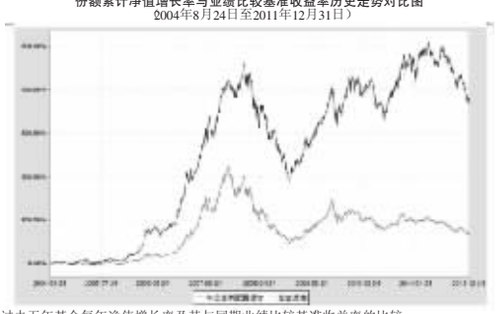
注:本基金的业绩比较基准为:大相转债指数收益率×35%+大相280 指数收益率×30%+大相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

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2011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13.93%,其中所对应的基础股票的投资比例为资产净值的8.62%;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13.77%;除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的比例为63.56%。上述各项投资比例均符合基金合同的规定。

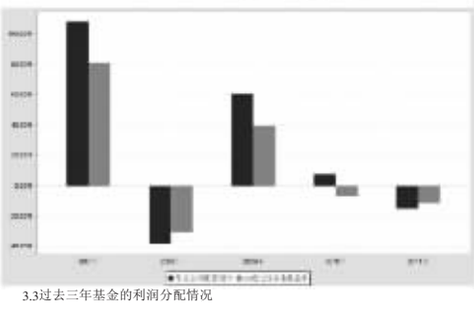
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华安宝利配置证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004年8月24日至2011年12月31日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华安宝利配置证券投资基金
过去五年净值增长率图



3.3过去三年基金的利润分配情况

金额单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2011年	0.450	65,131,229.16	63,734,230.71	128,865,459.87	-
2010年	-	-	-	-	-
2009年	-	-	-	-	-
合计	0.450	65,131,229.16	63,734,230.71	128,865,459.87	-

§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2011年12月31日,公司旗下共管理了华安安信封闭、华安安顺封闭2只封闭式证券投资基金,华安创新混合、华安中国A股增强指数、华安现金富利货币、华安宝利配置混合、华安上证180ETF、华安上证180ETF联接、华安宏利股票、华安中小盘成长股票、华安策略优选股票、华安核心优选股票、华安稳定收益债券、华安动态灵活配置混合、华安强化收益债券、华安行业轮动股票、华安上证龙头ETF、华安上证龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安深证300指数(LOF)、华安稳固收益债券、华安可转债债券、华安信用四季红债券、华安科技动力股票、华安香港精选股票(QDII)、华安大中华升级股票(QDII)等24只开放式证券投资基金,管理资产规模达到795.34亿元人民币。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆从珍	本基金的基金经理	2010-04-21	-	11年	经济学硕士,11年证券、基金行业从业经历。历任上海市工商局职员;京华山一证券上海公司高级研究员;中企东方资产管理公司高级研究员;东方证券研究部资深研究员等职。2008年3月加入华安基金管理公司,任研究发展部高级研究员,2009年5月16日起至2010年4月21日担任安顺证券投资基金和华安宏利股票型证券投资基金的基金经理助理,2010年4月起担任本基金的基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日,即以公告日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

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

对于场内交易,公司《交易端公平交易管理办法-交易所业务》规定不同基金、账户同向买卖同一证券的交易分配原则是:时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡",不同基金、账户同向买卖同一证券完全通过交易系统进行比例分配,实现公平交易。本报告期内,场内业务的公平交易运作良好,未出现异常情况。

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

公司合规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察,风险管理部分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析。

4.3.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

华安旗下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

2011年没有出现异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2011年证券市场先扬后抑,震荡下行。继续呈现板块分化的特征,全年蓝筹、消费类板块表现明显优于强周期、新兴行业。2011年是超预期负面信息逐步兑现的过程,市场的逐级下探主要是受到超预期的不利经济基本面影响。国内通胀的屡创新高超预期、欧债危机的愈演愈烈超预期,市场在接受上述负面信息的过程中,经历了休疑阶段、接受阶段和发挥阶段等九个时间段,反应在市场走势上也呈现震荡、下跌和快速下跌等几个阶段。在市场投资者信心悲化后,判断股价中也隐含了超出基本面下滑幅度的负面信息。

华安宝利的仓位在2011年基本维持在较低的水平,仓位变化幅度低于2010年。1季度重点配置于周期性品种,2季度开始配置趋向均衡,下半年在重点配置于银行、食品饮料方向的基础上,对全年跌幅较大的周期性品种进行了增持。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2011年12月31日,本基金份额净值为0.967元,本报告期份额净值增长率为-15.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2012年的经济基本面情况将以稳步整理为主,全球范围内并没有完全走出危机的阴影,中国需要继续进行经济结构的调整,作为承上启下的年度,国内的各项政策主要出发点也是求稳为主。欧、美需要消化危机,虽然短期出现了一些利好数据,但这些数据是在预期大幅调低后,变成的超预期数据,在预期回归正常水平后,超预期的难度将显著增加。尽管对于经济基本面的预期并不乐观,但考虑到股价中已隐含了很多负面预期,市场仍然存在来自于预期改善的机会。市场对短期经济不利的容忍度远远低于对长期前景不明朗的容忍度,这就是即使认为是长期危机,也仍然有短期局部机会的原因。

目前市场的逻辑是经济基本面变差,然后政策会有对冲措施,而不是去年的紧盯基本面数据。在判断负面信息被充分预知的情况下,我们也认可上述逻辑,并以此为基础制定投资策略。

在行业选择方面,考虑政策有对冲经济下滑的冲动,虽然总体的政策基调还是以稳为主,判断市场机会将沿着对冲政策的路径来演绎。我们沿着政策敏感、行业景气度下降等因素去选择行业,景气度快速下滑的行业反而能得到对冲政策的青睐。考虑经济弱势,总体市场将以局部轮动为主,总体配置仍然采取均衡式结构。

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、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:

尚志民,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,华安基金管理有限公司首席投资官。

李炳旺先生,研究生学历,24年基金业工作经验。曾任台湾国际证券投资信托股份有限公司信息技术部暨注册登记部经理、台湾摩根富林明证券投资信托股份有限公司市场部经理、注册登记部协理、信息技术部副总经理、综合规划部副总经理,2011年8月24日离职,离任前华安基金管理有限公司副总裁。

杨明,投资研究部总监,研究生学历,12年金融、证券、基金从业经验,曾在上海银行工作。2004年10月进入华安基金管理有限公司,担任研究发展部宏观研究员,现任投资研究部总监。

宋磊,投资研究部联席总监,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、投资研究部联席总监。

黄勤,固定收益部总经理,经济学硕士。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、华安信用四季红债券型证券投资基金的基金经理、固定收益部总监。

许之彦,金融工程部总经理,理学博士,CQF(国际数量金融工程师)。曾在广发证券和中山大学经济管理学院博士后流动站从事金融工程工作,2005年加入华安基金管理有限公司,曾任研究发展部数量策略分析师,现任华安中国A股增强指数、华安上证180ETF及华安上证180ETF联接、华安上证龙头ETF和华安上证龙头ETF联接,华安深证300指数证券投资基金(LOF)的基金经理,指数投资部总监。

陈林,基金运营部总经理,工商管理硕士,高级会计师,CPA中国注册会计师协会非执业会员。曾在安永大华会计师事务所工作,2004年11月加入华安基金管理有限公司,曾任财务核算部副总监、公司财务部总经理,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

1、2010年度在本报告期内实施的利润分配:

本基金的基金管理人于2011年1月11日宣告分红,向截至2011年1月14日止在本基金注册登记人华安基金管理有限公司登记在册的全体持有人,按每10份基金份额派发红利0.45元。

2、2011年度收益分配方案。

本报告期内不进行收益分配。

§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

2011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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011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。

本报告期内本基金进行了1次收益分配,分配金额为128,865,459.87元,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

2011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,注册会计师汪棣、金毅签字出具了普华永道中天审字(2012)第20653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:2011年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
资产:		
银行存款	97,446,902.13	55,525,394.66
结算备付金	328,988,578.43	182,276,867.44
存出保证金	1,754,020.70	2,548,549.57
交易性金融资产	3,997,676,207.35	3,111,555,946.97
其中:股票投资	3,161,730,428.15	2,454,557,423.71
基金投资	-	-
债券投资	835,945,779.20	656,998,523.26
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	8,688,809.40	47,572,345.12
应收利息	11,473,101.12	8,089,154.93
应收股利	-	-
应收申购款	2,210,246.90	4,239,221.45
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,448,237,866.03	3,411,807,480.14
负债和所有者权益	**本期末 2011年12月31日**	**上年度末 2010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	27,469,782.94	1,930,641.76
应付赎回款	29,371,283.02	2,776,888.80
应付管理人报酬	4,523,881.13	3,592,807.88
应付托管费	942,475.22	748,501.65
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,402,232.44	4,856,643.01
应交税费	1,916,967.04	1,044,312.60
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	990,724.70	891,473.86
负债合计	67,617,346.49	15,841,269.56
所有者权益:		
实收基金	4,530,296,380.93	2,865,251,049.91
未分配利润	-149,675,861.39	530,715,160.67
所有者权益合计	4,380,620,519.54	3,395,966,210.58
负债和所有者权益总计	4,448,237,866.03	3,411,807,480.14

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值0.967元,基金份额总额4,530,296,380.93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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
一、收入	-725,623,005.65	350,102,927.38
1.利息收入	36,749,386.44	33,563,454.29
其中:存款利息收入	6,485,638.83	3,617,334.28
债券利息收入	28,255,307.30	29,607,345.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,008,440.31	338,774.95
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	141,090,432.37	342,980,217.89
其中:股票投资收益	115,313,507.24	301,130,331.22
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,666,784.83	24,982,672.09
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	23,110,140.30	16,867,214.58
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-904,773,231.21	-28,218,401.28
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,310,406.75	1,777,656.48
减:二、费用	84,140,127.76	92,539,224.11
1.管理人报酬	51,902,698.32	48,939,914.04
2.托管费	10,813,062.08	10,195,815.40
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	20,589,048.99	30,726,180.13
5.利息支出	422,358.95	2,261,724.05
其中:卖出回购金融资产支出	422,358.95	2,261,724.05
6.其他费用	412,959.42	415,590.49
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-809,763,133.41	257,563,703.27
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-809,763,133.41	257,563,703.27

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:2011年1月1日至2011年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	2,865,251,049.91	530,715,160.67	3,395,966,210.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-809,763,133.41	-809,763,133.41
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)	1,665,045,331.02	258,237,571.22	1,923,282,902.24
其中:1.基金申购款	2,844,553,634.07	408,921,148.34	3,253,474,782.41
2.基金赎回款	-1,179,508,303.05	-150,683,577.12	-1,330,191,880.17
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)	-	-128,865,459.87	-128,865,459.87
五、期末所有者权益(基金净值)	4,530,296,380.93	-149,675,861.39	4,380,620,519.54
	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	4,331,460,220.77	440,167,530.72	4,771,627,751.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	257,563,703.27	257,563,703.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-1,466,209,170.86	-167,016,073.32	-1,633,225,244.18
其中:1.基金申购款	639,433,978.74	49,756,756.88	689,190,735.62
2.基金赎回款	-2,105,643,149.60	-216,772,830.20	-2,322,415,979.80
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,865,251,049.91	530,715,160.67	3,395,966,210.58

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:李勍,主管会计工作负责人:赵敏,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1基金基本情况

华安宝利配置证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2004]第97号《关于同意华安宝利配置证券投资基金设立的批复》核准,由华安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宝利配置证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,130,461,912.15元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2004)第161号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宝利配置证券投资基金基金合同》于2004年8月24日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,130,480,770.08份基金份额,其中认购资金利息折合18,857.93份基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《华安宝利配置证券投资基金基金合同》和最新发布的《华安宝利配置证券投资基金更新的招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为45%,最低比例为10%,最高比例为70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的20%);除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为30%,最低比例为10%,最高比例为65%;除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为20%,最低比例为10%,最高比例为65%。本基金的业绩比较基准为:天相转债指数收益率×35%+天相280指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华安基金管理有限公司于2012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》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2011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2011年12月31日的财务状况以及2011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会计政策变更的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("华安基金公司")	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
上海锦江国际投资管理有限公司	基金管理人的股东
国泰君安投资管理股份有限公司	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8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(2011年1月1日至2011年12月31日)和上年度可比期间(2010年1月1日至2010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(2011年1月1日至2011年12月31日)和上年度可比期间(2010年1月1日至2010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(2011年1月1日至2011年12月31日)和上年度可比期间(2010年1月1日至2010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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	51,902,698.32	48,939,914.04
其中:支付销售机构的客户维护费	8,769,459.61	8,442,470.58

注:支付基金管理人华安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.2% / 当年天数。

7.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	10,813,062.08	10,195,815.40

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

其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.8.3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 2011年1月1日至2011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	360,374,740.09	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
交通银行股份有限公司	150,128,100.00	182,549,598.77	400,000,000.00	19,855.34	100,000,000.00	36,623.97

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 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
期初持有的基金份额	126,400,201.90	126,400,201.90
期间申购/买入总份额	5,301,033.62	-
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	131,701,235.52	126,400,201.90
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.91%	4.41%

注:期间申购/买入总份额为红利再投资份额。

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(2011年12月31日)和上年度末(2010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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	97,446,902.13	1,068,795.96	55,525,394.66	602,857.12

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2011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(2010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(2011年1月1日至2011年12月31日)和上年度可比期间内(2010年1月1日至2010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(2011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

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601100	恒立油缸	2011-10-21	2012-01-30	新股网下认购	23.00	16.71	785,046	18,056,058.00	13,118,118.66	-
601336	新华保险	2011-12-09	2012-03-16	新股网下认购	23.25	27.87	87,441