华安宝利配置证券投资基金

2012 年度 报告摘要

2012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
报告送出日期:二〇一三年三月二十七日

§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2013年3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2012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	4,444,444,237.27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%×天相国债金价指数收益率+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	裴学敏	裴学敏
	联系电话	021-32169999	021-32169999
	电子邮箱	zh_jjb@fbankcomm.com	zh_jjb@fbankcomm.com
客户服务电话		4008850099	95559
传真		021-68863414	021-62701262

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9号上海国金中心二期31层、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	2012年	2011年	2010年
本期已实现收益	-422,924,921.35	95,010,097.80	285,782,104.55
本期利润	186,548,408.18	-809,763,133.41	257,563,703.27
加权平均基金份额本期利润	0.0412	-0.2079	0.0669
本期基金份额净值增长率	4.03%	-15.12%	7.53%
3.1.2 期末数据和指标	2012年末	2011年末	2010年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0411	-0.0330	0.0482
期末基金资产净值	4,470,801,940.01	4,380,620,519.54	3,395,966,210.58
期末基金份额净值	1.006	0.967	1.185

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	2.97%	0.85%	4.92%	0.49%	-1.95%	0.36%
过去六个月	0.30%	0.75%	1.63%	0.46%	-1.33%	0.29%
过去一年	4.03%	0.83%	4.85%	0.49%	-0.82%	0.34%
过去三年	-5.05%	1.02%	-12.97%	0.58%	7.92%	0.44%
过去五年	-5.73%	1.25%	-22.48%	0.85%	16.75%	0.40%
自基金合同生效起至今	398.06%	1.21%	79.19%	0.85%	318.87%	0.36%

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%+天相国债金价指数收益率×30%+金融同业存款利率×5%。

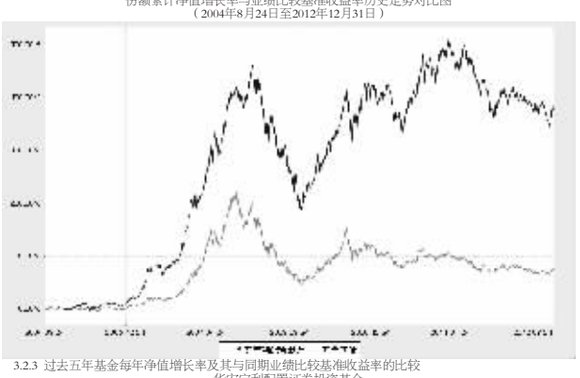
根据本基金合同的有关规定,本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。本基金所持有的可转换债券及其对应的基础股票市值占基金资产净值的目标比例为45%,最低比例为10%,最高比例为70%(其中所对应的基础股票的投资比例不超过基金资产净值的20%);除可转换债券外的其它债券市值占基金资产净值的目标比例为30%,最低比例为10%,最高比例为65%;除可转换债券所对应基础股票外的其它股票市值占基金资产净值的目标比例为20%,最低比例为10%,最高比例为65%。

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

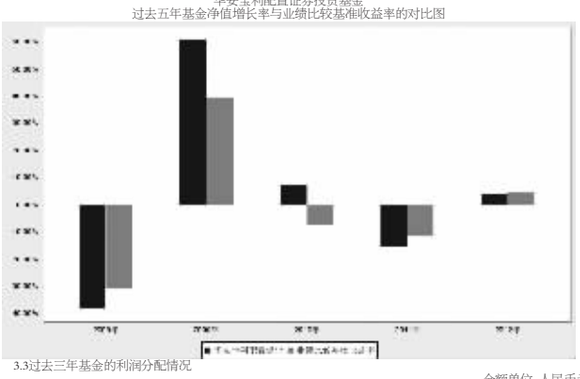
(2004年8月24日至2012年12月31日)



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

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



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
2012年	-	-	-	-	-
2011年	0.450	65,131,229.16	63,734,230.71	128,865,459.87	-
2010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2012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、华安七日鑫短期理财债券、华安沪深300指数分级、华安逆向策略、华安日日鑫货币、华安安心收益债券、华安信用增强债券等34只开放式基金。管理资产规模达到 955.90亿元人民币。

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	-	12年	经济学硕士,12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。2012年8月起同时担任华安逆向策略股票型证券投资基金的基金经理。
康平	本基金的基金经理	2012-05-30	-	15年	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公平交易制度和控制方法

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,使用最会发言、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,超过授权范围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,完判先询价的控制原则。通过内部共同的iwind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。

4.3.2公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.3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,虽相关投资组合占买卖数量极少,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的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2012年初,市场曾经憧憬政府将改变2010年以来的调控基调,国内经济即将触底回升,因此上半年的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均远远超出了市场普遍预期,市场重回跌势,沪深指数均创下09年调整以来的新低。年底,随着18大的召开,以及新一届管理层的各项新举措的推出,市场迎来反弹,以银行为代表的大盘蓝筹股带领市场快速上升,最终上证综指与深圳成指均以红线报收,扭转了年K线连续收跌的趋势。

宝利在2011年底提升了仓位,加仓了保险、券商等行业,从而在一季度的上涨行情中获得较好的收益。在二季度,基于对经济形势比较悲观的预期,基金降低了仓位,并一直维持到9月份,在9月,我们预期经济即将见底回升,因此,适度提升了仓位,增加了对周期股的配置,我们原拟于年底前进一步提升仓位,但市场的反弹提前于我们的判断,在银行股快速拉升之后,本基金没有追涨,导致最后一个月,基金没能跟上市场的涨幅。

审视我们2012年的行业与个股配置,我们在一季度因为高配金融行业而获得良好的收益,但随后并没有很好地锁定,反而在下跌之后进行减仓,导致年底错过金融股行情。在2012年,基金最大的遗憾莫过于一直看好医药股的前景,但却因为不愿追涨,同时对医药股的相对高估值有所犹疑而没有对医药股进行超配。在2012年的另一强势板块地产上,宝利的收益也一般。反思重仓个股,我们在白酒上的选择也对基金净值做了负面贡献。尽管最终宝利全年收益超过上证综指和深成指,但这个结果依然不能令人满意。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日,本基金份额净值为1.006元,本报告期份额净值增长率为4.03%。

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4季度,新一届政府上任,将新型城镇化作为未来一段时期中国经济增长的主要动力,A股市场给予其高度的热情和期待,以铁路、水泥为代表的基建股大幅上涨,同时,因为对中国经济信心增加,以银行为代表的低估值板块表现更为突出,市场一改2季度以来的颓废走势,呈现强势上涨行情。

过去很长一段时间以来,我们一直认为市场真正走好的决定因素是中国经济转型的成功,但鉴于经济转型的长期性,投资在很长时间内也仍将是中国经济增长的主要推动力,新型城镇化的提出明确了未来转型的长期性。在这个过程中,周期性行业将视产能与需求的配置情况展示盈利的波段性,但鉴于目前国内较大的产能,波动将较之前减弱,其适合投资的时间长度也将下降,而与民生相关行业的长期价值将更加显著。

目前市场对中国未来的经济增长前景争议颇多,悲观者认为GDP增长率将在一两年内下降到5~6%的低水平,而乐观者依然看好长期潜在增长率在8%以上。我们对国内经济给予比较乐观的看法,但不能否认,目前我们面临诸多约束,包括资源、环境等等,而在前几年大放流动性之后,我们将警惕经济增速一旦上升带来的通胀压力及由此带来的紧缩预期。在2013年,美国何时退出QE也将是左右资本市场的一个重大课题,因此,对于2013年的市场,我们转2012年乐观,但将时刻注意风险。

此外,我们认为2013年的市场仍然充满结构性机会,关系民生的行业以及军工、环保等主题板块可能持续提供投资机会,在未来的投资中,我们将重点关注能够持续增长的行业和公司,在合理的估值下增加对其配置,对于周期性行业,则根据产能利用率情况进行波段操作。

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,首席投资官、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。

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

无。

§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年度,基金托管人在华安宝利配置的托管过程中,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

2012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

2012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、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、庄贤签字出具了普华永道中天审字(2013)第21442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:华安宝利配置证券投资基金

报告截止日:2012年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2012年12月31日	上年度末 2011年12月31日
资 产:		
银行存款	161,557,230.52	97,446,902.13
结算备付金	181,710,261.33	328,988,578.43
存出保证金	710,027.51	1,754,020.70
交易性金融资产	3,836,622,710.53	3,997,676,207.35
其中:股票投资	2,803,734,890.22	3,161,730,428.15
基金投资	-	-
债券投资	1,032,887,820.31	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	580,500,230.00	-
应收证券清算款	-	8,688,809.40
应收利息	20,148,304.28	11,473,101.12
应收股利	-	-
应收申购款	2,388,558.19	2,210,246.90
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,783,637,322.36	4,448,237,866.03
负债和所有者权益	本期末 2012年12月31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	296,995,223.07	27,469,782.94
应付赎回款	4,572,752.64	29,371,283.02
应付管理人报酬	4,308,232.80	4,523,881.13
应付托管费	897,548.53	942,475.22
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,141,191.53	2,402,232.44
应交税费	3,020,291.32	1,916,967.04
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	900,142.46	990,724.70
负债合计	312,835,382.35	67,617,346.49
所有者权益:		
实收基金	4,444,444,237.27	4,530,296,380.93
未分配利润	26,357,702.74	-149,675,861.39
所有者权益合计	4,470,801,940.01	4,380,620,519.54
负债和所有者权益总计	4,783,637,322.36	4,448,237,866.03

注:报告截止日2012年12月31日,基金份额净值1.006元,基金份额总额4,444,444,237.27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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
一、收入	269,137,118.49	-725,623,005.65
1.利息收入	47,196,783.83	36,749,386.44
其中:存款利息收入	5,578,940.75	6,485,638.83
债券利息收入	36,964,541.19	28,255,307.30
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	4,653,301.89	2,008,440.31
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-388,547,206.59	141,090,432.37
其中:股票投资收益	-421,057,912.48	115,313,507.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-408,402.25	2,666,784.83
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	32,919,108.14	23,110,140.30
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	609,473,329.53	-904,773,231.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,014,211.72	1,310,406.75
减:二、费用	82,588,710.31	84,140,127.76
1.管理人报酬	53,695,620.41	51,902,698.32
2.托管费	11,186,587.65	10,813,062.08
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	16,887,057.68	20,589,048.99
5.利息支出	399,804.93	422,358.95
其中:卖出回购金融资产支出	399,804.93	422,358.95
6.其他费用	419,639.64	412,959.42
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	186,548,408.18	-809,763,133.41
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	186,548,408.18	-809,763,133.41

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:2012年1月1日至2012年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012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)	4,530,296,380.93	-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)	-	186,548,408.18	186,548,408.18
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)	-85,852,143.66	-10,514,844.05	-96,366,987.71
其中:1.基金申购款	993,619,162.16	-7,488,013.62	986,131,148.54
2.基金赎回款	-1,079,471,305.82	-3,026,830.43	-1,082,498,136.25
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)	4,444,444,237.27	26,357,702.74	4,470,801,940.01
	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日		
项目	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

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:李勤,主管会计工作负责人:章国富,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%。

根据《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>》、中国证券投资基金业协会颁布的《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。

7.4.3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12月31日的财务状况以及2012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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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[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) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(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支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。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。

(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

本基金本报告期和上年度可比期间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

本基金本报告期和上年度可比期间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

本基金本报告期和上年度可比期间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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	53,695,620.41	51,902,698.32
其中:支付销售机构的客户维护费	8,891,295.01	8,769,459.61

注:支付基金管理人华安基金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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,186,587.65	10,813,062.08

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 2012年1月1日至2012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	264,268,905.31	-	-	-	-	-
上年度可比期间 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	360,374,740.09	-	-	-	-	-

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 2012年1月1日至2012年12月31日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年12月31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