华安宝利配置证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30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
报告送出日期:二〇一二年八月二十七日

§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。本半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8月22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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30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	4,395,410,433.38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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金半年度报告备置地点	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（2012年1月1日至2012年6月30日）
本期已实现收益	-286,929,674.91
本期利润	173,968,340.34
加权平均基金份额本期利润	0.0381
本期基金份额净值增长率	3.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2012年6月30日）
期末可供分配基金份额利润	-0.0108
期末基金资产净值	4,408,531,367.14
期末基金份额净值	1.003

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
过去一个月	-2.34%	0.69%	-2.41%	0.40%	0.07%	0.29%
过去三个月	1.83%	0.73%	1.17%	0.43%	0.66%	0.30%
过去六个月	3.72%	0.91%	3.16%	0.52%	0.56%	0.39%
过去一年	-13.76%	0.92%	-7.30%	0.57%	-6.46%	0.35%
过去三年	10.28%	1.16%	-11.09%	0.74%	21.37%	0.42%
过去五年	22.78%	1.29%	-12.94%	0.92%	35.72%	0.37%
自基金合同生效起至今	396.57%	1.24%	76.11%	0.87%	320.46%	0.37%

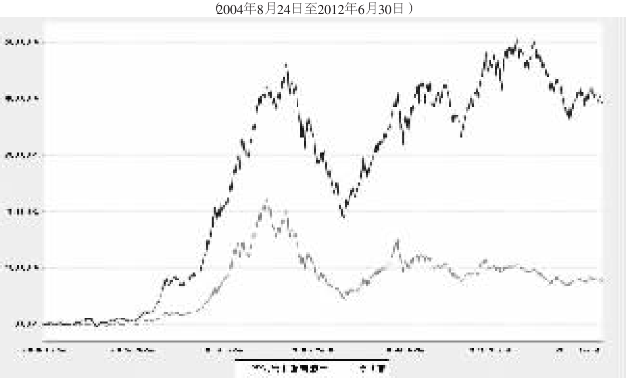
注:本基金的业绩比较基准为:天相转债指数收益率×35%+天相280 指数收益率×30%+天相国债全价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

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2012年6月30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14.54%,其中所对应的基础股票的投资比例为资产净值的8.68%;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24.96%;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45.71%。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2012年6月30日）



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2012年6月30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180ETF、华安上证180ETF联接、华安上证龙头企业ETF、龙头ETF联接、华安升级主题股票、华安稳固收益债券、华安可转换债基金、华安深证300指数基金（LOF）、华安科技动力股票、华安四季红债券、华安香港精选股票、华安大中华升级股票、华安标普石油指数基金（QDII-LOF）、华安月月鑫短期理财债券、华安季季鑫短期理财债券、华安双月鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级等29只开放式基金,管理资产规模达到854.82亿人民币。

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		
陆从珍	本基金的基金经理	2010-04-21	-	11	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。
康平	本基金的基金经理	2012-05-30	-	15	上海财经大学证券期货专业硕士,15年证券、基金行业从业经历,曾在大连环宇通信设备公司、上海瑞恒投资有限公司、平安证券有限责任公司研究所、天同证券有限责任公司研究所、光大证券有限责任公司研究所工作。2005年1月加入华安基金管理有限公司,先后在研究发展部、基金投资部任高级研究员、基金经理助理职务。2012年5月起同时担任本基金及华安中小盘成长股票型证券投资基金的基金经理。

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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》,将封闭式基金、开放式基金、特定客户资产管理组合及其他投资组合资产在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括:在研究环节,研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中,使用晨会发言、发送邮件、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节,公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略,制定并严格执行交易决策规则,以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节,公司实行强制公平交易机制,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务,遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则,实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。（2）交易所一级市场业务,投资组合经理按意愿独立进行业务申报,集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签,则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则,先到先询价的控制原则。通过内部共同的MSN群,发布询价需求和结果,做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标,则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向,交易员以此进行投标,以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配,且以公司名义获得,则投资部门在合规监察员监督参与下,进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节,公司合规监察稽核部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控;风险管理部根据市场公认的第三方信息（如:中债登的债券估值）,定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查,对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司合规监察稽核部会同基金投资、交易部门讨论制定了公募基金、专户针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则,并在投资系统中进行了设置,实现了完全的系统控制。同时加强了对基金、专户间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查;风险管理部开发了同向交易分析系统,对相关同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。本报告期内,除指数基金以外的所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况共出现了2次。原因:各投资组合分别按照其交易策略交易时,虽相关投资组合买卖数量极少,但由于个股流动性较差,交易量稀少,致使成交较少的单边交易量仍然超过该证券当日成交量的5%。而从同向交易统计检验和实际检查的结果来看,也未发现有异常。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

在对政府可能改变2010年以来的调控基调、经济即将触底回升的期待中,2012年一季度A股市场经历了一段反弹行情。但随后的经济数据显示,中国经济调整的时间和企业盈利下降的幅度远远超出了市场的普遍预期。在欧洲,尽管希腊大选的结果和随后欧盟峰会就ESM达成协议曾一度让市场认为危机将暂告一段落,但欧洲成员国之间巨大的分歧使得欧债危机的实际解决仍然遥遥无期,内忧外患下,A股市场在短暂的上涨之后一路下行,上证指数离年初低位仅一步之遥。

宝利在2011年底判断投资者将对政策刺激有所预期,但认为经济基本面将持续疲弱,因此认为市场会存在一定的回升空间,但上涨的主题不是与经济基本面高度相关的周期性行业,而更可能是跟市场涨跌关系更大的券商、保险等行业,因此加仓了该两个行业,从而在一季度的上涨行情中获得较好的收益。但在二季度,低配地产、医药、高配汽车、标配银行,过早减持券商股的操作使得基金未能在二季度的行情中继续胜出。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年6月30日,本基金份额净值为1.003元,本报告期份额净值增长率为3.72%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内上半年的经济政策取向似乎意味着,尽管面对经济增长的压力,管理层仍将较多的注意力集中在经济转型、提高增长质量上,我们认为从中长期看,这无疑是非常正确的选择。经过过去十多年重工业化时代的高速发展,中国的诸多行业都面临产能过剩、效率低下的问题,对环境和资源的过度使用也抑制了我国粗放式发展的空间,在当前时点,转型是必须的、自然的选择,而过去一段时间的政策显示了政府在这一方面的决心,使得我们对市场的中长期走势有了信心。我们认为,虽然未来很长一段时间投资仍将在中国经济增长中扮演最重要的角色,但消费的比重将逐步提升,政府也将更关心社会福利和公平问题,由此可带来许多行业的投资机会。宝利在二季度大幅度降低了仓位,这有利于我们更加从容地在下半年寻找投资机会。

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、基金投资部总监、研究发展部总监、固定收益部总监、指数投资部总监、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。

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,固定收益部总监,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,指数投资部总监,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

本报告期不进行收益分配。

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

2012年上半年度,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

2012年上半年度,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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2012年上半年度,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半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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:2012年6月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资产:		
银行存款	61,832,510.69	97,446,902.13
结算备付金	230,368,640.58	328,988,578.43
存出保证金	1,004,923.67	1,754,020.70
交易性金融资产	3,756,631,065.45	3,997,676,207.35
其中:股票投资	2,398,025,210.47	3,161,730,428.15
基金投资	-	-
债券投资	1,358,605,854.98	835,945,779.20
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	527,001,273.50	-
应收证券清算款	2,434,784.05	8,688,809.40
应收利息	23,919,148.66	11,473,101.12
应收股利	361,121.29	-
应收申购款	2,639,135.81	2,210,246.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,606,192,603.70	4,448,237,866.03
负债和所有者权益	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011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	182,851,071.43	27,469,782.94
应付赎回款	3,826,757.91	29,371,283.02
应付管理人报酬	4,368,112.36	4,523,881.13
应付托管费	910,023.43	942,475.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,757,306.21	2,402,232.44
应交税费	2,245,043.90	1,916,967.04
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	702,921.32	990,724.70
负债合计	197,661,236.56	67,617,346.49
所有者权益:		
实收基金	4,395,410,433.38	4,530,296,380.93
未分配利润	13,120,933.76	-149,675,861.39
所有者权益合计	4,408,531,367.14	4,380,620,519.54
负债和所有者权益总计	4,606,192,603.70	4,448,237,866.03

注:报告截止日2012 年6 月30日,基金份额净值1.003元,基金份额总额4,395,410,433.38份

6.2 利润表

会计主体:华安宝利配置证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入	216,610,006.17	96,648,067.37
1.利息收入	21,951,599.34	14,464,018.00
其中:存款利息收入	3,253,928.08	2,650,477.57
债券利息收入	16,392,357.93	11,357,082.06
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,305,313.33	456,458.37
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	-266,970,663.22	297,820,237.30
其中:股票投资收益	-288,437,573.87	281,127,793.73
基金投资收益	-	-
债券投资收益	696,238.62	1,476,206.85
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	20,770,672.03	15,216,236.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	460,898,015.25	-216,175,958.34
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	731,054.80	539,770.41
减:二、费用	42,641,665.83	40,685,021.67
1.管理人报酬	27,450,148.38	23,020,210.04
2.托管费	5,718,780.90	4,795,877.14
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	8,907,119.14	12,282,051.08
5.利息支出	357,653.05	383,960.40
其中:卖出回购金融资产支出	357,653.05	383,960.40
6.其他费用	207,964.36	202,923.01
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	173,968,340.34	55,963,045.70
减:所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	173,968,340.34	55,963,045.70

6.3 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:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30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）	4,530,296,380.93	-149,675,861.39	4,380,620,519.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	173,968,340.34	173,968,340.34
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）	-134,885,947.55	-11,171,545.19	-146,057,492.74
其中:1.基金申购款	573,425,043.77	1,712,161.17	575,137,204.94
2.基金赎回款	-708,310,991.32	-12,883,706.36	-721,194,697.68
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）	4,395,410,433.38	13,120,933.76	4,408,531,367.14
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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）	-	55,963,045.70	55,963,045.70
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）	1,274,214,391.05	216,437,386.66	1,490,651,777.71
其中:1.基金申购款	1,799,989,903.40	308,968,723.59	2,108,958,626.99
2.基金赎回款	-525,775,512.35	-92,531,336.93	-618,306,849.28
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）	4,139,465,440.96	674,250,133.16	4,813,715,574.12

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4,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

6.4 报表附注

6.4.1 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8月24日批准报出。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2012 年上半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2012 年6 月30日的财务状况以及2012 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4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。

6.4.5差错更正的说明

本会计期间不存在差错更正。

6.4.6 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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1股票交易

无。

6.4.8.1.2权证交易

无。

6.4.8.1.3应支付关联方的佣金

无。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	27,450,148.38	23,020,210.04
其中:支付销售机构的客户维护费	4,515,503.08	4,098,406.26

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,718,780.90	4,795,877.14

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。

6.4.8.3 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 2012年1月1日至2012年6月30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	130,942,925.07	-	-	-	-	-
	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
期初持有的基金份额	131,701,235.52	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	131,701,235.52	-
期末持有的基金份额	-	131,701,235.52
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	3.18%

注:上年度可比期间增加的份额为红利转再投资。

6.4.8.4.2 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。

6.4.8.5 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 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30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	61,832,510.69	567,927.47	65,554,378.51	421,001.61

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,按银行同业利率计息。于2012年6 月30 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（2011 年6 月30 日:同）。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末（2012年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

.7 投资组合报告

7.1 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	2,398,025,210.47	52.06
	其中:股票	2,398,025,210.47	52.06
2	固定收益投资	1,358,605,854.98	29.50
	其中:债券	1,358,605,854.98	29.50
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	527,001,273.50	11.44
	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	292,201,151.27	6.34
6	其他各项资产	30,359,113.48	0.66
7	合计	4,606,192,603.70	100.00

7.2 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	74,652,399.36	1.69
C	制造业	1,118,796,610.67	25.38
C0	食品、饮料	411,439,682.84	9.33
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	52,500,000.00	1.19
C4	石油、化学、塑胶、塑料	103,674,646.00	2.35
C5	电子	46,744,554.00	1.06
C6	金属、非金属	6,580,000.00	0.15
C7	机械、设备、仪表	403,359,227.83	9.15
C8	医药、生物制品	94,498,500.00	2.14
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	159,425,641.22	3.62
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	67,004,800.00	1.52
H	批发和零售贸易	170,191,412.30	3.86
I	金融、保险业	588,865,400.00	13.36
J	房地产业	219,088,946.92	4.97
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,398,025,210.47	54.40

7.3 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	000858	五粮液	7,301,409	239,194,158.84	5.43
2	600104	上汽集团	15,377,903	219,750,233.87	4.98
3	601601	中国太保	7,000,000	155,260,000.00	3.52
4	600153	建发股份	16,800,000	120,288,000.00	2.73
5	000002	万科A	12,000,000	106,920,000.00	2.43
6	600887	伊利股份	4,100,000	84,378,000.00	1.91
7	601318	中国平安	1,800,000	82,332,000.00	1.87
8	600518	康美药业	5,300,000	81,726,000.00	1.85
9	601166	兴业银行	6,000,000	77,880,000.00	1.77
10	600765	中航重机	9,000,000	69,390,000.00	1.57

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 网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	000002	万科A	153,394,479.38	3.50
2	601318	中国平安	138,149,947.77	3.15
3	600104	上汽集团	135,931,631.15	3.10
4	600585	海螺水泥	99,503,824.23	2.27
5	600887	伊利股份	88,488,929.04	2.02
6	601628	中国人寿	81,850,787.49	1.87
7	600837	海通证券	75,444,258.37	1.72
8	600030	中信证券	73,088,414.00	1.67
9	600383	金地集团	64,783,921.89	1.48
10	600016	民生银行	60,030,000.00	1.37
11	600546	山煤国际	60,013,523.30	1.37
12	600795	国电电力	54,765,000.00	1.25
13	601998	中信银行	47,936,236.44	1.09
14	601601	中国太保	47,163,486.83	1.08
15	000522	白云山A	43,844,906.60	1.00
16	600636	三爱富	42,948,168.02	0.98
17	002450	康得新	38,089,991.27	0.87
18	000937	冀中能源	32,109,954.99	0.73
19	600362	江西铜业	31,941,245.10	0.73
20	600160	巨化股份	31,831,292.98	0.73

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。

7.4.2 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	200,440,880.91	4.58
2	000629	攀钢钒钛	114,111,986.44	2.60
3	601601	中国太保	113,198,849.92	2.58
4	600585	海螺水泥	98,444,750.89	2.25
5	000001	深发展A	98,196,238.67	2.24
6	601318	中国平安	97,344,650.67	2.22
7	601166	兴业银行	95,582,115.37	2.18
8	600970	中材国际	90,278,417.33	2.06
9	600000	浦发银行	84,309,173.84	1.92
10	600875	东方电气	78,449,043.37	1.79
11	002161	远望谷	67,706,925.99	1.55
12	601988	中国银行	67,176,735.44	1.53
13	000002	万科A	60,173,048.21	1.37
14	600016	民生银行	58,568,716.14	1.34
15	002073	软控股份	56,622,500.58	1.29
16	000778	新兴铸管	56,082,383.66	1.28
17	600426	华鲁恒升	52,667,426.29	1.20
18	600704	物产中大	51,534,819.17	1.18
19	600160	巨化股份	51,055,614.51	1.17
20	600068	葛洲坝	49,930,281.30	1.14

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,302,217,837.25
卖出股票的收入（成交）总额	3,221,970,192.85

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。

7.5 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	100,040,000.00	2.27
2	央行票据	505,320,000.00	11.46
3	金融债券	261,171,000.00	5.92
	其中:政策性金融债	261,171,000.00	5.92
4	企业债券	240,065,864.60	5.45
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	252,008,990.38	5.72
8	其他	-	-
9	合计	1,358,605,854.98	30.82

7.6 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	1101094	11央票94	2,000,000	193,920,000.00	4.40
2	120305	12进出05	1,000,000	100,450,000.00	2.28
3	110018	11附息国债18	1,000,000	100,040,000.00	2.27
4	1101098	11央票98	1,000,000	96,990,000.00	2.20
5	1101096	11央票96	1,000,000	96,980,000.00	2.20

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1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,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。

7.9.2 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。

7.9.3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	1,004,923.67
2	应收证券清算款	2,434,784.05
3	应收股利	361,121.29
4	应收利息	23,919,148.66
5	应收申购款	2,639,135.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,359,113.48

7.9.4 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	113002	工行转债	64,680,115.50	1.47
2	113001	中行转债	63,128,000.00	1.43
3	110015	石化转债	44,959,500.00	1.02
4	125709	唐钢转债	27,288,355.49	0.62
5	110013	国投转债	17,662,125.60	0.40
6	110017	中海转债	6,319,589.90	0.14
7	110007	博汇转债	5,052,000.00	0.11
8	125887	中鼎转债	2,255,285.89	0.05
9	110012	海运转债	1,483,650.00	0.03

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
280,089	15,692.91	1,058,207,082.53	24.08%	3,337,203,350.85	75.92%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	889,852.40	0.02%

注:本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为0;

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0至10万份。

9 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	4,530,296,380.93
本报告期基金总申购份额	573,425,043.77
减:本报告期基金总赎回份额	708,310,991.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,395,410,433.38

10 重大事件揭示

10.1基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2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）.2012年2月3日,基金行业高级管理人员变更公告,尚志民先生任华安基金管理有限公司副总经理。尚志民先生经中国证监会核准取得高管任职资格。

（2）.2012年5月30日,华安宝利配置证券投资基金基金经理变更公告,增聘康平先生担任本基金的基金经理。

2、本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下:

基金托管人交通银行于2012年5月28日公布了《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》,交通银行资产托管部原总经理谷娜莎同志不再担任资产托管部总经理职务。资产托管部总经理职务由刘树军同志担任。具体内容请参阅在2012年5月30日《上海证券报》上发布的《交通银行股份有限公司关于资产托管部总经理变更的公告》。

10.3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。

10.4基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

10.5报告期内改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所。

10.6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、托管人的托管业务部门及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1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	
兴业证券股份有限公司	1	2,385,433,161.80	43.35%	2,049,860.48	44.09%	-
海通证券股份有限公司	1	1,283,170,318.31	23.32%	1,054,630.19	22.68%	-
红塔证券股份有限公司	1	458,749,776.75	8.34%	389,935.90	8.39%	-
中信证券股份有限公司	1	389,593,524.82	7.08%	331,152.37	7.12%	-
中信建投证券股份有限公司	1	393,865,496.37	7.16%	320,017.62	6.88%	-
渤海证券有限责任公司	1	318,040,033.00	5.78%	270,335.40	5.81%	-
东莞证券有限责任公司	1	191,535,218.17	3.48%	162,803.73	3.50%	-
长城证券有限责任公司	1	58,178,147.77	1.06%	50,789.30	1.09%	-
申银万国证券股份有限公司	1	23,589,953.11	0.43%	20,051.23	0.43%	-
中银国际证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-

注:1、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。

2、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

由相关部门牵头并组织有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》

牵头部门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相关部门提交的《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《证券交易单元租用协议》,并通知基金托管人。

3、本报告期内,本基金无交易单元变更。

10.7.2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	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券股份有限公司	43,142,484.40	46.32%	300,000,000.00	100.00%	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
红塔证券股份有限公司	11,017.20	0.01%	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投证券股份有限公司	49,984,660.80	53.67%	-	-	-	-
渤海证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
长城证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
申银万国证券股份有限公司	1,007.30	0.00%	-	-	-	-
中银国际证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

华安基金管理有限公司
二〇一二年八月二十七日