华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金下设之宝康消费品证券投资基金

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	华宝兴业宝康消费品混合
基金主代码	240001
交易代码	240001
系列基金名称	华宝兴业宝康系列
系列其他子基金名称	华宝兴业宝康配置混合(240002)、华宝兴业宝康债券(240003)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003 年 7 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	2,386,539,972.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	分享我国全面建设小康社会过程中消费品各相关行业的稳步成长；为基金份额持有人谋求长期稳定回报。
投资策略	本基金看好消费品的发展前景，长期持有消费品组合，并注重资产在其各相关行业的配置，适当进行时机选择。
业绩比较基准	上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数×80%+中信标普全债指数×20%。 复合指数＝（上证 180 流通市值／成分指数总流通市值）× 上证 180 指数＋（深证 100 流通市值／成分指数总流通市值）×深证 100 指数 成分指数总流通市值＝上证 180 流通市值＋深证 100 流通市值

注:鉴于中信全债指数的编制人中信标准普尔指数信息服务（北京）有限公司已将"中信全债指数"更名为"中信标普全债指数"，"中信标普全债指数"的编制方法和选样标准与"中信全债指数"的编制方法和选样标准完全一致，本基金管理人将宝康消费品证券投资基金原有的业绩比较基准“上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数*80%+中信全债指数*20%”更改为“上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数*80%+中信标普全债指数*20%”。

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	尹东
	联系电话	021-38505888	010—67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010—67595096

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	843,617,400.77	-766,560,196.52	3,218,342,250.97
本期利润	1,656,480,053.46	-1,575,414,218.22	2,930,005,158.12
加权平均基金份额本期利润	0.7581	-0.6727	1.0037
本期基金份额净值增长率	83.29%	-41.78%	96.45%
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	1.1311	0.5035	1.1793
期末基金资产净值	3,797,107,221.66	2,108,025,433.34	3,910,458,895.30
期末基金份额净值	1.5911	0.9055	1.6130

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、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）。

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。

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	21.64%	1.30%	14.75%	1.42%	6.89%	-0.12%
过去六个月	21.91%	1.65%	9.89%	1.72%	12.02%	-0.07%
过去一年	83.29%	1.60%	73.02%	1.65%	10.27%	-0.05%
过去三年	109.64%	1.78%	65.99%	2.02%	43.65%	-0.24%
过去五年	366.82%	1.50%	206.16%	1.72%	160.66%	-0.22%

自基金成立起至今	430.75%	1.37%	161.85%	1.58%	268.90%	-0.21%

注： 1、本基金业绩比较基准为：上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数×80%+中信标普全债指数×20%。

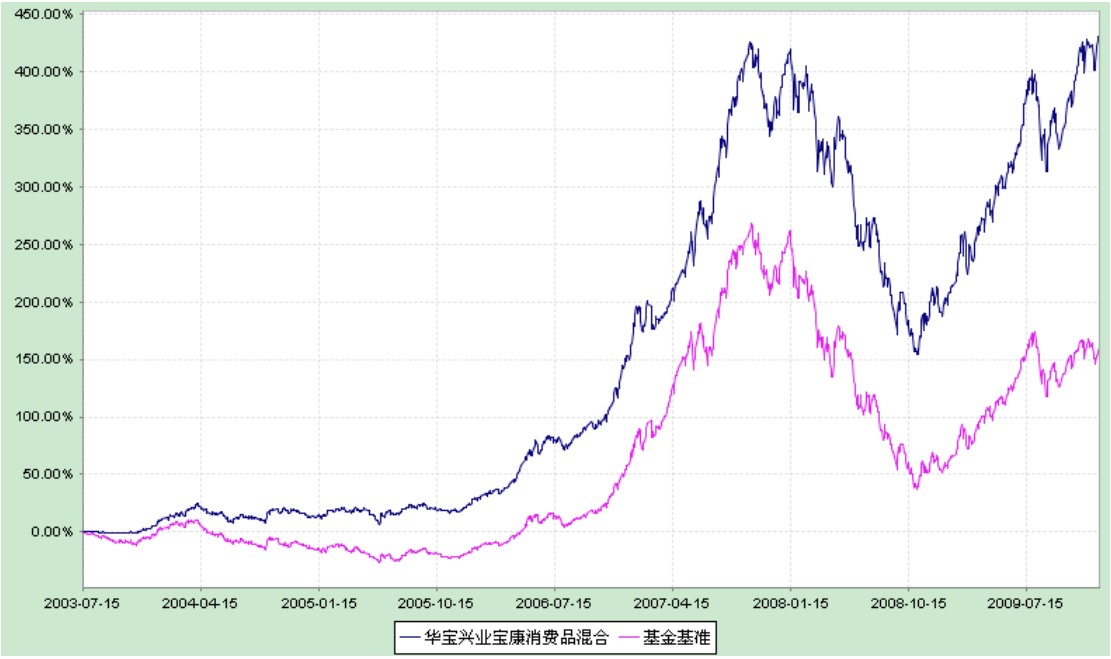
2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

华宝兴业宝康消费品证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2003 年 7 月 15 日至 2009 年 12 月 31 日）

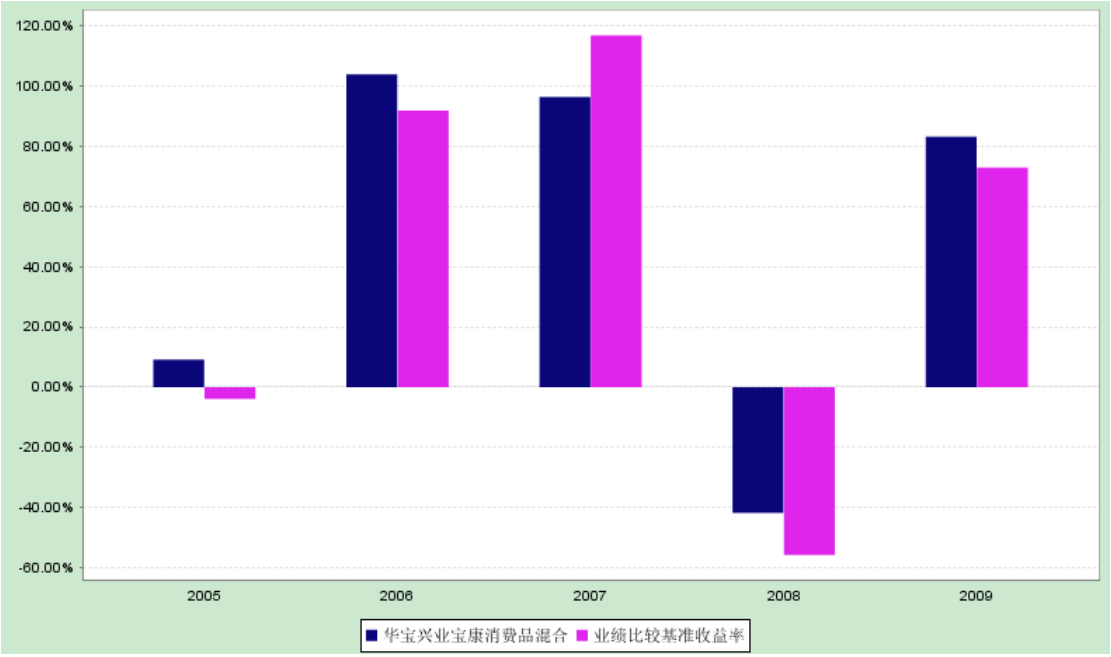


注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2004 年 1 月 15 日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

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

华宝兴业宝康消费品证券投资基金

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
2009	0.500	64,188,027.76	63,098,564.35	127,286,592.11	-
2008	0.500	59,545,773.90	54,588,306.89	114,134,080.79	-
2007	1.000	193,585,433.15	116,528,303.98	310,113,737.13	-
合计	2.000	317,319,234.81	234,215,175.22	551,534,410.03	-

注：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 0.50 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 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		
闫旭	本基金基金经理	2008-04-25	-	9 年	硕士。曾在富国基金管理有限公司从事证券研究、交易和投资工作，2004 年 10 月进入本公司，先后任多策略增长基金基金经理助理、宝康消费品基金基金经理助理。2007 年 6 月至 2008 年 9 月 23 日期间任行业精选基金经理。2008 年 4 月至今任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理。
朱亮	本基金基金经理助理	2009-11-19	-	4 年	硕士。曾在国金证券研究所从事行业研究工作。2008 年 6 月加入华宝兴业基金管理有限公司任研究部高级分析师，2009 年 11 月至今任华宝兴业宝康消费品证券投资基金基金经理助理。

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、《华宝兴业宝康系列开放式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同向交易价差的分析；分析结果没有发现交易价差异常。

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

2009 年上证指数从年初的不到 2000 点上涨到年底的逾 3200 点，涨幅近 80%。在国家 4 万亿财政刺激政策和全年 9.5 万亿信贷支持下，中国经济基本面触底回升，GDP 环比增速不断提高，政府重点投入的基建项目率先反弹，地产、汽车、家电等先导性产业也强劲恢复，继而拉动中上游的煤炭、钢铁、水泥、有色等行业的复苏。在各种优惠政策下，消费全年保持了 16%的增长，起到了经济增长稳定剂的作用。

09 年全年看，有色、煤炭等周期类板块以及汽车、家电等耐用消费品的涨幅居前，高速、电力、通信运营等防守类板块涨幅落后。由于在 8 月份货币政策出现收缩迹象，股指大幅下跌，进攻性板块和防御性板块也产生了转变：前期钢铁、地产、有色、煤炭等强周期板块也出现调整，而汽车、家电、医药、食品饮料、TMT 等在强劲的基本面支撑下大幅上涨。

年初，我们就坚定的看好经济的触底回升，并及时加仓。上半年重点配置在汽车、家电、地产等先导性行业，以及金融行业，并且基于上游行业的资产价值低估配置了有色、钢铁行业，提高了组合的进攻性。下半年基于我们对宽松的货币政策的收缩预期，以及资产价格大幅上升后政府抑制资产泡沫的判断，我们在销售数据持续向好的过程中减持了地产，同时也减持了有色、钢铁等行业，同时增加了医药、食品饮料、商业、传媒、农业等行业的配置，增加了组合的防御性。在全年保持了汽车、家电行业的重配，并坚持了长期持有的策略，取得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期净值增长率为 83.29%,同期业绩比较基准增长率为 73.02%,基金业绩超越基准 10.27%.

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 2010 年，全球经济逐步复苏，中国则进入经济扩张阶段。但在经济向好的背景下，前期宽松的政策也面临退出。2010 年将是全球逐步回收流动性、抵抗通胀的一年。中国在管理通胀预期的同时，更重要的在于经济结构的转型，新兴产业带来新的经济增长动力的培育。因此，在中国经济调结构、促进消费的大背景下，我们更看好以汽车、家电、医药、商业零售为代表泛消费板块。同时我们认为，低碳、节能减排、新能源、3G 代表的新兴产业，新疆、海南、安徽等代表的区域板块，将逐步成为未来几年中国新的经济增长源泉。我们在

后续的投资中将进一步深入个股研究。精选个股将是我们全年投资策略的重要一环。

感谢持有人一直以来对我们的支持，在后续投资中，我们将继续总结经验，勤勉尽责，努力实现消费品基金的良好表现。

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及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 1.1311 元，2009 年 4 月 22 日本基金向基金持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.50 元。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 0.50 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，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损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 127,286,592.11 元。

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：华宝兴业宝康消费品证券投资基金

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		573,958,561.31	66,051,754.95
结算备付金		7,985,567.00	4,084,057.43
存出保证金		3,101,302.03	972,179.44
交易性金融资产		3,325,095,419.91	2,003,823,388.20
其中：股票投资		2,512,126,419.91	1,479,082,388.20
基金投资		-	-
债券投资		812,969,000.00	524,741,000.00
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		-	39,100,758.35
应收利息		15,702,977.49	9,933,051.02
应收股利		-	-
应收申购款		7,626,159.20	980,062.15
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,933,469,986.94	2,124,945,251.54
负债和所有者权益		本期末 2009年12月31日	上年度末 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		105,084,908.45	-
应付赎回款		20,416,234.08	10,257,396.56
应付管理人报酬		4,117,721.34	2,782,141.83
应付托管费		686,286.92	463,690.29
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		5,399,314.19	2,801,684.85
应交税费		6,446.40	6,446.40
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		651,853.90	608,458.27
负债合计		136,362,765.28	16,919,818.20
所有者权益：			
实收基金		959,320,002.28	935,791,500.24
未分配利润		2,837,787,219.38	1,172,233,933.10
所有者权益合计		3,797,107,221.66	2,108,025,433.34
负债和所有者权益总计		3,933,469,986.94	2,124,945,251.54

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5911 元，基金份额总额 2,386,539,972.65 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业宝康消费品证券投资基金

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		**1,739,089,987.98**	**-1,465,762,149.85**
1. 利息收入		25,155,645.15	26,623,142.16
其中：存款利息收入		1,400,692.42	2,126,657.89
债券利息收入		23,754,952.73	24,496,484.27
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）		895,324,393.24	-686,603,072.37
其中：股票投资收益		884,310,487.12	-709,275,023.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-4,059,202.37	2,006,482.67

资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	2,460,376.54
股利收益		15,073,108.49	18,205,092.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		812,862,652.69	-808,854,021.70
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		5,747,296.90	3,071,802.06
减：二、费用		**82,609,934.52**	**109,652,068.37**
1．管理人报酬		41,576,825.42	42,093,167.54
2．托管费		6,929,470.89	7,015,527.92
3．销售服务费		-	-
4．交易费用		33,100,571.37	57,627,633.21
5．利息支出		741,344.56	2,676,435.51
其中：卖出回购金融资产支出		741,344.56	2,676,435.51
6．其他费用		261,722.28	239,304.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**1,656,480,053.46**	**-1,575,414,218.22**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		1,656,480,053.46	-1,575,414,218.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业宝康消费品证券投资基金

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）	935,791,500.24	1,172,233,933.10	2,108,025,433.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,656,480,053.46	1,656,480,053.46
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）	23,528,502.04	136,359,824.93	159,888,326.97
其中：1.基金申购款	929,814,795.82	2,169,175,015.17	3,098,989,810.99
2.基金赎回款	-906,286,293.78	-2,032,815,190.24	-2,939,101,484.02
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）	-	-127,286,592.11	-127,286,592.11
五、期末所有者权益（基金净值）	959,320,002.28	2,837,787,219.38	3,797,107,221.66
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）	974,543,586.98	2,935,915,308.32	3,910,458,895.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,575,414,218.22	-1,575,414,218.22
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）	-38,752,086.74	-74,133,076.21	-112,885,162.95
其中：1. 基金申购款	401,978,837.44	854,074,323.43	1,256,053,160.87
2. 基金赎回款	-440,730,924.18	-928,207,399.64	-1,368,938,323.82
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）	-	-114,134,080.79	-114,134,080.79
五、期末所有者权益（基金净值）	935,791,500.24	1,172,233,933.10	2,108,025,433.34

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：黄小薏，会计机构负责人：向辉

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金(以下简称“本系列基金”)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 2003 第 62 号《关于同意华宝兴业宝康系列证券投资基金设立的批复》核准，由华宝兴业基金管理有限公司依照《证券投资基金管理暂行办法》及其实施细则、《开放式证券投资基金试点办法》等有关规定和《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金契约》(后更名为《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金基金合同》)发起，并于 2003 年 7 月 15 日募集成立。本系列基金为契约型开放式，存续期限不定，目前下设三个子基金，分别为宝康消费品证券投资基金(以下简称“本基金”)、宝康灵活配置证券投资基金和宝康债券投资基金。本系列基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,893,701,931.41 元，其中包括本基金人民币 1,540,046,055.09 元、宝康灵活配置证券投资基金人民币 1,066,581,834.53 元和宝康债券投资基金人民币 1,287,074,041.79 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道验字(2003)第 96 号验资报告予以验证。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《华宝兴业宝康系列开放式证券投资基金更新的招募说明书》和《华宝兴业基金管理有限公司关于对华宝兴业宝康消费品证券投资基金实施基金份额拆分的公告》的有关规定，本基金于 2007 年 3 月 26 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2.487739364，并于 2007

年 3 月 26 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业宝康系列开放式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，其中投资于消费品类股票的比例不低于股票资产的 80%，在正常的市场情况下，本基金的股票投资比例范围为基金资产净值的 50%-75%；债券为 20%-45%；现金比例在 5%以上。本基金的业绩比较基准为：上证 180 指数和深证 100 指数的复合指数 X80%＋中信标普全债指数(原名为“中信全债指数”)X20%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 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》、《华宝兴业宝康系列开放式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《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”)	基金管理人的最终控制方

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

本基金本报告期内及上年度均未通过关联交易单位进行交易。

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 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	41,576,825.42	42,093,167.54
其中：支付销售机构的客户维护费	482,759.88	182,069.75

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	6,929,470.89	7,015,527.92

注: 支付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	10,629,704.38	10,555,502.74	-	-	1,370,000,000.00	344,798.78
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	154,928,494.52	-	-	-	-	-

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 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2003 年 7 月 15 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	401,564.76	133,244.50
期间申购/买入总份额	597,710.96	268,320.26
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	999,275.72	401,564.76
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.04%	0.02%

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2. 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

本基金本报告期末及上年度末没有除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 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	573,958,561.31	1,237,386.91	66,051,754.95	1,960,756.53

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
002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	新股网下申购	60.00	113.99	25,983	1,558,980.00	2,961,802.17	-
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	-
300002	神州泰岳	2009-09-29	2010-02-01	新股网下申购	58.00	105.20	22,778	1,321,124.00	2,396,245.60	-
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	25,744	509,731.20	1,111,368.48	-
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	40.00	61.88	13,632	545,280.00	843,548.16	-

				下申购						
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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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	2,512,126,419.91	63.87
	其中：股票	2,512,126,419.91	63.87
2	固定收益投资	812,969,000.00	20.67
	其中：债券	812,969,000.00	20.67
	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	581,944,128.31	14.79
6	其他各项资产	26,430,438.72	0.67
7	合计	3,933,469,986.94	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	21,922,757.32	0.58
B	采掘业	105,483,668.52	2.78
C	制造业	1,620,555,434.15	42.68
C0	食品、饮料	171,521,923.75	4.52
C1	纺织、服装、皮毛	1,097,193.90	0.03
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,111,368.48	0.03
C4	石油、化学、塑胶、塑料	42,033,994.10	1.11
C5	电子	54,218,310.55	1.43
C6	金属、非金属	274,632,950.87	7.23
C7	机械、设备、仪表	776,634,063.47	20.45
C8	医药、生物制品	282,218,941.71	7.43
C99	其他制造业	17,086,687.32	0.45
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,542,784.32	0.04
F	交通运输、仓储业	197,353,013.16	5.20
G	信息技术业	173,038,910.31	4.56
H	批发和零售贸易	289,049,898.64	7.61
I	金融、保险业	67,318,264.34	1.77
J	房地产业	19,037,787.75	0.50
K	社会服务业	13,895,756.22	0.37
L	传播与文化产业	2,928,145.18	0.08
M	综合类	-	-
	合计	2,512,126,419.91	66.16

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	000800	一汽轿车	7,700,000	200,354,000.00	5.28
2	600104	上海汽车	6,600,000	172,458,000.00	4.54
3	600660	福耀玻璃	10,153,417	151,692,049.98	3.99
4	601111	中国国航	14,599,899	141,765,019.29	3.73
5	600690	青岛海尔	4,057,094	100,575,360.26	2.65
6	600570	恒生电子	4,325,555	90,879,910.55	2.39
7	000527	美的电器	3,609,741	83,745,991.20	2.21
8	600519	贵州茅台	454,918	77,254,174.76	2.03
9	600694	大商股份	1,674,353	73,319,917.87	1.93
10	600216	浙江医药	2,056,776	73,159,522.32	1.93

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	245,379,779.53	11.64
2	600383	金地集团	217,802,387.07	10.33
3	600050	中国联通	191,168,295.70	9.07
4	600104	上海汽车	182,153,362.18	8.64
5	600428	中远航运	179,908,299.61	8.53
6	601111	中国国航	177,626,750.61	8.43
7	601166	兴业银行	158,652,609.89	7.53
8	000069	华侨城Ａ	150,742,324.17	7.15
9	600660	福耀玻璃	149,467,567.44	7.09
10	000002	万 科Ａ	138,285,815.61	6.56
11	600519	贵州茅台	131,769,780.07	6.25
12	000839	中信国安	123,632,011.84	5.86
13	600694	大商股份	122,439,155.10	5.81
14	600266	北京城建	121,035,970.48	5.74
15	600016	民生银行	120,334,151.91	5.71
16	600550	天威保变	119,247,267.60	5.66
17	000024	招商地产	118,535,163.05	5.62
18	600048	保利地产	117,414,269.31	5.57
19	600690	青岛海尔	117,124,587.72	5.56
20	601899	紫金矿业	115,355,145.54	5.47
21	600570	恒生电子	112,047,227.38	5.32
22	600030	中信证券	111,966,697.14	5.31
23	600547	山东黄金	110,450,620.82	5.24
24	600058	五矿发展	110,170,412.97	5.23
25	600000	浦发银行	105,826,132.19	5.02
26	000060	中金岭南	105,059,230.77	4.98
27	000623	吉林敖东	104,706,618.82	4.97
28	600060	海信电器	101,722,992.13	4.83
29	600739	辽宁成大	100,674,302.65	4.78
30	600216	浙江医药	97,797,132.04	4.64
31	000933	神火股份	95,466,260.95	4.53
32	000001	深发展Ａ	94,528,560.39	4.48
33	601666	平煤股份	90,048,271.05	4.27
34	000878	云南铜业	89,431,195.34	4.24

35	000800	一汽轿车	88,579,380.58	4.20
36	600309	烟台万华	83,174,093.38	3.95
37	600307	酒钢宏兴	82,923,525.55	3.93
38	000527	美的电器	82,596,869.95	3.92
39	600325	华发股份	81,698,399.03	3.88
40	600331	宏达股份	81,589,362.39	3.87
41	600837	海通证券	80,854,262.52	3.84
42	600859	王府井	77,971,351.11	3.70
43	000983	西山煤电	77,898,448.36	3.70
44	000402	金 融 街	77,429,714.97	3.67
45	002024	苏宁电器	74,187,011.38	3.52
46	600029	南方航空	72,888,988.85	3.46
47	000031	中粮地产	70,874,119.18	3.36
48	000012	南 玻A	70,232,763.42	3.33
49	600880	博瑞传播	69,118,996.25	3.28
50	000718	苏宁环球	67,314,409.25	3.19
51	000651	格力电器	63,783,120.79	3.03
52	000016	深康佳A	63,543,234.85	3.01
53	600231	凌钢股份	62,686,027.76	2.97
54	601919	中国远洋	60,358,180.24	2.86
55	600456	宝钛股份	59,322,869.53	2.81
56	002269	美邦服饰	59,262,795.18	2.81
57	600005	武钢股份	58,474,006.13	2.77
58	600315	上海家化	58,422,202.49	2.77
59	600362	江西铜业	57,968,822.53	2.75
60	000987	广州友谊	57,586,176.90	2.73
61	600741	华域汽车	56,566,188.99	2.68
62	000968	煤 气 化	56,479,267.14	2.68
63	000625	长安汽车	55,989,741.93	2.66
64	000858	五 粮 液	55,835,542.90	2.65
65	600153	建发股份	55,328,300.68	2.62
66	600675	中华企业	54,999,143.89	2.61
67	600467	好当家	54,258,148.95	2.57
68	600713	南京医药	53,904,613.01	2.56
69	600812	华北制药	53,680,944.83	2.55
70	600178	东安动力	53,367,533.58	2.53
71	600585	海螺水泥	52,768,281.48	2.50
72	000932	华菱钢铁	51,989,417.84	2.47
73	600118	中国卫星	51,778,732.73	2.46
74	600221	海南航空	50,730,796.73	2.41
75	601628	中国人寿	50,519,154.64	2.40

76	600737	中粮屯河	50,029,704.62	2.37
77	600702	沱牌曲酒	49,950,433.38	2.37
78	600962	国投中鲁	49,920,498.61	2.37
79	601006	大秦铁路	48,857,644.97	2.32
80	000667	名流置业	48,852,717.74	2.32
81	000423	东阿阿胶	48,807,132.59	2.32
82	600736	苏州高新	47,179,746.10	2.24
83	000063	中兴通讯	45,970,841.15	2.18
84	600196	复星医药	45,443,215.58	2.16
85	000560	昆百大Ａ	45,103,218.59	2.14
86	600875	东方电气	44,696,794.34	2.12
87	000898	鞍钢股份	44,398,057.00	2.11
88	600166	福田汽车	44,136,608.01	2.09
89	600595	中孚实业	42,726,450.07	2.03
90	000401	冀东水泥	42,604,048.55	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	601318	中国平安	328,629,544.17	15.59
2	600383	金地集团	241,909,610.10	11.48
3	000002	万 科Ａ	225,160,431.13	10.68
4	600030	中信证券	189,384,773.82	8.98
5	600428	中远航运	188,850,661.05	8.96
6	600050	中国联通	171,563,142.47	8.14
7	000069	华侨城Ａ	160,696,782.13	7.62
8	600058	五矿发展	156,415,110.30	7.42
9	600048	保利地产	152,435,703.42	7.23
10	600739	辽宁成大	151,299,736.30	7.18
11	000001	深发展Ａ	146,040,035.72	6.93
12	000800	一汽轿车	143,879,676.84	6.83
13	600000	浦发银行	140,073,338.27	6.64
14	000024	招商地产	137,356,510.86	6.52
15	000839	中信国安	132,745,225.99	6.30
16	600016	民生银行	132,228,119.18	6.27
17	600880	博瑞传播	130,943,050.51	6.21
18	000031	中粮地产	129,490,986.51	6.14
19	000402	金 融 街	128,812,953.77	6.11
20	600570	恒生电子	124,978,928.81	5.93
21	600266	北京城建	122,835,657.82	5.83

22	601166	兴业银行	121,493,927.80	5.76
23	002024	苏宁电器	120,005,927.75	5.69
24	000623	吉林敖东	118,229,014.16	5.61
25	600104	上海汽车	114,716,166.43	5.44
26	600331	宏达股份	114,442,053.59	5.43
27	600036	招商银行	110,736,017.94	5.25
28	000933	神火股份	102,358,086.93	4.86
29	000878	云南铜业	100,702,687.61	4.78
30	600307	酒钢宏兴	98,822,117.37	4.69
31	601666	平煤股份	98,082,453.08	4.65
32	600737	中粮屯河	95,456,473.29	4.53
33	601111	中国国航	92,918,743.62	4.41
34	600362	江西铜业	88,457,848.16	4.20
35	000651	格力电器	87,530,331.17	4.15
36	600837	海通证券	86,703,382.22	4.11
37	600309	烟台万华	86,405,514.02	4.10
38	600325	华发股份	85,394,978.73	4.05
39	000983	西山煤电	84,353,828.19	4.00
40	000422	湖北宜化	81,994,768.32	3.89
41	600060	海信电器	81,426,582.19	3.86
42	600029	南方航空	79,905,256.59	3.79
43	000625	长安汽车	78,767,136.97	3.74
44	600118	中国卫星	78,682,738.55	3.73
45	601808	中海油服	77,247,860.54	3.66
46	000012	南 玻Ａ	74,874,304.88	3.55
47	600675	中华企业	74,663,662.00	3.54
48	600231	凌钢股份	74,602,835.15	3.54
49	600736	苏州高新	73,807,447.92	3.50
50	600900	长江电力	73,770,991.37	3.50
51	601628	中国人寿	73,445,754.49	3.48
52	000016	深康佳Ａ	71,676,997.37	3.40
53	000718	苏宁环球	68,592,217.02	3.25
54	601919	中国远洋	68,108,791.55	3.23
55	600547	山东黄金	67,472,686.98	3.20
56	600153	建发股份	65,577,081.10	3.11
57	000667	名流置业	63,713,887.86	3.02
58	600456	宝钛股份	63,364,162.55	3.01
59	600519	贵州茅台	62,839,589.56	2.98
60	600005	武钢股份	62,487,859.16	2.96
61	600741	华域汽车	61,616,093.77	2.92
62	600690	青岛海尔	60,567,464.31	2.87

63	000968	煤 气 化	60,238,745.22	2.86
64	600467	好当家	58,381,084.69	2.77
65	002022	科华生物	57,855,781.73	2.74
66	600812	华北制药	57,585,216.65	2.73
67	600557	康缘药业	57,461,465.65	2.73
68	601899	紫金矿业	57,149,916.67	2.71
69	000527	美的电器	55,528,564.67	2.63
70	000932	华菱钢铁	55,256,099.05	2.62
71	600694	大商股份	54,393,259.74	2.58
72	600166	福田汽车	53,150,828.91	2.52
73	600585	海螺水泥	52,664,220.86	2.50
74	600196	复星医药	52,653,585.31	2.50
75	600748	上实发展	52,359,958.98	2.48
76	000898	鞍钢股份	51,136,603.58	2.43
77	601006	大秦铁路	49,784,377.91	2.36
78	600702	沱牌曲酒	48,992,351.22	2.32
79	601958	金钼股份	48,978,146.54	2.32
80	000401	冀东水泥	48,877,944.65	2.32
81	000063	中兴通讯	46,909,182.27	2.23
82	002261	拓维信息	46,786,274.84	2.22
83	600875	东方电气	46,642,958.04	2.21
84	601699	潞安环能	46,264,500.46	2.19
85	600816	安信信托	45,744,216.22	2.17
86	600303	曙光股份	45,533,111.97	2.16
87	000060	中金岭南	45,211,498.49	2.14
88	000911	南宁糖业	44,783,059.02	2.12
89	600439	瑞贝卡	42,320,450.70	2.01

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	10,411,024,095.39
卖出股票的收入（成交）总额	11,092,833,653.49

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	597,458,000.00	15.73
3	金融债券	215,511,000.00	5.68

	其中：政策性金融债	215,511,000.00	5.68
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	812,969,000.00	21.41

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	0801041	08 央行票据 41	1,500,000	154,275,000.00	4.06
2	050208	05 国开 08	900,000	90,693,000.00	2.39
3	0801047	08 央行票据 47	600,000	61,746,000.00	1.63
4	0901061	09 央行票据 61	600,000	59,802,000.00	1.57
5	080215	08 国开 15	500,000	52,540,000.00	1.38

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 本基金主要投资对象为消费品类股票，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	3,101,302.03
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	15,702,977.49
5	应收申购款	7,626,159.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,430,438.72

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未存在流通受限情况。

§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
73,357	32,533.23	1,007,417,478.03	42.21%	1,379,122,494.62	57.79%

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	774,247.15	0.0324%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2003 年 7 月 15 日)基金份额总额	1,541,018,133.75
本报告期期初基金份额总额	2,327,992,266.75
本报告期期间基金总申购份额	2,313,128,538.83
减：本报告期期间基金总赎回份额	2,254,580,832.93
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	2,386,539,972.65

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（黄小薏）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 100,000.00 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（2003 年 7 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	
国泰君安	2	7,091,627,142.10	33.03%	5,921,872.71	32.95%	-
中信建投	1	405,407,200.53	1.89%	344,593.94	1.92%	-
联合证券	1	2,313,888,570.26	10.78%	1,966,792.52	10.94%	-
长江证券	1	1,707,958,702.70	7.96%	1,387,731.41	7.72%	-
海通证券	1	2,018,138,558.36	9.40%	1,715,411.25	9.54%	-
中金国际	1	2,759,509,205.22	12.85%	2,345,572.22	13.05%	-
中信证券	1	2,333,173,635.08	10.87%	1,983,190.26	11.03%	-
国信证券	1	2,839,010,032.01	13.22%	2,306,722.02	12.84%	-

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情况。

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
国泰君安	20,191,020.00	100.00%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中金国际	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

§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