

上证红利交易型开放式指数证券投资基金2009年半年度报告

2009年06月30日

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2009年08月26日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2009年8月25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。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。本财务报告资料未经审计。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	10
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	10
6.1 资产负债表	10
6.2 利润表	11
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	12
6.4 报表附注	13
§7 投资组合报告	29
7.1 期末基金资产组合情况	29
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	29
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	30
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	31
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	32
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	33
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	33
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	33
7.9 投资组合报告附注	33
§8 基金份额持有人信息	34

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	34
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	34
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	34
§9 开放式基金份额变动.....	35
§10 重大事件揭示.....	35
10.1 基金份额持有人大会决议.....	35
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	35
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	35
10.4 基金投资策略的改变.....	35
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	35
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况.....	35
10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	35
10.8 其他重大事件.....	36
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	37
§12 备查文件目录.....	37
12.1 备查文件目录.....	37
12.2 存放地点.....	37
12.3 查阅方式.....	37

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	上证红利交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	友邦华泰上证红利ETF
交易代码	510880
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2006年11月17日
报告期末基金份额总额	1,639,675,703.00
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2007年01月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	上证红利指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数，是股票基金中风险较低、收益中等的产品。

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		友邦华泰基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	张燕
	联系电话	021-38601777	0755-83199084
	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95555
传真		021-38601799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区世纪大道88号金茂大厦40楼	深圳深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	深圳深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200135	518040
法定代表人		齐亮	秦晓

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.aig-huatai.com
基金半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

2.5 其他相关资料

项目	注册登记机构
名称	中国证券登记结算有限责任公司
办公地址	北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
本期已实现收益	230,437,943.19
本期利润	1,344,494,609.30
加权平均基金份额本期利润	0.9313
本期加权平均净值利润率	46.60%
本期基金份额净值增长率	62.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
期末可供分配利润	1,234,293,585.05
期末可供分配基金份额利润	0.7528
期末基金资产净值	3,877,244,714.53
期末基金份额净值	2.3650
3.1.3 累计期末指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
基金份额累计净值增长率	56.90%

注：1、上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。

3.2 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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

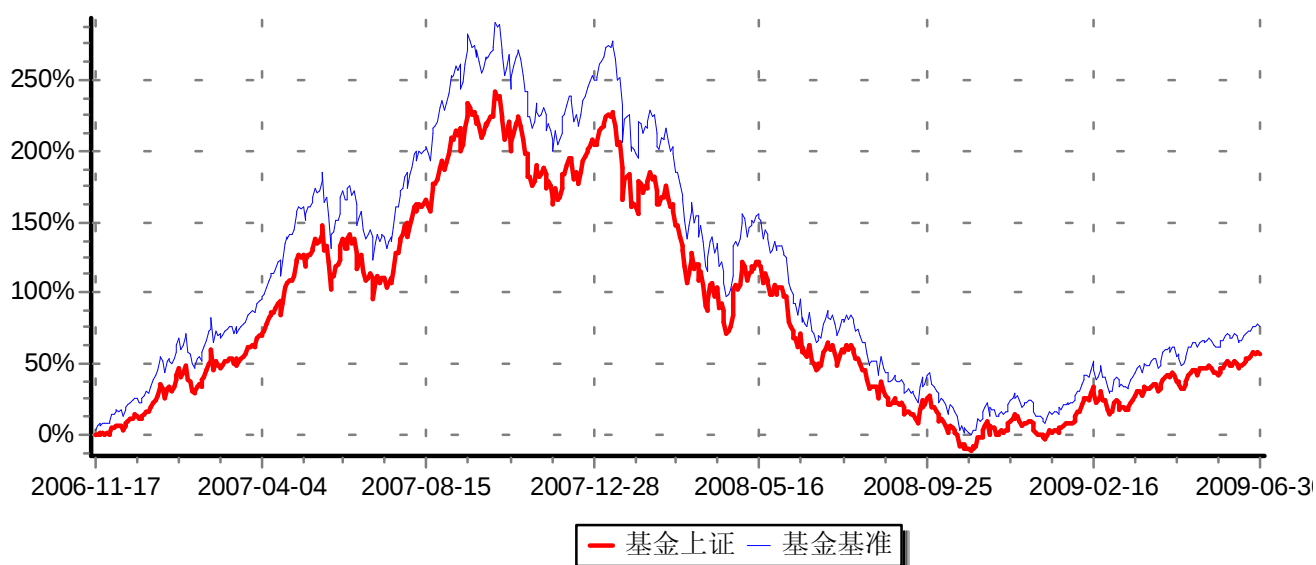
友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

过去一个月	9.39%	1.19%	8.69%	1.20%	0.70%	-0.01%
过去三个月	19.08%	1.59%	18.36%	1.59%	0.72%	—
过去六个月	62.74%	2.02%	62.27%	2.03%	0.47%	-0.01%
过去一年	4.22%	2.60%	3.20%	2.61%	1.02%	-0.01%
自基金合同生效日起 至今（2006年11月17 日-2009年06月30日）	56.90%	2.75%	76.08%	2.78%	-19.18%	-0.03%

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



注：图示日期为2006年11月17日至2009年6月30日。

按基金合同规定，本基金自基金合同生效起3个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十六条（二）投资范围及投资比例中规定的比例，即投资于指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的95%。

§ 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

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。目前的股东构成为AIG Global Investment Corp.、华泰证券股份有限公司和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资额分别为49%、49%和2%。目前公司旗下管理友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、友邦华泰积极成长混合型证券投资基金、友邦华泰价值增长股票型证券投资基金和友邦华泰货币市场基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

		任职日期	离任日期	业年限	
张娅	本基金的基金经理	2006年11月17日	—	5年	张娅女士，美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验。曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作，2004年初加入友邦华泰基金管理有限公司，从事投资研究和金融工程工作，2006年11月起任友邦华泰上证红利交易型开放式指数基金基金经理。
柳军	本基金的基金经理	2009年06月04日	—	9年	柳军先生，复旦大学财务管理硕士，曾在上海汽车集团财务有限公司、华安基金管理有限公司工作，2004年7月起加入友邦华泰基金管理有限公司，2005年12月起担任研究员兼基金事务部总监，主要从事ETF产品研发及基金事务管理工作。2009年6月起任友邦华泰上证红利交易型开放式指数基金基金经理。

注：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。任职日期指基金管理人作出决定之日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，通过科学完善的制度及流程，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能的利益输送。首先投资部和研究部通过规范的决策流程来确保公平对待不同投资组合。其次集中交易室对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，在交易过程中启用投资交易系统内的公平交易模块，确保公平交易的实施。同时，风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

09年上半年，市场在犹豫中进入了确定性的上升趋势。上半年，上证红利指数的累积涨幅为62.27%，沪深300指数的累积涨幅为74%。

上半年市场的系统性上行主要分为两个阶段：第一阶段的动力引擎主要源自

流动性推动、政府政策触发以及企业库存回补背景下的中小板行情，其中新能源股票表现尤其优异；第二阶段是源自房地产市场景气复苏带来的、以大金融板块为龙头的早期主流行情。

红利指数基于其低估值的风格特征，充分受益于第一阶段的流动性推动行情，超额收益较为明显；在第二阶段的行情趋势中，超额收益的板块主要在于房产、汽车等先导行业以及银行等大金融板块，以投资链条上中游行业为主的红利指数表现基本与大盘同步，略逊于以先导和大金融行业为主要行业。这是不同市场阶段行业轮动的客观结果。

2009年上半年，我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。该期间内，本基金的累计跟踪偏离为0.72%，日均跟踪偏离度的绝对值为0.03%，期间日跟踪误差为0.05%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来A股市场，基于我们上述：“市场系统性持续上升的根本动力来源于引领实体经济持续复苏的动力引擎在时间窗口上的超预期顺利衔接，未来市场是否能够持续上行的根本也是在于市场对复苏动力持续性预期的强弱”的分析逻辑：

尽管大概率下，三季度房产市场的销量会在价格过快上涨以及二套房有所收紧的政策导向下有所回落使得整体板块有所压制，但在市场对于政府最终政策导向预期尚未发生趋势性转向、加之流动性乘数逐渐放大、通胀未起、以及房产投资增速提速带来的景气上传的惯性作用下，市场上升趋势应未发生根本变化，而海外市场3季度的大概率企稳甚至可能是超预期企稳，都或将成为引领市场继续向上的惊喜动力，预期未来随着逐渐对中游行业景气拉动效应的体现，并伴随PPI下半年的触底反弹，或将迎来红利ETF较好的超额收益收获期。

但同时，我们也认为随着经济复苏信号愈加明确，三季度往后看，未来市场预期将面临更大的震荡。风险因素一方面来自市场对于政策转向的预期，另一方面来自于房产实体景气的波动。原则上，我们认为，实质通胀水平未超过3%的任何紧缩政策信号都将带来市场在高估值水平上的大幅波动，而不会逆转市场的趋势，反之亦然，但同时值得强调的是，如果三季度，房价或者出口这两个实体终端发动机不出现新一轮明显的景气上升趋势，市场整体可能处于上下震荡的可能性较大，只有当新一轮终端需求景气上升信号明确之后，市场才会有动力再次突破。换言之，在实际通胀以及实质性紧缩政策出现之前，市场对于每次政策转向预期的消化力度将取决于当时实体层面，特别是实体终端需求层面是否能够发出持续景气上行的信号。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制、金融工程和基金事务部门负责人，基金经理（除投资总监外）不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，方可进行收益分配。截至本报告期末，本基金自基金份额折算日以来的累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到1%以上，符合分红条件，对超额收益部分进行了收益分配。本基金于2009年3月18日刊登收益分配公告，每10份基金份额派发现金红利0.240元，权益登记日：2009年3月23日，除息日：2009年3月24日，红利发放日：2009年3月30日。

§ 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

托管人声明，在本报告期内，基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同，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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2009年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	43,124,086.80	19,847,271.44
结算备付金		1,034,625.37	1,534,275.23

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	3,841,743,082.20	2,318,941,098.97
其中：股票投资		3,841,743,082.20	2,318,941,098.97
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	394,017.36
应收利息	6.4.7.5	8,318.97	3,743.63
应收股利		820,169.28	—
应收申购款		—	—
其他资产	6.4.7.6	61,847.76	—
资产总计		3,886,792,130.38	2,340,720,406.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年06月30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		5,557,901.59	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		1,402,475.44	1,150,827.13
应付托管费		280,495.07	230,165.42
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	285,251.30	802,442.77
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
其他负债	6.4.7.8	2,021,292.45	1,038,740.88
负债合计		9,547,415.85	3,222,176.20
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,502,255,402.53	2,425,189,006.67
未分配利润	6.4.7.10	1,374,989,312.00	-87,690,776.24
所有者权益合计		3,877,244,714.53	2,337,498,230.43
负债和所有者权益总计		3,886,792,130.38	2,340,720,406.63

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值2.365元，基金份额总额1,639,675,703份。

6.2 利润表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2009年01月01日 -2009年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008 年06月30日
一、收入		1,354,039,156.82	-3,798,995,388.56
1.利息收入		95,683.38	230,687.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	94,110.38	201,648.66
债券利息收入		—	4,833.98
资产支持证券利息收 入		—	—
买入返售金融资产收 入		1,573.00	24,205.00
2.投资收益（损失以“-”填 列）		235,131,893.06	-1,466,197,085.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	203,813,268.89	-1,546,164,488.14
债券投资收益	6.4.7.13	—	630,844.47
资产支持证券投资收 益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	1,729,370.20
股利收益	6.4.7.15	31,318,624.17	77,607,187.97
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	1,114,056,666.11	-2,331,601,178.69
4.其他收入（损失以“-”号 填列）	6.4.7.17	4,754,914.27	-1,427,812.01
二、费用（以“-”号填列）		-9,544,547.52	-28,722,597.24
1. 管理人报酬		-7,110,181.43	-14,375,539.12
2. 托管费		-1,422,036.28	-2,875,107.88
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.18	-734,669.36	-11,219,917.68
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支 出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.19	-277,660.45	-252,032.56
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		1,344,494,609.30	-3,827,717,985.80

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：上证红利交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期2009年01月01日-2009年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	2,425,189,006.67	-87,690,776.24	2,337,498,230.43
二、本期经营活动产生	—	1,344,494,609.30	1,344,494,609.30

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

的基金净值变动数			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	77,066,395.86	149,893,687.46	226,960,083.32
其中：1. 基金申购款	17,502,465,372.24	5,757,344,415.47	23,259,809,787.71
2. 基金赎回款	-17,425,398,976.38	-5,607,450,728.01	-23,032,849,704.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-31,708,208.52	-31,708,208.52
五、期末所有者权益（基金净值）	2,502,255,402.53	1,374,989,312.00	3,877,244,714.53
项 目	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	2,190,937,682.68	4,468,510,665.94	6,659,448,348.62
二、本期经营活动产生的基金净值变动数	—	-3,827,717,985.80	-3,827,717,985.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	398,303,554.20	667,774,785.56	1,066,078,339.76
其中：1. 基金申购款	3,513,769,859.88	4,179,355,018.84	7,693,124,878.72
2. 基金赎回款	-3,115,466,305.68	-3,511,580,233.28	-6,627,046,538.96
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	2,589,241,236.88	1,308,567,465.70	3,897,808,702.58

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

上证红利交易型开放式指数证券投资基金(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196号《关于同意上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》核准，由友邦华泰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《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式，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2,222,962,819.00元(含募集股票市值)，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170号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2006年11月17日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为2,222,985,094.00份基金份额，其中认购资金利息折合22,275.00份基金份额。本基金的基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于2007年1月10日进行了基金份额折算，折算比例为0.65527799，并于2007年1月11日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称"上交所")上证债字[2007]第4号文审核同意，本基金

1,456,675,703份基金份额于2007年1月18日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的主要投资范围为标的指数成份股和备选成份股，该部分资产比例不低于基金资产净值的95%；同时为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，该部分资产比例不高于基金资产净值的5%。本基金的业绩基准为上证红利指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、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》、《上证红利交易型开放式指数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所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2009年6月30日的财务状况以及2009年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估值与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a)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。

(b)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。

(c)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。

(d)基金买卖股票于2008年4月24日之前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税，自

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

2008年4月24日起至2008年9月18日止按0.1%的税率缴纳。自2008年9月19日起基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009年06月30日
活期存款	43,124,086.80
合计	43,124,086.80

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009年06月30日		
		成本	公允价值	估值增值
股票		3,660,963,418.05	3,841,743,082.20	180,779,664.15
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		3,660,963,418.05	3,841,743,082.20	180,779,664.15

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年06月30日
应收活期存款利息	7,956.87
应收结算备付金利息	362.10
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	—
合计	8,318.97

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年06月30日
其他应收款	—
待摊费用	61,847.76
合计	61,847.76

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009年06月30日
交易所市场应付交易费用	285,251.30
银行间市场应付交易费用	—
合计	285,251.30

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提审计费	52,564.21
预提信息披露费	348,765.71
预提上市费	29,752.78
可退替代款	660,648.94
应付替代款	929,560.81
合计	2,021,292.45

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2009年01月01日 - 2009年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,589,175,703.00	2,425,189,006.67
本期申购	11,469,000,000.00	17,502,465,372.24
本期赎回	-11,418,500,000.00	-17,425,398,976.38
本期末	1,639,675,703.00	2,502,255,402.53

6.4.7.10 未分配利润

金额单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

上年度末	985,260,036.60	-1,072,950,812.84	-87,690,776.24
本期利润	230,437,943.19	1,114,056,666.11	1,344,494,609.30
本期基金份额交易产生的变动数	50,303,813.78	99,589,873.68	149,893,687.46
其中：基金申购款	5,892,016,968.70	-134,672,553.23	5,757,344,415.47
基金赎回款	-5,841,713,154.92	234,262,426.91	-5,607,450,728.01
本期已分配利润	-31,708,208.52	—	-31,708,208.52
本期末	1,234,293,585.05	140,695,726.95	1,374,989,312.00

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2009年01月01日-2009年06月30日
活期存款利息收入	84,502.85
结算备付金利息收入	9,607.53
其他	—
合计	94,110.38

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2009年01月01日-2009年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-20,300,749.24
股票投资收益——赎回差价收入	224,114,018.13
合计	203,813,268.89

注：

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
卖出股票成交总额	93,058,482.58
卖出股票成本总额	-113,359,231.82
买卖股票差价收入	-20,300,749.24

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
赎回基金份额对价总额	23,032,849,704.39
现金支付赎回款总额	-15,939,641.39
赎回股票成本总额	-22,792,796,044.87

赎回差价收入	224,114,018.13
--------	----------------

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日 - 2009年06月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交金额	—
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	—
应收利息总额	—
债券投资收益	—

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内未取得衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日 - 2009年06月30日
股票投资产生的股利收益	31,318,624.17
基金投资产生的股利收益	—
合计	31,318,624.17

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日 - 2009年06月30日
1.交易性金融资产	1,114,056,666.11
——股票投资	1,114,056,666.11
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	1,114,056,666.11

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日 - 2009年06月30日
----	---------------------------------

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

基金赎回费收入	—
替代损益	4,754,914.27
合计	4,754,914.27

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
交易所市场交易费用	734,669.36
银行间市场交易费用	—
合计	734,669.36

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
审计费用	52,564.21
信息披露费	148,765.71
银行划款手续费	4,300.88
上市费	29,752.78
分红手续费	33,276.87
银行间账户服务费	9,000.00
合计	277,660.45

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，关联方关系未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
友邦华泰基金管理有限公司	基金管理人
招商银行股份有限公司	基金托管人
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、一级交易商

注：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日		上年度可比期间 2008年01月01日-2008年06月30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
华泰证券股份有限公司	341,675,416.93	56.61%	1,890,833,047.08	65.78%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未发生权证交易。

6.4.10.1.3 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01月01日-2009年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
华泰证券股份有限公司	290,423.83	56.61%	245,812.28	86.17%
关联方名称	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
华泰证券股份有限公司	1,607,183.60	65.78%	—	—

注：上述佣金按股票交易量的千分之一计算，以扣除证管费、经手费后的净额列示。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。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年06月30日
当期应支付的管理费	7,110,181.43	14,375,539.12
其中：当期已支付	5,707,705.99	12,558,701.68
期末未支付	1,402,475.44	1,816,837.44

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的0.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

H为每日应支付的管理人报酬

E为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月 30日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年06月 30日
当期应支付的托管费	1,422,036.28	2,875,107.88
其中：当期已支付	1,141,541.21	2,511,740.39
期末未支付	280,495.07	363,367.49

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的0.10%的年费率计提，计算方法如下：

$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$

H为每日应支付的托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内以及上年度可比期间内均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内以及上年度可比期间内，基金管理公司未投资本基金。

6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年06月30日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
华泰证券股份 有限公司	—	—	29.00	—

注：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 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01月01日-2009年06月30 日		上年度可比期间 2008年01月01日-2008年06月30 日	
	期末 存款余额	当期 存款利息收入	期末 存款余额	当期 存款利息收入

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

招商银行股份有限公司	43,124,086.80	84,502.85	39,444,112.95	170,705.31
------------	---------------	-----------	---------------	------------

注：本报告期，基金托管人招商银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内以及去年同期内未在承销期参与关联方承销证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放	再投资形式发放	利润分配合计
	2009-03-23	2009-03-24	0.240	31,708,208.52		31,708,208.52
合计			0.240	31,708,208.52		31,708,208.52

6.4.12 期末（2009年06月30日）本基金持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发而于期末流通受限的证券。

6.4.12.1 期末持有的暂时停牌股票

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	期末成本总额	期末估值总额
600153	建发股份	2009-06-30	召开2008年度股东大会	13.53	2009-07-01	13.48	5,614,123	69,073,545.03	75,959,084.19

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型股票基金，采用完全复制策略，跟踪上证红利指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。同时，本基金相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风

险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，因此违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险主要来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

此外，由于本基金的申购赎回采用股票交付方式进行，申购赎回对本基金的流动性风险影响小。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为三个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，适用于本基金的市场风险包括利率风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2009年06月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	43,124,086.80						43,124,086.80
结算备付金	1,034,625.37						1,034,625.37
存出保证金							
股票投资						3,841,743,082.20	3,841,743,082.20
债券投资							
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							
应收利息						8,318.97	8,318.97
应收股利						820,169.28	820,169.28
应收申购							

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

款							
其他资产						61,847.76	61,847.76
资产总计	44,158,712.17	—	—	—	—	3,842,633,418.21	3,886,792,130.38
负债							
短期借款							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款						5,557,901.59	5,557,901.59
应付赎回款							
应付管理人报酬						1,402,475.44	1,402,475.44
应付托管费						280,495.07	280,495.07
应付销售服务费							
应付交易费用						285,251.30	285,251.30
应交税费							
应付利息							
应付利润							
其他负债						2,021,292.45	2,021,292.45
负债总计	—	—	—	—	—	9,547,415.85	9,547,415.85
利率敏感	44,158,712.17	—	—	—	—	3,833,086,002.36	3,877,244,714.53

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

度缺 口							
上年 度末 2008 年12 月31 日	1个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,847,271.44						19,847,271.44
结算 备付 金	1,534,275.23						1,534,275.23
存出 保证 金							
股票 投资						2,318,941,098.97	2,318,941,098.97
债券 投资							
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						394,017.36	394,017.36
应收 利息						3,743.63	3,743.63
应收 股利							
应收 申购 款							
其他 资产							
资产	21,381,546.67	—	—	—	—	2,319,338,859.96	2,340,720,406.63

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

总计							
负债							
短期借款							
卖出回购金融资产款							
应付证券清算款							
应付赎回款							
应付管理人报酬						1,150,827.13	1,150,827.13
应付托管费						230,165.42	230,165.42
应付销售服务费							
应付交易费用						802,442.77	802,442.77
应交税费							
应付利息							
应付利润							
其他负债						1,038,740.88	1,038,740.88
负债总计	—	—	—	—	—	3,222,176.20	3,222,176.20
利率敏感度缺口	21,381,546.67	—	—	—	—	2,316,116,683.76	2,337,498,230.43

注：各期限分类的标准按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至2009年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2008年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

本基金投资组合中股票投资比例为不低于基金资产的95%。于2009年6月30日，本基金面临的整体其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	3,841,743,082.20	99.08	2,318,941,098.97	99.21
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	3,841,743,082.20	99.08	2,318,941,098.97	99.21

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币亿元）	
		本期末	上年度末
	上证红利指数上涨5%	1.79	1.11
	上证红利指数下跌5%	-1.79	-1.11

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,841,743,082.20	98.84
	其中：股票	3,841,743,082.20	98.84
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	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	44,158,712.17	1.14
6	其他资产	890,336.01	0.02
7	合计	3,886,792,130.38	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	68,400,377.72	1.76
B	采掘业	616,244,116.66	15.89
C	制造业	1,596,473,492.60	41.18
C0	食品、饮料	45,917,931.93	1.18
C1	纺织、服装、皮毛	138,790,009.17	3.58
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	129,063,061.25	3.33
C5	电子	—	—
C6	金属、非金属	903,128,084.54	23.29
C7	机械、设备、仪表	256,154,593.06	6.61
C8	医药、生物制品	85,119,635.79	2.20
C99	其他制造业	38,300,176.86	0.99
D	电力、煤气及水的生产和供应业	390,544,623.79	10.07
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	552,511,124.84	14.25
G	信息技术业	65,605,806.35	1.69
H	批发和零售贸易	143,007,879.63	3.69
I	金融、保险业	197,458,428.09	5.09

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

J	房地产业	103,041,979.38	2.66
K	社会服务业	108,432,940.42	2.80
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	—	—
	合计	3,841,720,769.48	99.08

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600028	中国石化	32,933,214	351,068,061.24	9.05
2	601006	大秦铁路	30,961,129	327,878,356.11	8.46
3	600019	宝钢股份	41,540,931	292,448,154.24	7.54
4	600015	华夏银行	15,758,853	197,458,428.09	5.09
5	600005	武钢股份	24,937,789	196,509,777.32	5.07
6	600011	华能国际	21,419,412	170,498,519.52	4.40
7	600104	上海汽车	10,391,251	155,349,202.45	4.01
8	600177	雅戈尔	8,731,684	120,409,922.36	3.11
9	600348	国阳新能	3,778,340	114,710,402.40	2.96
10	600642	申能股份	11,417,406	112,575,623.16	2.90
11	600808	马钢股份	18,858,940	91,277,269.60	2.35
12	600997	开滦股份	4,823,770	90,156,261.30	2.33
13	600001	邯郸钢铁	15,567,951	86,713,487.07	2.24
14	600196	复星医药	5,874,371	85,119,635.79	2.20
15	600010	包钢股份	20,281,090	80,313,116.40	2.07
16	600331	宏达股份	4,862,073	77,258,339.97	1.99
17	600153	建发股份	5,614,123	75,959,084.19	1.96
18	600598	北大荒	5,373,164	68,400,377.72	1.76
19	600500	中化国际	5,643,838	67,048,795.44	1.73
20	600026	中海发展	4,955,107	63,970,431.37	1.65
21	600497	驰宏锌锗	3,047,468	60,309,391.72	1.56
22	600428	中远航运	5,139,728	53,298,979.36	1.37
23	600096	云天化	2,316,848	51,804,721.28	1.34
24	600886	国投电力	4,963,017	51,764,267.31	1.34
25	600008	首创股份	6,913,490	45,283,359.50	1.17
26	600022	济南钢铁	9,847,477	44,806,020.35	1.16
27	600087	长航油运	6,425,372	39,773,052.68	1.03
28	600210	紫江企业	6,827,126	38,300,176.86	0.99
29	600064	南京高科	1,910,031	37,131,002.64	0.96
30	600307	酒钢宏兴	2,711,550	36,849,964.50	0.95
31	600588	用友软件	1,913,221	36,332,066.79	0.94

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

32	600418	江淮汽车	6,111,105	35,749,964.25	0.92
33	600066	宇通客车	2,887,494	35,400,676.44	0.91
34	600533	栖霞建设	4,949,916	34,154,420.40	0.88
35	600236	桂冠电力	4,226,287	33,472,193.04	0.86
36	600569	安阳钢铁	7,535,750	33,458,730.00	0.86
37	600098	广州控股	4,892,390	31,800,535.00	0.82
38	600641	万业企业	3,169,317	31,756,556.34	0.82
39	600033	福建高速	4,669,684	31,286,882.80	0.81
40	600350	山东高速	5,280,674	29,677,387.88	0.77
41	600006	东风汽车	6,282,786	29,654,749.92	0.76
42	600621	上海金陵	3,311,509	29,273,739.56	0.76
43	600300	维维股份	5,121,852	26,582,411.88	0.69
44	600102	莱钢股份	2,200,664	24,229,310.64	0.62
45	600863	内蒙华电	4,687,388	23,905,678.80	0.62
46	600270	外运发展	2,871,441	22,971,528.00	0.59
47	600059	古越龙山	2,630,683	19,335,520.05	0.50
48	600626	申达股份	2,621,981	18,380,086.81	0.47
49	600126	杭钢股份	2,656,311	16,522,254.42	0.43
50	600548	深高速	2,267,329	13,331,894.52	0.34

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601006	大秦铁路	56,846,290.44	2.43
2	600005	武钢股份	29,514,870.28	1.26
3	600019	宝钢股份	25,885,914.43	1.11
4	600028	中国石化	21,975,275.03	0.94
5	600331	宏达股份	20,542,230.33	0.88
6	600196	复星医药	17,601,590.88	0.75
7	600863	内蒙华电	16,282,511.51	0.70
8	600096	云天化	16,072,484.92	0.69
9	600026	中海发展	15,669,588.65	0.67
10	600153	建发股份	14,853,880.60	0.64
11	600642	申能股份	14,758,399.15	0.63
12	600015	华夏银行	13,845,581.38	0.59
13	600997	开滦股份	13,439,658.64	0.57
14	600497	驰宏锌锗	12,730,709.94	0.54
15	600177	雅戈尔	12,503,145.30	0.53
16	600236	桂冠电力	11,955,549.51	0.51

17	600886	国投电力	11,285,240.98	0.48
18	600011	华能国际	11,281,381.87	0.48
19	600307	酒钢宏兴	10,947,557.10	0.47
20	600008	首创股份	10,196,577.97	0.44

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600005	武钢股份	10,536,352.00	0.45
2	600028	中国石化	8,657,567.59	0.37
3	600019	宝钢股份	7,156,989.64	0.31
4	600196	复星医药	4,811,134.28	0.21
5	600011	华能国际	4,204,355.80	0.18
6	601006	大秦铁路	3,706,158.00	0.16
7	600015	华夏银行	3,462,793.88	0.15
8	600508	上海能源	2,258,383.95	0.10
9	600177	雅戈尔	2,042,991.96	0.09
10	600642	申能股份	2,029,797.62	0.09
11	600001	邯郸钢铁	1,950,290.83	0.08
12	600104	上海汽车	1,949,480.62	0.08
13	600581	八一钢铁	1,810,932.68	0.08
14	600282	南钢股份	1,765,481.52	0.08
15	600202	哈空调	1,733,255.74	0.07
16	600236	桂冠电力	1,679,797.08	0.07
17	600021	上海电力	1,678,192.28	0.07
18	600598	北大荒	1,676,951.64	0.07
19	600808	马钢股份	1,662,569.84	0.07
20	600098	广州控股	1,587,896.11	0.07

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	510,477,784.65
卖出股票的收入（成交）总额	93,058,482.58

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—

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	—	—

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 报告期内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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

7.9.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

7.9.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	820,169.28
4	应收利息	8,318.97
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	其他	61,847.76
8	合计	890,336.01

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
67,519	24,285.00	875,895,228.00	53.42%	763,780,475.00	46.58%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	180,999,698.00	11.04%
2	中国平安保险（集团）股份有限公司	50,000,000.00	3.05%
3	合众人寿保险股份有限公司-传统-普通保险产品	48,059,355.00	2.93%
4	中国平安人寿保险股份有限公司-投连-个险投连	45,184,350.00	2.76%
5	中国人寿保险（集团）公司	40,000,000.00	2.44%
6	嘉禾人寿保险股份有限公司	37,000,000.00	2.26%
7	中国太平洋人寿保险股份有限公司-分红-个人分红	35,000,000.00	2.13%
8	中国人寿财产保险股份有限公司-传统-普通保险产品	30,913,300.00	1.89%
9	国信-中行-“金理财”经典组合基金集合资产管理计划	20,896,540.00	1.27%
10	平安信托投资有限责任公司-华夏平安福1号单-资金信托	19,520,101.00	1.19%

注：

8.3 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
----	-----------	----------

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

基金管理公司所有从业人员持有本 开放式基金	—	—
--------------------------	---	---

本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,589,175,703.00
报告期期间基金总申购份额	11,469,000,000.00
报告期期间基金总赎回份额	11,418,500,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	1,639,675,703.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门均无重大人事变动。

10.3 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、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。该事务所已向本基金提供了3年的审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

					例				例		
华泰证券	1	341,675,416.93	56.61%		—		—		—	290,423.83	56.61%
银河证券	1	261,860,850.30	43.39%		—	45,000,000.00	100.00%		—	222,582.81	43.39%

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准

1) 资金雄厚，信誉良好。

2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚。

3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。

4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息。

5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人或被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	上证红利交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书2009年第1号	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-06-29
2	上证红利交易型开放式指数证券投资基金更新的招募说明书2009年第1号（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-06-29
3	关于增加友邦华泰上证红利交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-06-11
4	友邦华泰关于增加上证红利交易型开放式指数基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-06-04
5	上证红利交易型开放式指数证券投资基金2009年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-04-22
6	友邦华泰基金管理有限公司关于变更注册地址的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-03-31
7	上证红利交易型开放式指数证券投资基金2008年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-03-28
8	上证红利交易型开放式指数证券投资基金2008年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-03-28
9	友邦华泰关于上证红利交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-03-18
10	友邦华泰关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-02-05

11	上证红利交易型开放式指数证券投资基金2008年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-01-21
12	关于宏源证券办理友邦华泰上证红利ETF基金的申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-01-07

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准上证红利交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《上证红利交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、上证红利交易型开放式指数证券投资基金的公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。
投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人友邦华泰基金管理有限公司。
客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638
公司网址：www.aig-huatai.com

友邦华泰基金管理有限公司
2009-08-26