
华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金
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	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年10月7日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,036,865,347.27份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深A股按照流通市值从大至小排名在前1/3的股票。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	唐州徽
	联系电话	021-38505888	010-66594855
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	95566
传真		021-38505777	010-66594942

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	基金管理人办公场所

§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 10 月 7 日 至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益		360,795,789.97	5,136,752.33
本期利润		544,752,967.43	5,411,318.09
加权平均基金份额本期利润		0.8834	0.0113
本期基金份额净值增长率		91.29%	0.98%
3.1.2 期末数据和指标		2009 年末	2008 年 10 月 7 日
期末可供分配基金份额利润		0.6404	0.0098
期末基金资产净值		2,002,848,552.80	415,073,696.14
期末基金份额净值		1.9316	1.0098

注： 1、本基金成立于 2008 年 10 月 7 日，T-1 年度比较期间不完整，没有 T-2 年度比较期间，特此说明。

2、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。

3、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。

4、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。

5、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	25.03%	1.58%	15.23%	1.41%	9.80%	0.17%
过去六个月	22.58%	1.88%	10.92%	1.70%	11.66%	0.18%
过去一年	91.29%	1.71%	73.60%	1.64%	17.69%	0.07%
自基金成立 起至今	93.16%	1.53%	54.95%	1.82%	38.21%	-0.29%

注： 1、本基金比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

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

华宝兴业大盘精选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

(2008年10月7日至2009年12月31日)

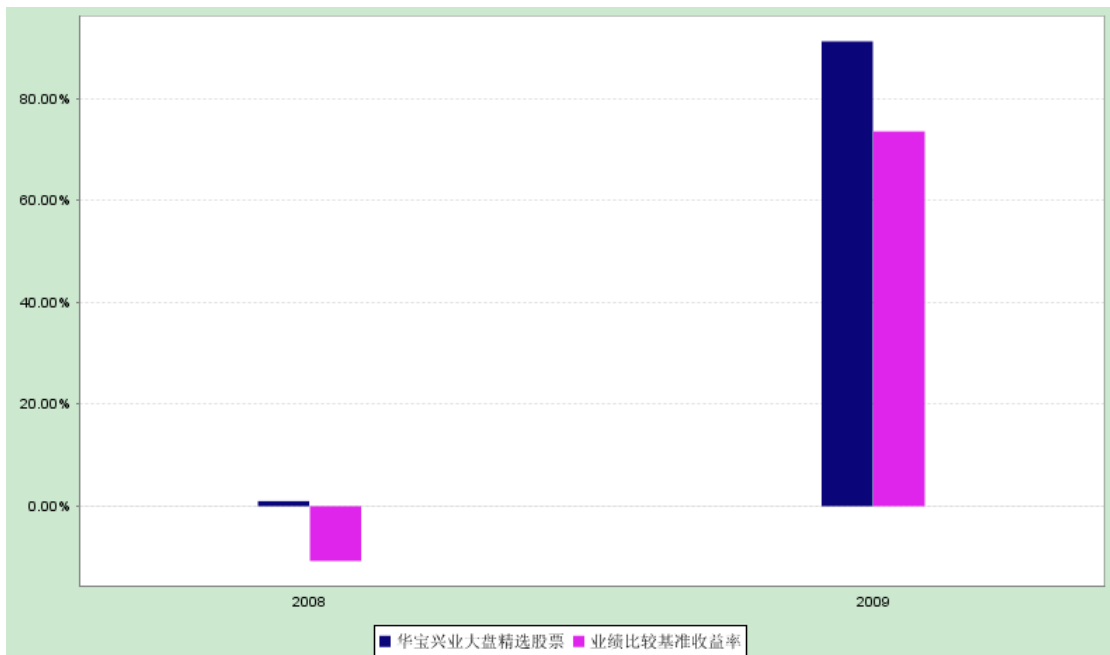


注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合，截至2009年4月7日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

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

华宝兴业大盘精选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



3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金成立于 2008 年 10 月 7 日,截止本报告期末,本基金未进行过利润分配。于 2010 年 1 月 15 日, 本基金向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.80 元。

§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收益增长基金基金经理	2008-10-07	-	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收益增长基金基金经理助理	2008-10-07	-	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、《华宝兴业大盘精选股票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

本基金在 2009 年度始终坚持在经济复苏中寻找机会，在政府扩大内需和调整经济结构中寻找投资标的，取得了较好的投资业绩。全年看，前几个月处于建仓期，是股票仓位逐渐加高的过程。

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 91.29%，基金业绩比较基准为 73.60%，2009 年全年本基金净值收益率领先业绩基准 17.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来年，我们认为影响股指走势的因素将更为复杂，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。市场面临着调控适当或过度的可能性，经济也面临着未来通胀或二次探底的可能性，中国也正处在结构调整是否成功的十字路口；市场对于政策的变化将更为敏感，但长期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，估值很低的金融，业绩持续增长的医药，下乡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，我们将继续精选具有自主创新能力的制造业龙头、需求增长稳定的消费类公司和估值更低的股票，同时关注被错杀的板块。

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 0.6404 元，本报告期内未进行利润

分配。于 2010 年 1 月 15 日，本基金向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.80 元。

§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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明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：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产		本期末	上年度末
-----	--	-----	------

		2009年12月31日	2008年12月31日
资 产:			
银行存款		154,716,695.12	119,708,698.87
结算备付金		5,725,753.43	256,149.59
存出保证金		780,879.11	-
交易性金融资产		1,859,599,507.51	306,232,535.89
其中: 股票投资		1,799,214,507.51	150,380,903.69
基金投资		-	-
债券投资		60,385,000.00	155,851,632.20
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		2,336,961.65	-
应收利息		1,346,262.88	3,558,076.30
应收股利		-	-
应收申购款		13,514,803.59	98,051.59
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	210,421.00
资产总计		2,038,020,863.29	430,063,933.24
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		706,980.10	13,506,516.96
应付赎回款		27,728,804.30	490,100.79
应付管理人报酬		2,321,714.74	591,057.98
应付托管费		386,952.47	98,509.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		3,856,331.17	223,589.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		171,527.71	80,461.83
负债合计		35,172,310.49	14,990,237.10
所有者权益:			
实收基金		1,036,865,347.27	411,025,835.66
未分配利润		965,983,205.53	4,047,860.48
所有者权益合计		2,002,848,552.80	415,073,696.14
负债和所有者权益总计		2,038,020,863.29	430,063,933.24

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.9316 元，基金份额总额 1,036,865,347.27 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

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10月7日至2008年12 月31日
一、收入	574,756,019.50	7,834,094.39
1. 利息收入	1,983,902.29	3,262,479.28
其中：存款利息收入	823,107.41	226,141.36
债券利息收入	1,160,794.88	3,036,337.92
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）	386,023,538.61	4,195,306.52
其中：股票投资收益	375,354,733.50	3,599,935.30
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,404,960.76	595,371.22
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,263,844.35	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	183,957,177.46	274,565.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,791,401.14	101,742.83
减：二、费用	30,003,052.07	2,422,776.30
1. 管理人报酬	14,479,126.39	1,678,075.67
2. 托管费	2,413,187.73	279,679.26
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	12,678,646.82	334,290.61
5. 利息支出	6,508.74	-
其中：卖出回购金融资产支出	6,508.74	-
6. 其他费用	425,582.39	130,730.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	544,752,967.43	5,411,318.09
减：所得税费用	-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		544,752,967.43	5,411,318.09
-------------------	--	----------------	--------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

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）	411,025,835.66	4,047,860.48	415,073,696.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	544,752,967.43	544,752,967.43
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）	625,839,511.61	417,182,377.62	1,043,021,889.23
其中：1. 基金申购款	2,094,455,767.78	1,193,992,015.69	3,288,447,783.47
2. 基金赎回款	-1,468,616,256.17	-776,809,638.07	-2,245,425,894.24
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）	1,036,865,347.27	965,983,205.53	2,002,848,552.80
项目	上年度可比期间 2008年10月7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）	490,050,880.11	-	490,050,880.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,411,318.09	5,411,318.09
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）	-79,025,044.45	-1,363,457.61	-80,388,502.06
其中：1. 基金申购款	985,028.94	20,128.72	1,005,157.66
2. 基金赎回款	-80,010,073.39	-1,383,586.33	-81,393,659.72
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）	411,025,835.66	4,047,860.48	415,073,696.14

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

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系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 2008 965 号文《关于核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2008 年 10 月 7 日正式生效,首次设立募集规模为 490,050,880.11 份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司,注册登记机构为华宝兴业基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数,债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

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、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金代销机构
华宝信托投资有限责任公司(“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

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

本基金本年度及自 2008 年 10 月 7 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止期间未通过关联方交易单元进行交易。

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	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年10月7日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	14,479,126.39	1,678,075.67
其中:支付销售机构的客户维护费	1,011,462.94	15,018.37

注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,

基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

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10月7日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,413,187.73	279,679.26

注:基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下:

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

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

本基金本年度及自 2008 年 10 月 7 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日止期间未通过关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 10 月 7 日至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日(2008 年 10 月 7 日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	639,193.22	-
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	639,193.22	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.06%	-

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 0.90%。

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

本报告期末及上年度末,除基金管理人之外的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 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 10 月 7 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

中国银行	154,716,695.12	749,639.77	119,708,698.87	224,977.35
------	----------------	------------	----------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金本年度及自 2008 年 10 月 7 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日止期间不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

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
002330	得利斯	2009-12-25	2010-01-06	认购网上定价发行的股票未上市	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	-

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
600739	辽宁成大	2009-12-28	子公司重组	38.09	2010-01-11	41.90	250,083	8,919,374.17	9,525,661.47	-
000623	吉林敖东	2009-12-28	子公司重组	49.19	2010-01-11	54.11	90,000	4,051,716.93	4,427,100.00	-
000709	唐钢股份	2009-12-16	换股吸收合并	7.09	2010-01-25	6.60	2,213,278	15,692,141.02	15,692,141.02	-

注：唐钢股份于 2010 年 1 月 25 日复牌后，更名为河北钢铁，代码不变。

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	1,799,214,507.51	88.28
	其中：股票	1,799,214,507.51	88.28
2	固定收益投资	60,385,000.00	2.96
	其中：债券	60,385,000.00	2.96
	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	160,442,448.55	7.87
6	其他各项资产	17,978,907.23	0.88
7	合计	2,038,020,863.29	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	3,267,000.00	0.16
B	采掘业	139,090,138.80	6.94
C	制造业	921,848,230.25	46.03
C0	食品、饮料	19,145,570.00	0.96
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	17,158,470.13	0.86
C4	石油、化学、塑胶、塑料	98,402,124.71	4.91
C5	电子	34,471,079.96	1.72
C6	金属、非金属	343,566,605.93	17.15
C7	机械、设备、仪表	267,903,163.74	13.38
C8	医药、生物制品	126,424,215.78	6.31
C99	其他制造业	14,777,000.00	0.74
D	电力、煤气及水的生产和供应业	11,126,903.70	0.56
E	建筑业	22,473,045.96	1.12
F	交通运输、仓储业	70,963,100.00	3.54
G	信息技术业	29,226,798.08	1.46
H	批发和零售贸易	91,950,396.53	4.59
I	金融、保险业	452,058,252.53	22.57
J	房地产业	48,199,241.66	2.41

K	社会服务业	4,120,800.00	0.21
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	4,890,600.00	0.24
	合计	1,799,214,507.51	89.83

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	2,574,893	103,793,936.83	5.18
2	600030	中信证券	2,250,000	71,482,500.00	3.57
3	600016	民生银行	7,954,000	62,916,140.00	3.14
4	600660	福耀玻璃	4,050,000	60,507,000.00	3.02
5	601006	大秦铁路	5,280,000	54,384,000.00	2.72
6	600690	青岛海尔	2,142,800	53,120,012.00	2.65
7	601398	工商银行	9,580,000	52,115,200.00	2.60
8	600216	浙江医药	1,420,570	50,529,674.90	2.52
9	601318	中国平安	900,000	49,581,000.00	2.48
10	002001	新和成	835,665	40,864,018.50	2.04

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	601166	兴业银行	120,113,731.54	28.94
2	600030	中信证券	91,834,517.89	22.12
3	601318	中国平安	83,776,960.36	20.18
4	600036	招商银行	83,626,596.05	20.15
5	600660	福耀玻璃	83,207,894.39	20.05
6	601006	大秦铁路	78,996,518.81	19.03
7	600016	民生银行	76,828,488.99	18.51
8	600153	建发股份	71,570,683.38	17.24
9	600585	海螺水泥	62,768,809.21	15.12
10	600000	浦发银行	61,084,724.17	14.72
11	601398	工商银行	60,516,538.12	14.58
12	600216	浙江医药	53,039,785.40	12.78
13	600690	青岛海尔	52,876,399.65	12.74
14	600028	中国石化	50,343,944.41	12.13
15	600309	烟台万华	48,916,792.46	11.79

16	601666	平煤股份	46,795,145.39	11.27
17	000001	深发展A	46,097,305.94	11.11
18	000651	格力电器	45,424,642.53	10.94
19	002001	新 和 成	43,614,792.02	10.51
20	000527	美的电器	43,500,548.74	10.48
21	601699	潞安环能	43,015,940.45	10.36
22	000401	冀东水泥	42,547,578.88	10.25
23	600060	海信电器	42,084,042.58	10.14
24	601328	交通银行	42,061,165.70	10.13
25	600739	辽宁成大	41,964,523.52	10.11
26	600887	*ST 伊利	40,718,832.21	9.81
27	601766	中国南车	40,551,538.26	9.77
28	000002	万 科 A	39,198,445.69	9.44
29	600058	五矿发展	38,707,815.62	9.33
30	000016	深康佳 A	38,258,763.83	9.22
31	000060	中金岭南	37,288,895.87	8.98
32	000932	华菱钢铁	37,036,916.40	8.92
33	600031	三一重工	36,865,546.45	8.88
34	000792	盐湖钾肥	35,019,336.61	8.44
35	000933	神火股份	34,554,593.64	8.32
36	600880	博瑞传播	34,479,215.19	8.31
37	601088	中国神华	34,104,618.35	8.22
38	002024	苏宁电器	33,241,708.51	8.01
39	600178	东安动力	32,053,245.35	7.72
40	000877	天山股份	31,620,019.44	7.62
41	000623	吉林敖东	31,616,501.44	7.62
42	600266	北京城建	31,444,766.56	7.58
43	600123	兰花科创	30,834,261.49	7.43
44	000983	西山煤电	30,606,772.06	7.37
45	601001	大同煤业	29,284,328.60	7.06
46	600050	中国联通	28,027,543.81	6.75
47	600594	益佰制药	27,612,952.70	6.65
48	600835	上海机电	27,449,921.05	6.61
49	000898	鞍钢股份	27,013,822.16	6.51
50	601899	紫金矿业	26,676,657.36	6.43
51	000968	煤 气 化	26,515,320.14	6.39
52	600048	保利地产	26,198,123.81	6.31
53	000028	一致药业	25,854,671.98	6.23
54	000063	中兴通讯	25,853,188.68	6.23
55	000012	南 玻 A	25,594,875.20	6.17
56	000937	金牛能源	25,569,500.27	6.16

57	000157	中联重科	25,427,344.08	6.13
58	600583	海油工程	24,746,931.25	5.96
59	600875	东方电气	24,425,025.39	5.88
60	600997	开滦股份	24,175,037.16	5.82
61	600271	航天信息	23,761,972.56	5.72
62	600354	敦煌种业	23,735,858.82	5.72
63	000024	招商地产	23,291,879.13	5.61
64	000422	湖北宜化	23,105,821.73	5.57
65	000800	一汽轿车	22,672,190.84	5.46
66	000910	大亚科技	21,855,187.71	5.27
67	000680	山推股份	21,530,654.14	5.19
68	600231	凌钢股份	21,504,623.08	5.18
69	600595	中孚实业	21,223,688.75	5.11
70	000858	五 粮 液	20,760,737.99	5.00
71	000778	新兴铸管	20,624,778.11	4.97
72	600702	沱牌曲酒	20,545,665.55	4.95
73	601009	南京银行	20,169,508.08	4.86
74	600809	山西汾酒	19,639,585.76	4.73
75	000069	华侨城 A	19,556,088.58	4.71
76	601169	北京银行	19,476,058.30	4.69
77	600657	信达地产	19,451,893.09	4.69
78	600808	马钢股份	19,414,816.88	4.68
79	000895	双汇发展	19,336,347.37	4.66
80	600649	城投控股	18,889,963.62	4.55
81	600001	邯郸钢铁	18,607,375.26	4.48
82	600383	金地集团	18,519,917.32	4.46
83	600449	赛马实业	18,058,854.24	4.35
84	000425	徐工机械	18,024,677.85	4.34
85	600348	国阳新能	17,943,163.60	4.32
86	000825	太钢不锈	17,893,974.84	4.31
87	002104	恒宝股份	17,761,233.94	4.28
88	000560	昆百大 A	17,754,616.90	4.28
89	002236	大华股份	17,740,980.76	4.27
90	600713	南京医药	17,733,855.40	4.27
91	600410	华胜天成	17,358,638.42	4.18
92	600425	青松建化	17,068,194.69	4.11
93	000528	柳 工	16,699,076.58	4.02
94	600829	三精制药	16,623,817.80	4.01
95	002050	三花股份	16,598,659.51	4.00
96	600642	申能股份	16,354,620.23	3.94
97	600267	海正药业	16,351,752.42	3.94

98	600736	苏州高新	16,328,379.67	3.93
99	000488	晨鸣纸业	16,226,161.22	3.91
100	000612	焦作万方	16,114,201.93	3.88
101	600519	贵州茅台	16,087,565.01	3.88
102	600068	葛洲坝	16,062,082.15	3.87
103	600761	安徽合力	15,982,722.76	3.85
104	000686	东北证券	15,920,498.60	3.84
105	601939	建设银行	15,706,182.91	3.78
106	600005	武钢股份	15,676,378.11	3.78
107	000418	小天鹅A	15,405,748.46	3.71
108	000338	潍柴动力	15,334,245.15	3.69
109	600511	国药股份	15,323,192.34	3.69
110	600089	特变电工	15,299,215.09	3.69
111	601628	中国人寿	15,245,470.22	3.67
112	600694	大商股份	15,217,012.48	3.67
113	600572	康恩贝	14,948,992.72	3.60
114	600570	恒生电子	14,880,925.16	3.59
115	600508	上海能源	14,690,923.74	3.54
116	601857	中国石油	14,676,590.99	3.54
117	600486	扬农化工	14,624,946.46	3.52
118	002208	合肥城建	14,578,049.29	3.51
119	600837	海通证券	14,444,801.20	3.48
120	600307	酒钢宏兴	14,411,835.14	3.47
121	600125	铁龙物流	14,394,224.11	3.47
122	600184	新华光	14,327,944.83	3.45
123	600500	中化国际	14,190,221.93	3.42
124	600550	天威保变	14,077,857.22	3.39
125	000707	双环科技	13,968,142.73	3.37
126	600895	张江高科	13,882,315.49	3.34
127	600664	哈药股份	13,851,109.94	3.34
128	601111	中国国航	13,847,069.29	3.34
129	000960	锡业股份	13,795,691.12	3.32
130	000066	长城电脑	13,686,451.64	3.30
131	600261	浙江阳光	13,676,001.69	3.29
132	000667	名流置业	13,473,559.19	3.25
133	000402	金融街	13,452,959.01	3.24
134	600219	南山铝业	13,370,963.42	3.22
135	002022	科华生物	13,344,683.05	3.22
136	600325	华发股份	13,092,853.00	3.15
137	600423	柳化股份	13,067,212.16	3.15
138	600104	上海汽车	13,048,723.68	3.14

139	600521	华海药业	12,891,189.82	3.11
140	002241	歌尔声学	12,795,667.91	3.08
141	000848	承德露露	12,713,027.92	3.06
142	601390	中国中铁	12,580,336.41	3.03
143	000597	东北制药	12,479,700.51	3.01
144	600517	置信电气	12,155,540.40	2.93
145	600962	国投中鲁	12,082,522.11	2.91
146	600026	中海发展	11,967,341.65	2.88
147	600528	中铁二局	11,900,584.75	2.87
148	600308	华泰股份	11,809,872.99	2.85
149	600893	航空动力	11,393,905.35	2.75
150	601668	中国建筑	11,325,301.00	2.73
151	600169	太原重工	11,219,043.27	2.70
152	600428	中远航运	11,178,357.66	2.69
153	600015	华夏银行	11,091,988.09	2.67
154	000918	嘉凯城	11,068,640.29	2.67
155	600718	东软集团	10,939,127.34	2.64
156	000783	长江证券	10,905,913.37	2.63
157	002096	南岭民爆	10,889,642.42	2.62
158	002078	太阳纸业	10,679,271.65	2.57
159	002269	美邦服饰	10,441,105.05	2.52
160	600303	曙光股份	10,253,788.42	2.47
161	600826	兰生股份	10,215,258.44	2.46
162	601186	中国铁建	10,183,062.62	2.45
163	601168	西部矿业	10,092,006.50	2.43
164	600173	卧龙地产	10,088,963.77	2.43
165	002147	方圆支承	10,073,957.57	2.43
166	601333	广深铁路	9,991,411.10	2.41
167	600380	健康元	9,952,334.50	2.40
168	000519	银河动力	9,907,402.10	2.39
169	600029	南方航空	9,837,175.53	2.37
170	002154	报喜鸟	9,789,048.88	2.36
171	000718	苏宁环球	9,692,986.29	2.34
172	000807	云铝股份	9,640,609.95	2.32
173	600971	恒源煤电	9,464,439.43	2.28
174	002097	山河智能	9,319,697.07	2.25
175	000729	燕京啤酒	9,103,305.00	2.19
176	600693	东百集团	8,932,095.34	2.15
177	600563	法拉电子	8,753,546.08	2.11
178	000031	中粮地产	8,627,139.03	2.08
179	600586	金晶科技	8,612,604.07	2.07

180	000999	三九医药	8,579,072.71	2.07
181	600741	华域汽车	8,515,770.37	2.05
182	600557	康缘药业	8,364,324.00	2.02

注：买入金额不包括相关交易费用。

8.4.2 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	600000	浦发银行	68,280,506.48	16.45
2	600036	招商银行	61,990,139.80	14.93
3	000001	深发展 A	55,514,517.33	13.37
4	600060	海信电器	53,705,481.55	12.94
5	000651	格力电器	51,207,122.44	12.34
6	601666	平煤股份	48,726,204.50	11.74
7	601166	兴业银行	46,379,273.73	11.17
8	601318	中国平安	42,212,583.13	10.17
9	600887	*ST 伊利	41,573,234.92	10.02
10	600880	博瑞传播	40,535,376.71	9.77
11	600153	建发股份	40,106,033.50	9.66
12	000877	天山股份	38,986,318.14	9.39
13	600585	海螺水泥	38,656,616.37	9.31
14	000002	万科 A	37,894,636.76	9.13
15	600739	辽宁成大	37,663,958.80	9.07
16	000016	深康佳 A	37,474,578.51	9.03
17	002024	苏宁电器	36,654,757.15	8.83
18	600660	福耀玻璃	35,942,795.52	8.66
19	000527	美的电器	35,740,725.45	8.61
20	600266	北京城建	34,845,002.28	8.39
21	000933	神火股份	33,835,145.45	8.15
22	601006	大秦铁路	32,865,819.61	7.92
23	601001	大同煤业	32,661,430.71	7.87
24	000063	中兴通讯	32,266,921.58	7.77
25	600123	兰花科创	32,115,781.05	7.74
26	601699	潞安环能	31,920,501.25	7.69
27	000157	中联重科	31,481,240.16	7.58
28	600030	中信证券	30,981,595.74	7.46
29	000422	湖北宜化	30,344,046.52	7.31
30	000623	吉林敖东	30,207,446.48	7.28
31	600050	中国联通	29,726,411.49	7.16
32	000968	煤气化	28,721,909.21	6.92
33	600594	益佰制药	28,708,236.77	6.92

34	601766	中国南车	28,206,136.54	6.80
35	000937	冀中能源	27,341,714.77	6.59
36	600835	上海机电	26,971,549.00	6.50
37	600690	青岛海尔	26,660,694.71	6.42
38	000792	盐湖钾肥	26,580,958.04	6.40
39	600031	三一重工	26,070,792.42	6.28
40	600354	敦煌种业	26,015,469.67	6.27
41	600016	民生银行	25,306,806.70	6.10
42	600875	东方电气	25,083,760.46	6.04
43	600309	烟台万华	24,682,015.53	5.95
44	600997	开滦股份	24,194,512.73	5.83
45	600028	中国石化	24,014,216.03	5.79
46	600809	山西汾酒	23,893,753.38	5.76
47	000778	新兴铸管	23,400,219.62	5.64
48	600216	浙江医药	23,361,995.95	5.63
49	600383	金地集团	23,262,555.89	5.60
50	000012	南玻A	22,466,946.84	5.41
51	600058	五矿发展	22,010,127.05	5.30
52	600449	赛马实业	21,171,246.72	5.10
53	600410	华胜天成	20,979,101.01	5.05
54	600519	贵州茅台	20,367,649.66	4.91
55	600570	恒生电子	20,270,580.38	4.88
56	000024	招商地产	20,168,978.50	4.86
57	600702	沱牌曲酒	19,866,142.83	4.79
58	600048	保利地产	19,731,939.50	4.75
59	000910	大亚科技	19,662,930.61	4.74
60	600423	柳化股份	19,559,668.10	4.71
61	601009	南京银行	19,425,394.65	4.68
62	601088	中国神华	18,972,607.01	4.57
63	600829	三精制药	18,685,850.78	4.50
64	000800	一汽轿车	18,612,282.39	4.48
65	000686	东北证券	18,520,263.55	4.46
66	000418	小天鹅A	18,266,822.56	4.40
67	601390	中国中铁	18,008,075.22	4.34
68	600761	安徽合力	17,951,870.67	4.32
69	601398	工商银行	17,796,593.44	4.29
70	000425	徐工机械	17,793,197.44	4.29
71	601899	紫金矿业	17,653,755.47	4.25
72	600508	上海能源	17,637,378.67	4.25
73	600068	葛洲坝	17,430,608.37	4.20
74	000848	承德露露	17,346,175.53	4.18

75	000932	华菱钢铁	17,028,266.26	4.10
76	000983	西山煤电	16,829,806.95	4.05
77	000560	昆百大A	16,736,661.04	4.03
78	000895	双汇发展	16,716,019.81	4.03
79	000898	鞍钢股份	16,652,190.91	4.01
80	000066	长城电脑	16,510,423.36	3.98
81	600642	申能股份	16,501,998.98	3.98
82	600486	扬农化工	16,487,630.39	3.97
83	000488	晨鸣纸业	16,375,013.17	3.95
84	600837	海通证券	16,312,537.26	3.93
85	600325	华发股份	15,917,845.96	3.83
86	600307	酒钢宏兴	15,887,145.52	3.83
87	000028	一致药业	15,851,730.68	3.82
88	600348	国阳新能	15,578,173.92	3.75
89	600219	南山铝业	15,569,381.96	3.75
90	002241	歌尔声学	15,561,903.84	3.75
91	600026	中海发展	15,516,712.09	3.74
92	600380	健康元	15,106,533.05	3.64
93	600261	浙江阳光	15,100,679.44	3.64
94	600736	苏州高新	15,090,812.05	3.64
95	600500	中化国际	15,066,203.49	3.63
96	601111	中国国航	14,821,885.91	3.57
97	600550	天威保变	14,657,353.20	3.53
98	000960	锡业股份	14,465,466.43	3.49
99	600583	海油工程	14,404,404.98	3.47
100	002104	恒宝股份	14,298,973.38	3.44
101	600267	海正药业	14,148,875.96	3.41
102	002037	久联发展	14,144,249.48	3.41
103	000612	焦作万方	14,111,391.74	3.40
104	000707	双环科技	14,038,072.88	3.38
105	000401	冀东水泥	13,975,522.02	3.37
106	000069	华侨城A	13,881,535.08	3.34
107	600425	青松建化	13,812,665.14	3.33
108	600517	置信电气	13,436,250.43	3.24
109	600971	恒源煤电	13,378,649.32	3.22
110	000858	五粮液	12,797,611.92	3.08
111	000597	东北制药	12,647,771.22	3.05
112	002001	新和成	12,515,814.88	3.02
113	600962	国投中鲁	12,514,347.52	3.01
114	601939	建设银行	12,405,428.55	2.99
115	600303	曙光股份	12,337,779.33	2.97

116	000060	中金岭南	12,326,706.60	2.97
117	002096	南岭民爆	12,318,728.12	2.97
118	000783	长江证券	12,227,406.14	2.95
119	601186	中国铁建	12,166,769.81	2.93
120	600308	华泰股份	12,114,850.86	2.92
121	600826	兰生股份	12,087,623.24	2.91
122	600015	华夏银行	12,025,363.27	2.90
123	600812	华北制药	11,929,543.32	2.87
124	600231	凌钢股份	11,822,914.15	2.85
125	600895	张江高科	11,809,924.35	2.85
126	600005	武钢股份	11,772,762.03	2.84
127	600572	康恩贝	11,676,105.36	2.81
128	000338	潍柴动力	11,662,144.41	2.81
129	000918	嘉凯城	11,487,357.86	2.77
130	600718	东软集团	11,456,115.75	2.76
131	002022	科华生物	11,347,258.84	2.73
132	002208	合肥城建	11,301,141.35	2.72
133	600428	中远航运	11,139,553.99	2.68
134	601328	交通银行	11,060,040.94	2.66
135	000680	山推股份	10,941,874.73	2.64
136	600713	南京医药	10,711,298.42	2.58
137	601333	广深铁路	10,579,296.13	2.55
138	600029	南方航空	10,320,653.95	2.49
139	000807	云铝股份	10,251,844.83	2.47
140	002147	方圆支承	10,208,237.70	2.46
141	002154	报喜鸟	10,074,991.22	2.43
142	600657	信达地产	9,822,982.54	2.37
143	600557	康缘药业	9,745,938.98	2.35
144	000402	金融街	9,736,236.96	2.35
145	000031	中粮地产	9,681,200.47	2.33
146	000667	名流置业	9,610,381.58	2.32
147	600693	东百集团	9,461,821.32	2.28
148	600741	华域汽车	9,275,656.54	2.23
149	600675	中华企业	9,253,505.89	2.23
150	000729	燕京啤酒	9,151,942.97	2.20
151	600563	法拉电子	8,894,233.15	2.14
152	600985	雷鸣科化	8,831,431.38	2.13
153	600521	华海药业	8,304,384.31	2.00

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	4,880,938,372.73
卖出股票的收入（成交）总额	3,810,573,838.25

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	60,385,000.00	3.01
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	60,385,000.00	3.01

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	0701044	07 央行票据 44	300,000	30,198,000.00	1.51
2	0701051	07 央行票据 51	200,000	20,154,000.00	1.01
3	0701019	07 央行票据 19	100,000	10,033,000.00	0.50

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大盘股，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	780,879.11
2	应收证券清算款	2,336,961.65
3	应收股利	-
4	应收利息	1,346,262.88
5	应收申购款	13,514,803.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,978,907.23

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
20,474	50,643.03	564,909,083.59	54.48%	471,956,263.68	45.52%

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	1,140,325.86	0.11%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年10月7日)基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	411,025,835.66
本报告期期间基金总申购份额	2,094,455,767.78
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,468,616,256.17
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,036,865,347.27

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（黄小蕙）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

本基金未变更负责审计的会计师事务所。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70,000.00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（2008年10月7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	
兴业证券	1	1,910,348,888.71	22.04%	1,623,788.76	22.38%	-
光大证券	1	991,257,394.63	11.44%	805,404.10	11.10%	-
招商证券	1	953,768,728.79	11.01%	774,943.47	10.68%	-
长江证券	1	686,580,573.26	7.92%	583,590.30	8.04%	-
中信金通	1	661,355,670.64	7.63%	562,150.97	7.75%	-
中信建投	1	681,202,280.62	7.86%	579,019.17	7.98%	-
国泰君安	1	1,264,080,363.34	14.59%	1,074,460.52	14.81%	-
申银万国	1	549,367,603.54	6.34%	466,960.96	6.43%	-
海通证券	1	759,511,259.34	8.76%	617,109.19	8.50%	-
中金证券	1	208,873,236.72	2.41%	169,710.61	2.34%	-
合计	10	8,666,345,999.59	100.00%	7,257,138.05	100.00%	-

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： 资质雄厚， 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、 本基金本报告期新增中金公司席位。

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
兴业证券	5,020,493.00	59.40%	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信金通	1,287,064.60	15.23%	-	-	-	-
中信建投	2,144,800.00	25.38%	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	-	-	-	-	-	-
合计	8,452,357.60	100.00%	-	-	-	-

华宝兴业基金管理有限公司

二〇一〇年三月二十九日