

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: 二〇一一年八月二十九日

1.1 重要提示  
基金管理人、基金托管人及基金销售机构在本报告期内不存在虚假记载、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责任。本半年度报告已经二分之一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2011年8月29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, 也不保证基金份额持有人的资产不受损失, 基金管理人不对因基金资产投资所产生的风险和亏损承担任何责任。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文, 投资者欲了解详细内容, 应阅读半年度报告正文。  
本报告中财务数据未经审计。  
本报告自2011年1月1日起至6月30日止。

2.1 基金基本情况	
基金简称	华安宝利配置混合
基金代码	040004
交易代码(前端)	040004(前端)
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	4,139,465,440.96份
基金合同存续期	不定期
2.2 基金产品说明	
投资目标	本基金通过精选存在于各相关证券市场以及不同金融工具之间的投资机会, 灵活运用资产配置策略, 对基金资产进行分散投资, 追求基金资产的长期增值, 提高资产的投资收益。
投资策略	基金管理人将通过对中国证券市场基本面和趋势的分析, 采用积极的投资策略, 力争实现基金资产的长期增值, 降低或避免非系统性风险, 提高资产的投资收益。
业绩比较基准	35%×天相转债指数收益率+30%×中证200指数收益率+30%×天相国债中价指数收益率+5%×金融债同业存款利率
风险收益特征	本基金面临与其资产配置策略相关的风险(例如市场风险、流动性风险、管理风险、技术风险等); 由于本基金在基金资产中有一定的债券持仓, 本基金在承担较高风险、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、资金管理人风险、技术风险、管理风险、信用评级风险等。
2.3 基金管理人、基金托管人	
名称	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
信息披露负责人	姓名 冯刚 联系电话 021-38669999 电子邮箱 fengjing@huahuan.com
客户服务电话	4008850099 021-68863414
基金半年度报告备置地点	http://www.huahuan.com 上海市浦东新区浦东南路360号新上海国际大厦38楼

3 主要财务指标和基金净值表现						
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	报告期末(2011年1月1日至2011年6月30日)					
本期已实现收益	272,139,004.04					
本期利润	55,963,045.70					
加权平均基金份额本期利润	0.0168					
本期基金份额净值增长率	2.08%					
3.1.2 上年度数据和指标	报告期末(2011年6月30日)					
期末可供分配基金份额利润	0.0907					
期末基金份额净值	4,813,715,574.12					
期末基金份额净值增长率	1.163					
注: 1、上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)计入费用在实际投资水平高于理财产品时所致。						
2、本期实现的收益扣除计提的基金托管费、基金销售服务费、基金管理人报酬和基金合同约定的其他费用后的余额, 本期利润为本期已实现的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(约等于期末未分配利润发生数)。						
3.2 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较						
3.2.1 基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较						
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
过去一个月	2.56%	0.83%	-0.27%	0.47%	2.83%	0.36%
过去三个月	0.26%	0.90%	-1.94%	0.43%	2.20%	0.47%
过去六个月	2.08%	1.09%	-1.48%	0.49%	3.56%	0.60%
过去一年	30.21%	1.19%	8.39%	0.58%	21.82%	0.61%
过去三年	47.52%	1.31%	7.25%	0.86%	40.27%	0.45%
自基金成立起至今	475.78%	1.28%	95.51%	0.90%	380.27%	0.38%
注: 1、本基金业绩比较基准为: 天相转债指数收益率×35%+中证200指数收益率×30%+天相国债中价指数收益率×30%+金融债同业存款利率×5%。						
2、根据本基金的有关规定, 本基金的投资范围是国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的其他金融工具。本基金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不超过10%, 最低比例为70%。债券中对应的可转债的投资比例不得超过基金资产净值的20%, 除可转债外的其它债券市值占基金资产净值的比例不超过30%, 最低比例为10%, 最高比例为65%; 除可转债外的其它债券市值占基金资产净值的比例不超过20%, 最低比例为10%, 最高比例为65%。						
3、2011年6月30日, 本基金所持有的可转债及其对应的基础股票市值占基金资产净值的比例为14.87%, 其中所对应的可转债的投资比例占资产净值的9.56%; 除可转债外的其它债券市值占基金资产净值的比例为21.72%; 除可转债外的其它债券市值占基金资产净值的比例为59.18%。上述各项投资比例符合基金合同约定。						
3.2.2 自基金成立以来的基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益变动的比较						
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 0004年8月24日至2011年6月30日						

4 管理人报告  
4.1 基金管理人及基金业绩情况  
4.1.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.1.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.2 基金管理人及其管理基金的情况  
4.2.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.2.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.3 公平交易制度的执行情况  
4.3.1 公平交易制度的执行情况  
4.3.2 公平交易制度的执行情况

4.4 基金管理人及其管理基金的情况  
4.4.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.4.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.5 基金管理人及其管理基金的情况  
4.5.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.5.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.6 基金管理人及其管理基金的情况  
4.6.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.6.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.7 基金管理人及其管理基金的情况  
4.7.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.7.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.8 基金管理人及其管理基金的情况  
4.8.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.8.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.9 基金管理人及其管理基金的情况  
4.9.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.9.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.10 基金管理人及其管理基金的情况  
4.10.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.10.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.11 基金管理人及其管理基金的情况  
4.11.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.11.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.12 基金管理人及其管理基金的情况  
4.12.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.12.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.13 基金管理人及其管理基金的情况  
4.13.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.13.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.14 基金管理人及其管理基金的情况  
4.14.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.14.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.15 基金管理人及其管理基金的情况  
4.15.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.15.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.16 基金管理人及其管理基金的情况  
4.16.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.16.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.17 基金管理人及其管理基金的情况  
4.17.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.17.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.18 基金管理人及其管理基金的情况  
4.18.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.18.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.19 基金管理人及其管理基金的情况  
4.19.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.19.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.20 基金管理人及其管理基金的情况  
4.20.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.20.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.21 基金管理人及其管理基金的情况  
4.21.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.21.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.22 基金管理人及其管理基金的情况  
4.22.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.22.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.23 基金管理人及其管理基金的情况  
4.23.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.23.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.24 基金管理人及其管理基金的情况  
4.24.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.24.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.25 基金管理人及其管理基金的情况  
4.25.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.25.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.26 基金管理人及其管理基金的情况  
4.26.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.26.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.27 基金管理人及其管理基金的情况  
4.27.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.27.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.28 基金管理人及其管理基金的情况  
4.28.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.28.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.29 基金管理人及其管理基金的情况  
4.29.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.29.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.30 基金管理人及其管理基金的情况  
4.30.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.30.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.31 基金管理人及其管理基金的情况  
4.31.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.31.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.32 基金管理人及其管理基金的情况  
4.32.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.32.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.33 基金管理人及其管理基金的情况  
4.33.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.33.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.34 基金管理人及其管理基金的情况  
4.34.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.34.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.35 基金管理人及其管理基金的情况  
4.35.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.35.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.36 基金管理人及其管理基金的情况  
4.36.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.36.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.37 基金管理人及其管理基金的情况  
4.37.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.37.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.38 基金管理人及其管理基金的情况  
4.38.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.38.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.39 基金管理人及其管理基金的情况  
4.39.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.39.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.40 基金管理人及其管理基金的情况  
4.40.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.40.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.41 基金管理人及其管理基金的情况  
4.41.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.41.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.42 基金管理人及其管理基金的情况  
4.42.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.42.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.43 基金管理人及其管理基金的情况  
4.43.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.43.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.44 基金管理人及其管理基金的情况  
4.44.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.44.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.45 基金管理人及其管理基金的情况  
4.45.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.45.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.46 基金管理人及其管理基金的情况  
4.46.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.46.2 基金管理人及其管理基金的情况

4.47 基金管理人及其管理基金的情况  
4.47.1 基金管理人及其管理基金的情况  
4.47.2 基金管理人及其管理基金的情况

# 华安宝利配置证券投资基金

## 2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

许之滨, 金融工程部经理, 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, 曾任研究发展战略部策略分析师, 现任华安中国大趋势指数证券投资基金基金经理, 负责华安上证龙头ETF和华安上证龙头ETF联接基金、金融工程部经理的工作, 现兼任华安上证龙头ETF和上证龙头ETF联接基金基金经理, 工商管理硕士, 高级会计师, CPA(中国注册会计师), 曾在安太会计师事务所工作, 2004年11月加入华安基金管理有限公司, 曾任财务核算部副经理、公司财务部总经理, 现任基金运营部总经理。

已签署过关联交易协议或其他重大关联交易的关系方发生变化的情况  
6.4.2 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.3 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.4 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.5 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.6 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.7 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.8 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.9 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.10 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.11 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.12 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.13 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.14 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.15 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.16 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.17 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.18 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.19 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.20 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.21 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.22 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.23 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.24 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.25 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.26 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.27 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.28 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.29 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.30 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.31 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.32 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.33 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.34 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.35 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.36 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.37 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.38 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.39 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.40 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.41 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.42 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.43 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.44 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.45 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.46 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.47 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.48 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.49 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.50 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.51 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.52 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.53 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.54 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.55 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.56 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.57 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.58 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.59 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.60 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.61 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.62 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.63 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.64 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.65 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.66 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.67 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.68 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.69 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.70 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.71 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.72 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.73 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.74 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.75 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.76 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.77 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.78 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.79 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.80 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.81 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.82 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.83 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.84 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.85 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.86 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.87 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.88 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.89 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.90 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.91 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.92 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.93 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.94 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.95 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.96 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.97 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.98 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.99 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.100 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.101 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.102 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.103 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.104 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.105 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.106 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.107 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.108 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.109 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.110 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

6.4.111 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方  
6.4.112 本报告期与基金发生关联交易的所有关联方

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占基金资产净值比例(%)
5	000041	深赛格	143,917,117.51	4.24
6	600968	德邦集团	142,218,644.69	4.19
7	000629	攀钢钒钛	141,080,436.54	4.15
8	000983	西山煤电	140,925,265.28	4.15
9	000022	万科A	131,601,125.63	3.88
10	000858	五粮液	109,835,292.21	3.23
11	600153	建发股份	99,313,589.63	2.92
12	600970	中材国际	96,646,123.73	2.85
13	601398	工商银行	91,936,269.75	2.71
14	600795	国电电力	84,740,336.30	2.50
15	601988	中国银行	83,620,000.00	2.49
16	000709	河北钢铁	84,374,435.36	2.46
17	600362	江西铜业	81,502,609.33	2.40
18	600036	招商银行	70,248,612.75	2.07
19	600083	金鹰重工	63,680,100.33	1.87
20	600019	宝钢股份	59,830,628.78	1.76

注: 1、买入金额指买入成交金额, 成交佣金以成交数量 减除, 不考虑相关交易费用。  
2、卖出金额指卖出成交金额, 成交佣金以成交数量 减除, 不考虑相关交易费用。

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占基金资产净值比例(%)
1	000068	燕京啤酒	301,732,605.03	8.89
2	600636	三爱富	198,538,956.86	5.85
3	601601	中国石化	148,745,262.42	4.38
4	000858	五粮液	140,732,038.52	4.14
5	600160	华鲁恒升	125,084,931.97	3.64
6	600950	烟台冰心	106,190,454.52	3.12
7	601398	工商银行	96,	