
华宝兴业收益增长混合型证券投资基金
2009 年年度报告（摘要）
2009 年 12 月 31 日

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年三月二十九日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	华宝兴业收益增长混合
基金主代码	240008
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年6月15日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
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	2,575,297,714.74份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司，以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略，通过公司自行开发的数量化辅助模型，结合宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。股票投资部分采用定量与定性分析相结合，行业配置与定期调整策略；债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

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	华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、021-38924558	yindong.zh@ccb.cn
传真	021-38505777	010—66275853

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.fsfund.com
基金年度报告备置地点	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§ 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	2009 年	2008 年	2007 年
本期已实现收益	939,456,312.07	-3,224,018,034.82	3,036,317,143.88
本期利润	3,759,356,691.30	-5,677,105,220.75	3,154,033,923.44
加权平均基金份额本期利润	1.6732	-2.2269	2.0107
本期基金份额净值增长率	91.39%	-53.69%	167.63%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年末	2007 年末
期末可供分配基金份额利润	1.4721	0.8117	2.3467
期末基金资产净值	8,929,487,751.71	4,100,117,876.83	8,584,346,971.03
期末基金份额净值	3.4674	1.8117	3.9119

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，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。

4、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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	22.91%	1.50%	14.76%	1.11%	8.15%	0.39%
过去六个月	20.43%	1.82%	13.64%	1.48%	6.79%	0.34%
过去一年	91.39%	1.70%	56.59%	1.40%	34.80%	0.30%
过去三年	137.22%	2.16%	47.87%	1.78%	89.35%	0.38%
自基金成立起至今	246.74%	2.01%	105.21%	1.67%	141.53%	0.34%

注：1、本基金比较基准为：65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

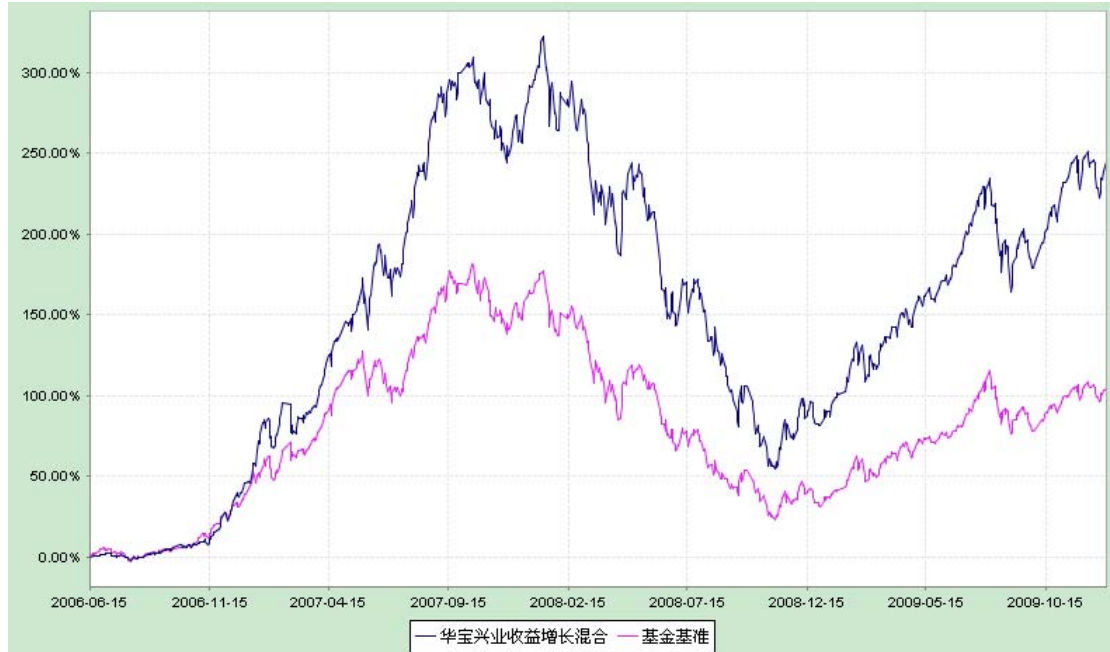
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率

变动的比较

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

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6月15日至2009年12月31日)

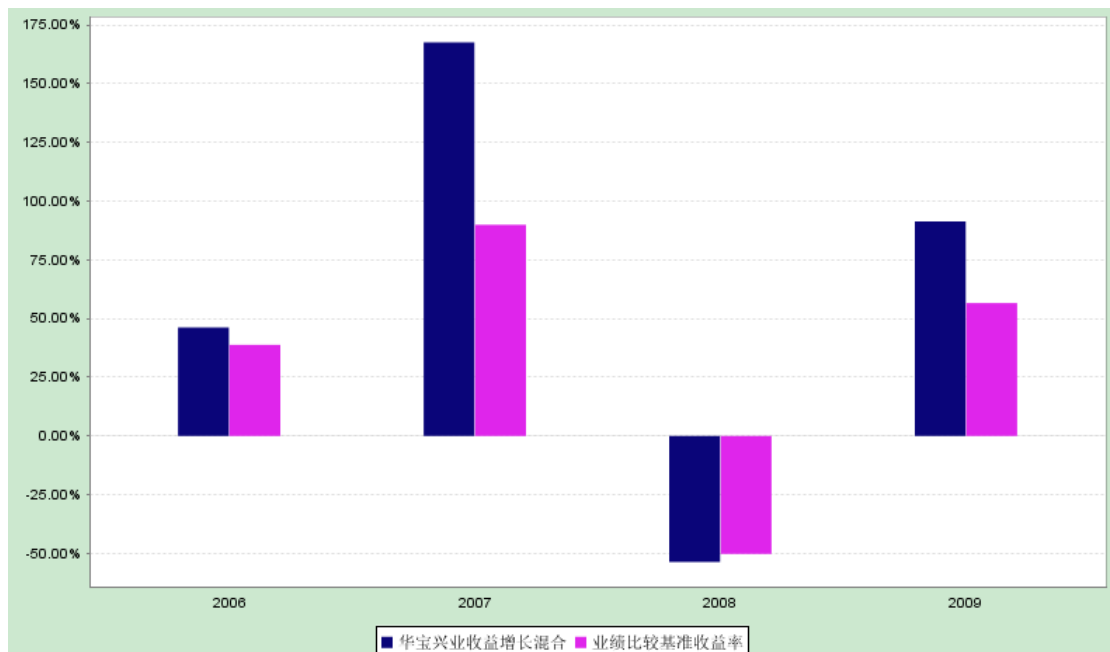


注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2006年12月15日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年本基金未进行过利润分配。

§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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2009 年 12 月 31 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金以及中证 100 基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 61,954,458,087.07 元。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
冯刚	国内投资部总经理、本基金基金经理兼任大盘精选基金基金经理	2006-06-15	-	9 年	硕士，曾在联合证券有限公司、华安基金管理公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004 年 3 月加入本公司，任高级研究员、多策略增长基金基金经理助理。2006 年 6 月至今任收益增长基金基金经理，2008 年 10 月至今兼任大盘精选基金基金经理。
邵喆阳	本基金基金经理助理兼任大盘精选基金基金经理助理	2008-05-14	-	3 年	硕士，拥有 CFA 资格。2005 年 7 月至 2006 年 12 月任安永会计师事务所审计员。2006 年 12 月加入本公司任分析师，2008 年 5 月起任收益增长基金基金经理助理，2008 年 10 月起兼任大盘精选基金基金经理助理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《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，本基金管理人遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资

基金法》及其各项实施细则、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制，确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内，基金管理人严格实施公平交易制度；加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析；分析结果没有发现交易价异常。

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

本报告期内，基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

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

操作上，本基金在 2009 年度始终坚持在经济复苏中寻找机会，在政府扩大内需调整经济结构中寻找投资标的，取得了很好的投资业绩。

2009 年 A 股市场虽然指数不断上涨，但行业轮到较之前几年明显加快，行业和个股在特定时间段内分化严重，对基金管理提出了更高的要求。09 年上半年，本基金重点投资了国家 4 万亿经济刺激计划受益的相关行业个股，建材，煤炭，金融，地产等行业投资占比较多。进入下半年后，我们判断经济全面复苏后，政府前期刺激计划有逐步退出的可能，同时政府更多的政策会作用在扩大内需，调整经济结构，平衡区域发展等方面，所以下半年后本基金围绕上述几个主题进行重点布局，在家电，医药，食品饮料，区域地产，TMT 等板块加大了投资比例，使得本基金在全年看业绩保持持续领先。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2009 年度本基金净值增长率 91.39%，基金业绩比较基准为 56.59%，2009 年本基金净值收益率领先业绩基准 34.80%。

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 10 年，我们认为影响股指走势的因素呈现多元化，有利与不利的因素兼而有之。

我们对市场的总体判断是：市场将维持震荡格局，但其中不乏机会，个股选择的重要性会进一步得到体现。从风格上看，09 年四季度中小市值股票相对于大市值个股超额收益明显，10 年 1 季度存在风格转换的可能，但是我们判断过程将是缓慢和曲折的。市场对于政策的变化将更为敏感，但宏观经济和企业盈利的不断向好是市场最重要的支撑。总体而言，世界是平的，中国经济的潜力还巨大，在新经济出现之前，其实经济不平衡是发展的最大瓶颈，如果不平衡的状况得到缓解：外贸依赖下降，东西部更加平衡，社会保障制度更加充分，各种要素价格、资源配置更加合理，那么，从人均福利的角度看，传统经济在内需方面，无论投资和消费结构性升级仍有很大空间。我们的投资策略将充分考虑上述因素对市场的影响，重点关注业绩明显改善的行业和个股。行业中的领先公司或者具有较高管理水平的公司，有可能在经济震荡中进一步增强竞争力，这类公司是我们重点关注的对象。同时，09 年以来累积的大量新上市的公司，其中不乏成长性突出，行业空间巨大的好的投资标的，我们也会在其中挖掘。

具体投资策略而言，通胀相关的资源，估值很低的金融，业绩持续增长的医药，低端消费以及更新换代的家电，低端劳动力的重大拐点长期利好机械装备，节能减排，化工新材料，铁路设备，军工等都是我们将密切关注行业或者投资主题。在此基础上，我们还将注意控制股票仓位，以逆向操作为主。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中，各部门参与如下：

（一）基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）金融工程部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。

（三）估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）必要时基金经理参与制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末可供分配基金份额利润为人民币 1.4721 元，本报告期末未进行利润分配。

§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关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

普华永道中天会计师事务所为本基金出具了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：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

资产		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资产：			
银行存款		1,097,264,373.48	428,158,006.53
结算备付金		19,692,535.95	6,527,846.79
存出保证金		5,568,817.59	1,973,631.70
交易性金融资产		7,834,619,031.99	3,633,111,877.37

其中：股票投资		7,336,269,031.99	3,208,027,497.77
基金投资		-	-
债券投资		498,350,000.00	425,084,379.60
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		14,308,134.38	44,653,184.74
应收利息		1,039,602.00	9,065,305.21
应收股利		-	-
应收申购款		14,741,004.79	15,770,835.51
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,987,233,500.18	4,139,260,687.85
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2009年12月31日	2008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		16,571,554.94	-
应付赎回款		11,885,353.63	24,066,761.90
应付管理人报酬		10,781,648.55	5,453,299.45
应付托管费		1,796,941.45	908,883.23
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		16,039,415.90	8,064,014.46
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		670,834.00	649,851.98
负债合计		57,745,748.47	39,142,811.02
所有者权益：			
实收基金		2,575,297,714.74	2,263,182,938.07
未分配利润		6,354,190,036.97	1,836,934,938.76
所有者权益合计		8,929,487,751.71	4,100,117,876.83
负债和所有者权益总计		8,987,233,500.18	4,139,260,687.85

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.4674 元，基金份额总额 2,575,297,714.74 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入	3,925,096,719.73	-5,432,283,514.69
1. 利息收入	17,667,640.46	19,698,154.33
其中：存款利息收入	4,943,924.33	6,747,710.89
债券利息收入	12,723,716.13	12,950,443.44
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）	1,082,119,269.62	-3,005,475,581.67
其中：股票投资收益	1,040,709,078.34	-3,075,213,015.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-9,350,922.36	-6,180,686.51
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	9,026,198.85
股利收益	50,761,113.64	66,891,921.00
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	2,819,900,379.23	-2,453,087,185.93
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	5,409,430.42	6,581,098.58
减：二、费用	165,740,028.43	244,821,706.06
1. 管理人报酬	92,843,949.74	105,373,156.97
2. 托管费	15,473,991.65	17,562,192.75
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	56,773,719.49	119,458,713.54
5. 利息支出	159,795.60	1,886,050.04
其中：卖出回购金融资产支出	159,795.60	1,886,050.04
6. 其他费用	488,571.95	541,592.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	3,759,356,691.30	-5,677,105,220.75
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	3,759,356,691.30	-5,677,105,220.75

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	2,263,182,938.07	1,836,934,938.76	4,100,117,876.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	3,759,356,691.30	3,759,356,691.30
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）	312,114,776.67	757,898,406.91	1,070,013,183.58
其中：1. 基金申购款	2,089,547,960.72	3,592,428,528.03	5,681,976,488.75
2. 基金赎回款	-1,777,433,184.05	-2,834,530,121.12	-4,611,963,305.17
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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	2,575,297,714.74	6,354,190,036.97	8,929,487,751.71
项目	上年度可比期间 2008年1月1日至2008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）	2,194,399,910.14	6,389,947,060.89	8,584,346,971.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-5,677,105,220.75	-5,677,105,220.75
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）	68,783,027.93	1,124,093,098.62	1,192,876,126.55
其中：1. 基金申购款	2,034,852,183.65	4,520,010,579.45	6,554,862,763.10
2. 基金赎回款	-1,966,069,155.72	-3,395,917,480.83	-5,361,986,636.55
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）	2,263,182,938.07	1,836,934,938.76	4,100,117,876.83

报告附注为财务报表的组成部分

本报告附注从 7.1 至 7.4 的财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：裴长江，主管会计工作负责人：黄小慧，会计机构负责人：向辉

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金(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 86 号《关于同意华宝兴业收益增长混合型证券投资基金募集的批复》核准，由华宝兴业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《华宝兴业收益增长混合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 2,339,342,609.46 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 70 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 6 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,339,809,854.34 份基金份额，其中认购资金利息折合 467,244.88 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司，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《华宝兴业收益增长混合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。在正常的市场情况下，本基金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的 30%-95%，权证占 0%-3%，债券占 0%-70%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5% 以上；投资于稳定分红股票的比例不低于股票资产的 80%(稳定分红指过去三年内至少两次实施现金红利分配)。本基金的业绩比较基准为：65% 上证红利指数收益率+35% 上证国债指数收益率。

本财务报表由本基金的华宝兴业基金管理人公司于 2010 年 3 月 24 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》、《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 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 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 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

本基金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 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

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
华宝兴业基金管理有限公司(“华宝兴业”)	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
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	基金管理人的股东
法国兴业资产管理有限公司(Société Générale Asset Management SA)	基金管理人的股东
上海宝钢集团公司(“宝钢集团”)	基金管理人的股东的母公司
华宝证券经纪有限责任公司(“华宝证券”)	受基金管理人的控股股东控制的公司

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
华宝证券	1,722,501,904.99	4.62%	261,297,294.36	0.66%

7.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	1,464,122.91	4.69%	169,644.00	1.06%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
华宝证券	222,103.18	0.67%	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	92,843,949.74
其中：支付销售机构的客户维护费	10,896,085.02	12,990,430.75

注：支付基金管理人华宝兴业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 X 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 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费	15,473,991.65

注：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 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 2009年1月1日至2009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
中国建设银行	-	-	-	-	452,900,000.00	76,555.74
上年度可比期间 2008年1月1日至2008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
中国建设银行	-	-	-	-	291,000,000.00	149,586.91

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	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日
基金合同生效日（2006年6月15日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	229,675.51	59,370.08
期间申购/买入总份额	173,615.42	170,305.43
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	403,290.93	229,675.51
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.02%	0.01%

注：基金管理人华宝兴业在本年度申购本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理，适用费率为1.08%。

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

本基金本报告期末以及上年度末除基金管理人外其他关联方未投资本基金。

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		上年度可比期间	
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日	2008年1月1日至2008年12月31日	2008年1月1日至2008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	1,097,264,373.48	4,646,419.80	428,158,006.53	6,330,005.09

注：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

本基金本报告期内与上年度均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.9 期末（2009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

7.4.9.1.1 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
601299	中国北车	2009-12-23	2010-03-29	新股网下申购	5.56	6.13	965,563	5,368,530.28	5,918,901.19	-
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	新股网下申购	28.58	55.43	52,826	1,509,767.08	2,928,145.18	-
002320	海峡股份	2009-12-09	2010-03-16	新股网下申购	33.60	51.18	52,529	1,764,974.40	2,688,434.22	-
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	新股网下申购	60.00	113.99	22,271	1,336,260.00	2,538,671.29	-
002309	中利科技	2009-11-18	2010-03-01	新股网下申购	46.00	61.21	40,626	1,868,796.00	2,486,717.46	-
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-04-08	新股网下申购	28.99	28.99	85,488	2,478,297.12	2,478,297.12	-
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	新股网下申购	11.78	20.94	89,359	1,052,649.02	1,871,177.46	-
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	新股网下申购	23.80	31.83	53,295	1,268,421.00	1,696,379.85	-
002306	湘鄂情	2009-11-05	2010-02-11	新股网下申购	18.90	33.36	46,639	881,477.10	1,555,877.04	-
002310	东方园林	2009-11-20	2010-03-01	新股网下申购	58.60	110.88	13,914	815,360.40	1,542,784.32	-
300005	探路者	2009-09-29	2010-02-01	新股网下申购	19.80	43.17	29,177	577,704.60	1,259,571.09	-
002327	富安娜	2009-12-22	2010-03-30	新股网下申购	30.00	39.66	27,665	829,950.00	1,097,193.90	-
002322	理工监测	2009-12-11	2010-03-18	新股网下申购	40.00	61.88	14,995	599,800.00	927,890.60	-
002313	日海通讯	2009-11-26	2010-03-03	新股网下申购	24.80	40.82	17,281	428,568.80	705,410.42	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。

其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规

定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000709	唐钢股份	2009-12-16	合并重组	7.09	2010-01-25	6.60	13,175,735	93,415,961.15	93,415,961.15	复牌后更名为河北钢铁
600739	辽宁成大	2009-12-28	子公司重组	38.09	2010-01-11	41.90	900,860	30,435,199.63	34,313,757.40	-
000623	吉林敖东	2009-12-28	子公司重组	49.19	2010-01-11	54.11	450,000	19,135,111.77	22,135,500.00	-

注：本基金截至 2009 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此没有在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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此没有在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	7,336,269,031.99	81.63
	其中：股票	7,336,269,031.99	81.63
2	固定收益投资	498,350,000.00	5.55
	其中：债券	498,350,000.00	5.55
	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：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

5	银行存款和结算备付金合计	1,116,956,909.43	12.43
6	其他各项资产	35,657,558.76	0.40
7	合计	8,987,233,500.18	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	1,815,000.00	0.02
B	采掘业	530,934,298.36	5.95
C	制造业	3,652,851,037.85	40.91
C0	食品、饮料	68,294,396.95	0.76
C1	纺织、服装、皮毛	1,097,193.90	0.01
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	90,972,407.28	1.02
C4	石油、化学、塑胶、塑料	414,097,289.91	4.64
C5	电子	161,774,863.48	1.81
C6	金属、非金属	1,329,107,350.42	14.88
C7	机械、设备、仪表	989,481,349.41	11.08
C8	医药、生物制品	515,697,186.50	5.78
C99	其他制造业	82,329,000.00	0.92
D	电力、煤气及水的生产和供应业	63,889,322.31	0.72
E	建筑业	65,968,299.90	0.74
F	交通运输、仓储业	323,063,038.77	3.62
G	信息技术业	73,848,430.83	0.83
H	批发和零售贸易	370,432,249.05	4.15
I	金融、保险业	2,005,436,976.93	22.46
J	房地产业	215,061,678.31	2.41
K	社会服务业	30,040,554.50	0.34
L	传播与文化产业	2,928,145.18	0.03
M	综合类	-	-
	合计	7,336,269,031.99	82.16

8.3 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	601166	兴业银行	11,350,371	457,533,455.01	5.12
2	600030	中信证券	10,085,592	320,419,257.84	3.59
3	601006	大秦铁路	27,780,000	286,134,000.00	3.20
4	600016	民生银行	34,809,678	275,344,552.98	3.08
5	601398	工商银行	49,300,000	268,192,000.00	3.00
6	600216	浙江医药	7,000,000	248,990,000.00	2.79

7	600690	青岛海尔	9,329,956	231,289,609.24	2.59
8	601318	中国平安	3,950,000	217,605,500.00	2.44
9	600153	建发股份	14,205,340	184,101,206.40	2.06
10	600660	福耀玻璃	12,100,000	180,774,000.00	2.02

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.fsfund.com 的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601318	中国平安	374,409,455.37	9.13
2	601006	大秦铁路	348,705,512.37	8.50
3	601166	兴业银行	340,544,622.04	8.31
4	600030	中信证券	327,863,664.86	8.00
5	601398	工商银行	309,772,841.72	7.56
6	600016	民生银行	305,088,253.70	7.44
7	600036	招商银行	290,132,591.94	7.08
8	600153	建发股份	254,437,159.17	6.21
9	600660	福耀玻璃	240,860,786.75	5.87
10	600216	浙江医药	229,384,734.16	5.59
11	601666	平煤股份	220,359,679.16	5.37
12	600585	海螺水泥	217,821,161.75	5.31
13	600690	青岛海尔	213,167,566.45	5.20
14	000651	格力电器	204,127,412.20	4.98
15	600028	中国石化	204,082,998.50	4.98
16	601328	交通银行	201,428,332.89	4.91
17	600739	辽宁成大	196,425,114.60	4.79
18	600050	中国联通	192,527,042.59	4.70
19	000002	万科A	177,578,679.59	4.33
20	000016	深康佳A	175,774,989.17	4.29
21	002001	新和成	173,971,277.68	4.24
22	600031	三一重工	165,283,737.23	4.03
23	600058	五矿发展	158,502,003.39	3.87
24	000983	西山煤电	157,838,699.50	3.85
25	000401	冀东水泥	157,763,877.99	3.85
26	002024	苏宁电器	154,670,554.30	3.77
27	000932	华菱钢铁	153,012,160.15	3.73
28	600887	*ST 伊利	152,918,868.40	3.73
29	601766	中国南车	149,275,681.10	3.64

30	000001	深发展A	148,376,309.64	3.62
31	000527	美的电器	148,147,732.98	3.61
32	000933	神火股份	147,838,816.97	3.61
33	000623	吉林敖东	146,698,925.76	3.58
34	601088	中国神华	145,741,978.76	3.55
35	000968	煤气化	144,670,811.17	3.53
36	600266	北京城建	142,485,298.18	3.48
37	600594	益佰制药	141,267,413.62	3.45
38	000157	中联重科	133,847,481.20	3.26
39	000060	中金岭南	133,208,116.26	3.25
40	600123	兰花科创	131,590,429.86	3.21
41	000937	冀中能源	131,509,908.05	3.21
42	600309	烟台万华	131,459,566.81	3.21
43	600875	东方电气	131,026,855.09	3.20
44	601699	潞安环能	130,081,357.60	3.17
45	600000	浦发银行	129,996,653.73	3.17
46	600383	金地集团	126,250,171.52	3.08
47	601001	大同煤业	124,973,792.10	3.05
48	600178	东安动力	123,794,184.40	3.02
49	000680	山推股份	123,091,136.07	3.00
50	000792	盐湖钾肥	119,118,426.47	2.91
51	000063	中兴通讯	116,557,434.85	2.84
52	600048	保利地产	116,025,618.34	2.83
53	600005	武钢股份	108,770,135.95	2.65
54	600835	上海机电	108,557,228.30	2.65
55	000898	鞍钢股份	102,805,685.96	2.51
56	600583	海油工程	102,205,949.49	2.49
57	600060	海信电器	100,366,002.72	2.45
58	600001	邯郸钢铁	99,955,860.46	2.44
59	600809	山西汾酒	99,272,813.35	2.42
60	000422	湖北宜化	98,879,504.94	2.41
61	000012	南玻A	98,878,066.70	2.41
62	601628	中国人寿	96,077,791.83	2.34
63	600997	开滦股份	94,645,329.23	2.31
64	600642	申能股份	92,521,874.24	2.26
65	600880	博瑞传播	91,112,090.08	2.22
66	601390	中国中铁	90,974,031.63	2.22
67	000778	新兴铸管	87,866,707.69	2.14
68	601009	南京银行	86,632,503.96	2.11
69	000877	天山股份	85,917,355.84	2.10
70	600068	葛洲坝	85,197,832.80	2.08

71	000800	一汽轿车	84,846,422.06	2.07
72	600354	敦煌种业	84,027,685.12	2.05
73	600649	城投控股	83,787,580.70	2.04
74	601899	紫金矿业	83,675,786.67	2.04

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600036	招商银行	328,620,386.68	8.01
2	000001	深发展 A	322,965,671.60	7.88
3	600000	浦发银行	322,767,621.19	7.87
4	000651	格力电器	300,596,197.82	7.33
5	601666	平煤股份	272,888,126.92	6.66
6	000002	万科 A	251,289,268.16	6.13
7	600016	民生银行	250,877,642.48	6.12
8	601166	兴业银行	240,692,632.97	5.87
9	002024	苏宁电器	236,175,487.08	5.76
10	600739	辽宁成大	227,202,722.92	5.54
11	601318	中国平安	221,996,455.28	5.41
12	600880	博瑞传播	221,734,960.49	5.41
13	600309	烟台万华	213,246,976.09	5.20
14	600050	中国联通	210,345,304.57	5.13
15	600060	海信电器	208,736,450.82	5.09
16	000527	美的电器	201,615,005.09	4.92
17	600887	*ST 伊利	193,254,055.89	4.71
18	600266	北京城建	191,182,615.69	4.66
19	600030	中信证券	189,707,526.36	4.63
20	000877	天山股份	188,596,991.05	4.60
21	000422	湖北宜化	186,630,357.96	4.55
22	000063	中兴通讯	183,915,007.48	4.49
23	000933	神火股份	180,621,821.40	4.41
24	600660	福耀玻璃	172,610,485.23	4.21
25	000157	中联重科	172,441,556.58	4.21
26	600383	金地集团	172,273,726.75	4.20
27	000016	深康佳 A	168,349,267.45	4.11
28	000968	煤气化	160,845,884.04	3.92
29	600594	益佰制药	160,830,063.56	3.92
30	601766	中国南车	147,939,890.88	3.61
31	000937	冀中能源	147,717,058.30	3.60
32	601006	大秦铁路	147,566,376.99	3.60

33	600058	五矿发展	145,424,043.30	3.55
34	000623	吉林敖东	142,422,265.50	3.47
35	601390	中国中铁	141,531,829.40	3.45
36	601001	大同煤业	140,806,477.29	3.43
37	600875	东方电气	140,363,472.13	3.42
38	600153	建发股份	140,272,031.50	3.42
39	600809	山西汾酒	133,755,709.91	3.26
40	600354	敦煌种业	132,821,004.11	3.24
41	600123	兰花科创	131,882,326.31	3.22
42	600997	开滦股份	131,726,617.10	3.21
43	600585	海螺水泥	131,579,589.60	3.21
44	601699	潞安环能	130,263,057.75	3.18
45	600690	青岛海尔	123,100,603.78	3.00
46	600031	三一重工	121,411,088.98	2.96
47	600900	长江电力	118,779,101.82	2.90
48	600570	恒生电子	116,648,960.15	2.85
49	600835	上海机电	111,984,633.04	2.73
50	000983	西山煤电	111,101,591.50	2.71
51	000792	盐湖钾肥	110,068,934.86	2.68
52	600428	中远航运	109,770,199.66	2.68
53	600519	贵州茅台	105,869,903.49	2.58
54	600423	柳化股份	104,707,053.25	2.55
55	000778	新兴铸管	104,007,651.79	2.54
56	600449	赛马实业	103,390,345.30	2.52
57	600028	中国石化	102,635,614.19	2.50
58	600736	苏州高新	102,142,178.61	2.49
59	000560	昆百大A	100,113,200.01	2.44
60	600380	健康元	99,207,324.36	2.42
61	600486	扬农化工	97,584,691.91	2.38
62	601398	工商银行	95,651,932.61	2.33
63	600642	申能股份	95,378,286.69	2.33
64	600325	华发股份	95,345,171.84	2.33
65	601186	中国铁建	95,179,100.53	2.32
66	600048	保利地产	94,592,057.94	2.31
67	600068	葛洲坝	93,561,503.14	2.28
68	601009	南京银行	93,399,338.60	2.28
69	600216	浙江医药	93,134,259.47	2.27
70	000898	鞍钢股份	91,952,864.84	2.24
71	000012	南玻A	89,816,949.77	2.19
72	600410	华胜天成	87,926,029.97	2.14
73	601088	中国神华	87,110,403.25	2.12

74	000686	东北证券	85,820,560.42	2.09
75	600583	海油工程	84,831,727.37	2.07
76	000910	大亚科技	82,879,714.24	2.02

注：卖出金额不包括相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	18,790,719,298.40
卖出股票的收入（成交）总额	18,616,740,617.74

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

8.5 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	-	-
2	央行票据	498,350,000.00	5.58
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	498,350,000.00	5.58

8.6 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	0901053	09 央行票据 53	3,000,000	299,010,000.00	3.35
2	0901065	09 央行票据 65	2,000,000	199,340,000.00	2.23

8.7 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。

8.8 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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

8.9.2 本基金股票投资的主要对象是稳定分红的股票，基金管理人建立有基金股票备选库。

本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

8.9.3 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	5,568,817.59
2	应收证券清算款	14,308,134.38
3	应收股利	-
4	应收利息	1,039,602.00
5	应收申购款	14,741,004.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,657,558.76

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
103,249	24,942.59	1,170,643,853.48	45.46%	1,404,653,861.26	54.54%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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开放式基金	342,293.99	0.0133%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年6月15日)基金份额总额	2,339,809,854.34
本报告期期初基金份额总额	2,263,182,938.07
本报告期期间基金总申购份额	2,089,547,960.72

减：本报告期间基金总赎回份额	1,777,433,184.05
本报告期间基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,575,297,714.74

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 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、2009年6月30日，经中国证券监督管理委员会核准，华宝兴业基金管理公司聘任任志强先生、HUANG XIAOYI HELEN（黄小慧）女士为公司副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 135,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2006年6月15日）起至本报告期末。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
光大证券	1	831,862,789.46	2.23%	675,893.10	2.17%	-
中投证券	1	1,191,467,765.74	3.20%	1,012,744.17	3.25%	-
华宝证券	1	1,722,501,904.99	4.62%	1,464,122.91	4.69%	-
申银万国	1	3,905,799,665.09	10.48%	3,319,921.07	10.64%	-
中信证券	1	4,118,273,551.29	11.06%	3,500,519.36	11.22%	-
银河证券	1	2,587,853,145.43	6.95%	2,102,645.52	6.74%	-

广发证券	1	4,086,457,841.80	10.97%	3,473,474.07	11.13%	-
华泰证券	1	3,525,671,070.43	9.46%	2,996,807.65	9.60%	-
国信证券	1	3,765,572,671.61	10.11%	3,200,723.00	10.26%	-
国金证券	1	3,039,387,384.04	8.16%	2,469,522.67	7.91%	-
安信证券	2	8,476,616,201.28	22.76%	6,989,246.19	22.40%	-

注： 1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：资力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本基金本报告期券商交易单元无变更。

11.7.2 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
光大证券	0.00	-	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中投证券	8,201,360.60	9.49%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华宝证券	0.00	-	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国	0.00	-	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券	15,867,842.50	18.37%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
银河证券	1,032,700.00	1.20%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广发证券	7,674,400.10	8.88%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
华泰证券	2,961,001.20	3.43%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国信证券	1,545,000.00	1.79%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国金证券	30,451,786.05	35.25%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
安信证券	18,655,420.96	21.59%	0.00	0.00%	0.00	0.00%

§12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009 年 1 月 16 日，本基金托管人公告中国建设银行聘请胡哲一先生担任中国建设银行副行长；
- 2、2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 3、2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司

司股权变动报告书；

4、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

5、2009年8月2日，本基金托管人公告，自2009年7月24日起陈佐夫先生就任中国建设银行执行董事。

6、2009年9月27日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。

7、2009年10月11日，本基金托管人发布关于控股股东增持中国建设银行股份的公告。

华宝兴业基金管理有限公司

二〇一〇年三月二十九日