华安宏利股票型证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010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:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月二十六日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年3月23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2010年1月1日起至2010年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华安宏利股票	
基金主代码	040005	
交易代码	040005(前端)	041005(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006年9月6日	
基金管理人	华安基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,607,370,468.12份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	通过持续获取价格回归价值所带来的资本收益,以及分红所带来的红利收益,实现基金资产的稳定增值。
投资策略	本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的数量分析模型进行支持,使其更为科学和客观。
业绩比较基准	基金整体业绩比较基准=中信标普300指数收益率×90%+同业存款利率×10%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下,谋求实现基金财产的稳定增值。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	冯颖	尹东
	联系电话	021-38969999	010-67595003
	电子邮箱	fengying@huaan.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		4008850099	010-67595096
传真		021-68863414	010-66275833

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告摘要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	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	398,925,347.93	1,496,935,997.67	-3,715,666,282.19
本期利润	-296,896,403.05	6,205,469,629.63	-9,395,389,976.74
加权平均基金份额本期利润	-0.0634	1.2273	-1.6151
本期基金份额净值增长率	-1.30%	75.46%	-48.39%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.4483	0.3420	0.2780
期末基金资产净值	9,402,282,246.09	14,544,303,777.30	8,048,764,980.44
期末基金份额净值	2.6064	2.6406	1.6399

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	6.89%	1.54%	5.97%	1.57%	0.92%	-0.03%
过去六个月	24.33%	1.40%	20.26%	1.37%	4.07%	0.03%
过去一年	-1.30%	1.36%	-9.91%	1.41%	8.61%	-0.05%
过去三年	-10.61%	1.73%	-34.66%	2.07%	24.05%	-0.34%
自基金合同生效起至今	232.61%	1.80%	126.73%	2.02%	105.88%	-0.22%

本基金的业绩比较基准为:中信标普300指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%。

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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的60-95%,债券的投资比例为基金资产净值的5-40%,现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%以上。

截至2010年12月31日,本基金股票投资比例为基金资产净值的93.80%,债券的投资比例为基金资产净值的5.10%,现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的6.23%。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

华安宏利股票型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2006年9月6日至2010年12月31日)

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

华安宏利股票型证券投资基金
合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

合同生效日当年的净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算,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
2010年	-	-	-	-	-
2009年	2.300	525,292,822.53	686,942,275.44	1,212,235,097.97	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	2.300	525,292,822.53	686,942,275.44	1,212,235,097.97	-

§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2010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、上证180ETF联接基金、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、上证龙头ETF联接基金、华安国际配置、华安香港精选股票、华安稳固收益债券等19只开放式基金,管理资产规模达到825.65亿人民币。

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		
尚志民	本基金的基金经理、基金投资部总经理	2006-09-06	-	13	工商管理硕士,13年证券、基金从业经验,曾在上海证券研究所、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,1999年6月至2001年9月担任安顺证券投资基金的基金经理,2000年7月至2001年9月同时担任安瑞证券投资基金的基金经理,2001年9月至2003年9月担任华安创新证券投资基金的基金经理,2003年9月至今担任安顺证券投资基金的基金经理,2006年9月起同时担任本基金的基金经理。
陆从珍	本基金的基金经理助理	2009-05-16	2010-04-21	10	经济学硕士,10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;中金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日至2010年4月21日担任本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21日起担任华安宝利配置证券投资基金基金经理。

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《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》、《华安宏利股票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。

公司占规监察稽核部负责对各账户公平交易的事后监察,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

按照华安宏利股票与华安核心股票的基金合同,华安宏利基金和华安核心都属于价值型股票基金,2010年全年,华安宏利股票与华安核心股票的净值增长率分别为-1.30%与3.51%,二基金的业绩增长率差异未超过5%。

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

2010年,A股市场由于供求关系的变化整体呈现调整行情。通货膨胀从发生到加剧,货币政策从积极宽松到稳健,资金面较09年紧张,而高溢价和高市盈率发行的新股IPO、定向增发、配股等融资总额超过1万亿元,加上全流通的影响,市场供求关系受到较大影响。上半年股指跌幅高达30%,而下半年虽出现反弹,终究在年末难以抵制通胀压力和加息预期的双重考验,最终以全年跌幅高达17%,位居全球股票市场跌幅前列。

从行业走势看,行业涨幅分化明显,涨幅最高的电子元器件和最低的黑色金属有69个点的差距;医药生物、农林牧渔、食品饮料等非周期板块普遍上涨,而房地产、黑色金属、化工、金融等周期性板块表现较差;机械设备表现强劲创出新高,有色金属板块在金属价格创新高带动下走强。

本基金在2010年一直保持相对高的仓位运作,除在年中一度降仓到75%左右外,基本都在90%以上。年初我们判断指数下行空间不大,保持较高的股票仓位,重点配置金融保险、医药、食品饮料等行业。二季度大盘大幅调整过程中,本基金加大了减仓力度,减持了地产、金融等行业的配置,增加了长期前景看好的消费和战略新兴产业的配置,但仍承受了四月下旬后股指暴跌的系统性风险。7月上中旬大幅提高了基金仓位,较好的把握了大盘反弹的机会,3季度超越上证指数5.58个百分点。四季度本基金主要降低了前期涨幅较大的信息技术和商业零售行业的持仓,并对一些行业内持仓品种进行了调整。但由于在涨幅较大的资源类股票中参与较少,并且仓位保持较高比例,在后期大盘大幅下跌过程中受到一定损失,整体表现离预期尚有一定距离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日,本基金份额净值为2.6064元,本报告期份额净值增长率为-1.30%,同期业绩比较基准增长率为-9.91%。

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2011年,我们认为市场将在保增长和控通胀两者之间来回摆动,其中控制通胀的压力在2011年上半年会显得比较大。我们预计在2011年第二季度之前可能看不到通胀水平的明显下降。通胀已经成为影响2011年实体经济和资本市场走向的关键性问题——它对于股市的作用通过影响总需求和流动性两个不同的层面来体现。判断通胀高点出现的时点是2011年规避风险获得绝对收益的关键所在。

考虑到目前经济所处的产能周期末段特点,周期性行业将依次趋向供需平衡。采用绝对估值法测算,当前众多周期性行业公司股价已经基本反映了最悲观和中性情况之间的预期了。周期性行业比较容易在一个非常差的预期基础上实现需求或盈利的大幅度超预期。周期性行业盈利会迎来从悲观预期向历史均值回归的过程。

积极寻找下一个10年周期里面的支柱性行业是2011年乃至未来几年的重要课题。我们非常乐于见到在中央层面就收入分配制度改革以及税收制度调整展开的讨论。我们认为这样的讨论会加速将其落实到执行层面,并由此带来对于消费的巨大刺激。我们还发现,即便是经历了2008年危机,消费服务相关领域的投资依然保持了相当的增速。一旦未来居民收入实质性提高、并配合住房以及医疗领域保障的落实,消费定将迎来加速度美好前景。我们看好商业贸易零售以及由此衍生的物流等相关领域的投资机会。

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:

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。

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,现任华安基金管理有限公司副总裁。

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,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联接的基金经理,金融工程部总经理。

朱永红,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,2010年11月19日离职前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

本基金的基金经理尚志民作为估值委员会成员参与了基金的估值方法的讨论与确认。

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

2010年度本基金无利润分配。

§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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§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(2011)第20333号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:华安宏利股票型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资 产:		
银行存款	129,966,283.78	288,992,379.59
结算备付金	11,183,944.82	29,855,140.47
存出保证金	689,380.89	204,269.22
交易性金融资产	9,298,845.639.31	14,389,600,296.28
其中:股票投资	8,819,387,329.71	13,637,362,296.28
基金投资	-	-
债券投资	479,458,309.60	752,238,000.00
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	77,120,996.02	-
应收利息	11,324,503.41	4,134,785.42
应收股利	-	-
应收申购款	2,164,841.83	103,237,462.56
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	9,531,295,590.06	14,816,024,333.54
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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	100,903,852.86	220,416,624.13
应付赎回款	4,655,362.59	19,069,796.95
应付管理人报酬	12,531,652.19	18,352,583.74
应付托管费	2,088,608.69	3,058,763.98
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	7,621,764.67	9,766,944.34
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	1,212,102.97	1,055,843.10
负债合计	129,013,343.97	271,720,556.24
所有者权益:		
实收基金	3,607,370,468.12	5,507,885,070.97
未分配利润	5,794,911,777.97	9,036,418,706.33
所有者权益合计	9,402,282,246.09	14,544,303,777.30
负债和所有者权益总计	9,531,295,590.06	14,816,024,333.54

报告截止日2010年12月31日,基金份额净值2.6064元,基金份额总额3,607,370,468.12份。

7.2 利润表

会计主体:华安宏利股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	-47,984,705.28	6,480,452,163.69
1.利息收入	19,593,789.90	28,709,552.43
其中:存款利息收入	4,646,879.45	7,539,637.86
债券利息收入	14,946,910.45	21,169,914.57
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	623,373,605.92	1,736,370,056.01
其中:股票投资收益	531,272,241.59	1,653,712,968.54
基金投资收益	-	-
债券投资收益	3,851,504.79	1,160,063.59
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	88,249,859.54	81,497,023.88
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-695,821,750.98	4,708,533,631.96
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	4,869,649.88	6,838,923.29
减:二、费用	248,911,697.77	274,982,534.06
1.管理人报酬	171,893,876.89	180,217,871.52
2.托管费	28,648,979.58	30,036,311.91
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	47,865,051.01	63,669,853.70
5.利息支出	-	543,717.17
其中:卖出回购金融资产支出	-	543,717.17
6.其他费用	503,790.29	514,779.76
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-296,896,403.05	6,205,469,629.63
减:所得税费用	-	-
四、净利润(亏损以"-"号填列)	-296,896,403.05	6,205,469,629.63

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:华安宏利股票型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	5,507,885,070.97	9,036,418,706.33	14,544,303,777.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-296,896,403.05	-296,896,403.05
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)	-1,900,514,602.85	-2,944,610,525.31	-4,845,125,128.16
其中:1.基金申购款	970,357,672.47	1,408,317,963.92	2,378,675,636.39
2.基金赎回款	-2,870,872,275.32	-4,352,928,489.23	-7,223,800,764.55
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)	3,607,370,468.12	5,794,911,777.97	9,402,282,246.09
项目	上年度可比期间 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)	4,908,200,581.65	3,140,564,398.79	8,048,764,980.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,205,469,629.63	6,205,469,629.63
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)	599,684,489.32	902,619,775.88	1,502,304,265.20
其中:1.基金申购款	3,959,298,237.82	5,443,930,318.27	9,403,228,556.09
2.基金赎回款	-3,359,613,748.50	-4,541,310,542.39	-7,900,924,290.89
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)	-	-1,212,235,097.97	-1,212,235,097.97
五、期末所有者权益(基金净值)	5,507,885,070.97	9,036,418,706.33	14,544,303,777.30

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码从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:李勤,主管会计工作负责人:李炳旺,会计机构负责人:陈林

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华安宏利股票型证券投资基金(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[2006]第143号《关于同意华安宏利股票型证券投资基金募集的批复》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《华安宏利股票型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1,683,963,683.51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(2006)第112号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》于2006年9月6日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,684,224,358.17份基金份额,其中认购资金利息折合260,674.66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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》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。本基金股票投资比例范围为基金资产净值的60-95%,债券的投资比例为基金资产净值的5-40%,现金和到期日在一年以内的政府债券为基金资产净值的5%以上。本基金的业绩比较基准为:中信标普300指数收益率×90%+金融同业存款利率×10%。

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2011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》、《华安宏利股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的下述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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010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2010年12月31日的财务状况以及2010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》、[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	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

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

无。

7.4.8.1.2 权证交易

无。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

无。

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	171,893,876.89	180,217,871.52
其中:支付销售机构的客户维护费	14,250,084.46	14,297,209.64

1. 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1.5%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×1.5%/当年天数。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,648,979.58	30,036,311.91

1. 支付基金托管人中国建设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

无。

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

单位:份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	38,437,143.57	22,915,897.81
期间申购/买入总份额	-	15,521,245.76
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	38,437,143.57	38,437,143.57
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.07%	0.70%

注:基金管理人华安基金管理有限公司在2009年运用固有资金29,600,000.00元经代销机构申银万国证券股份有限公司购入本基金12,393,842.68份基金份额,申购费合计35,399.60元。其中每笔大于等于500万的申购,其申购费率为1000元;每笔小于100万的申购,其申购费率为0.6%。另通过红利再投获得本基金3,127,403.08份基金份额。

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

无。

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
中国建设银行	129,966,283.78	4,465,355.75	288,992,379.59	7,163,785.23

本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.9 期末(2010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

无。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

截至报告期末2010年12月31日止,本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至报告期末2010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。

§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	8,819,387,329.71	92.53
	其中:股票	8,819,387,329.71	92.53
2	固定收益投资	479,458,309.60	5.03
	其中:债券	479,458,309.60	5.03
	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:买断式逆回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	141,150,228.60	1.48
6	其他各项资产	91,299,722.15	0.96
7	合计	9,531,295,590.06	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	-	-
B	采掘业	495,797,643.84	5.27
C	制造业	4,171,824,514.83	44.37
C0	食品、饮料	1,124,668,527.76	11.96
C1	纺织、服装、皮毛	746,400.00	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	489,575,381.00	5.21
C5	电子	180,103,570.00	1.92
C6	金属、非金属	378,719,397.48	4.03
C7	机械、设备、仪表	1,528,566,554.79	16.26
C8