
友邦华泰行业领先股票型证券投资基金 2009 年年度报告

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2010 年 03 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 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，投资者在做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 8 月 3 日（基金合同生效日）起至 2009 年 12 月 31 日止。

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 其它相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告/半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
§ 7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§ 8 投资组合报告	32
8.1 期末基金资产组合情况	32
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	33
8.3 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	34
8.4 报告期内权益投资组合的重大变动	40
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42
8.7 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	42
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	42
8.9 投资组合报告附注	42

§ 9 基金份额持有人信息	43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
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	43
§ 10 开放式基金份额变动	43
§ 11 重大事件揭示	44
11.1 基金份额持有人大会决议	44
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	44
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	44
11.4 基金投资策略的改变	44
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	44
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	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	44
11.8 其它重大事件	45
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	48
§ 13 备查文件目录	48
13.1 备查文件目录	48
13.2 存放地点	48
13.3 查阅方式	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金
基金简称	友邦华泰行业领先股票
基金主代码	460007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 08 月 03 日
基金管理人	友邦华泰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,831,069,536.62
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过采取自上而下和自下而上相结合的方法，从定量和定性的角度把握不同时期所蕴含的行业和个股投资机会，在充分控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	大类资产配置不作为本基金的核心策略。考虑到中国大陆 A 股市场现阶段仍存在较大的系统性风险，本基金将仅在股票资产整体出现较大程度高估或低估时进行适度的大类资产配置调整，一般情况下本基金将保持大类资产配置的基本稳定。本基金在股票投资中注重自上而下的行业配置，即以行业估值为基础，以行业基本面趋势变化为契机，结合国家产业政策的导向，在不同备选之间合理配置基金资产。
业绩比较基准（若有）	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征（若有）	较高风险、较高收益

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	蒋松云
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路	北京市西城区复兴门内大街 55

	1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层	号
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	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	200135	100140
法定代表人	齐亮	姜建清

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
登载基金年度报告/半年度报告正文的 管理人互联网网址	http://www.aig-huatai.com
基金年度报告/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 其它相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	友邦华泰基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年 8 月 3 日-2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-422,352,408.29
本期利润	-383,257,490.33
加权平均基金份额本期利润	-0.1833
本期加权平均净值利润率	-22.26%
本期基金份额净值增长率	-16.60%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年 8 月 3 日-2009 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	-348,439,545.89
期末可供分配基金份额利润	-0.1903
期末基金资产净值	1,527,307,459.66
期末基金份额净值	0.8340
3.1.3 累计期末指标	2009 年 8 月 3 日-2009 年 12 月 31 日
基金份额累计净值增长率	-16.60%

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、基金合同生效日为 2009 年 8 月 3 日，2009 年的主要财务指标根据当年的实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

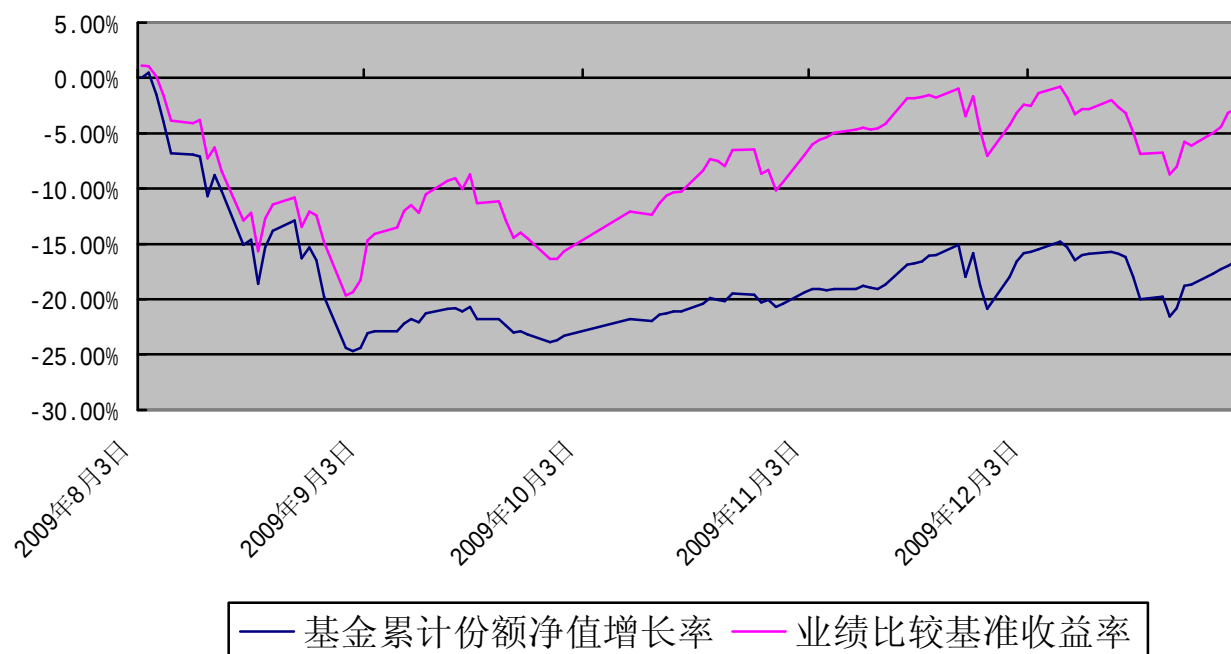
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.74%	1.30%	15.21%	1.41%	-6.47%	-0.11%
过去六个月	—	—	—	—	—	—
过去一年	—	—	—	—	—	—
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起至今	-16.60%	1.69%	-2.82%	1.75%	-13.78%	-0.06%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数、上证国债指数和同业存款利率按照 80%、15%和 5%之比构建，并每日进行再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

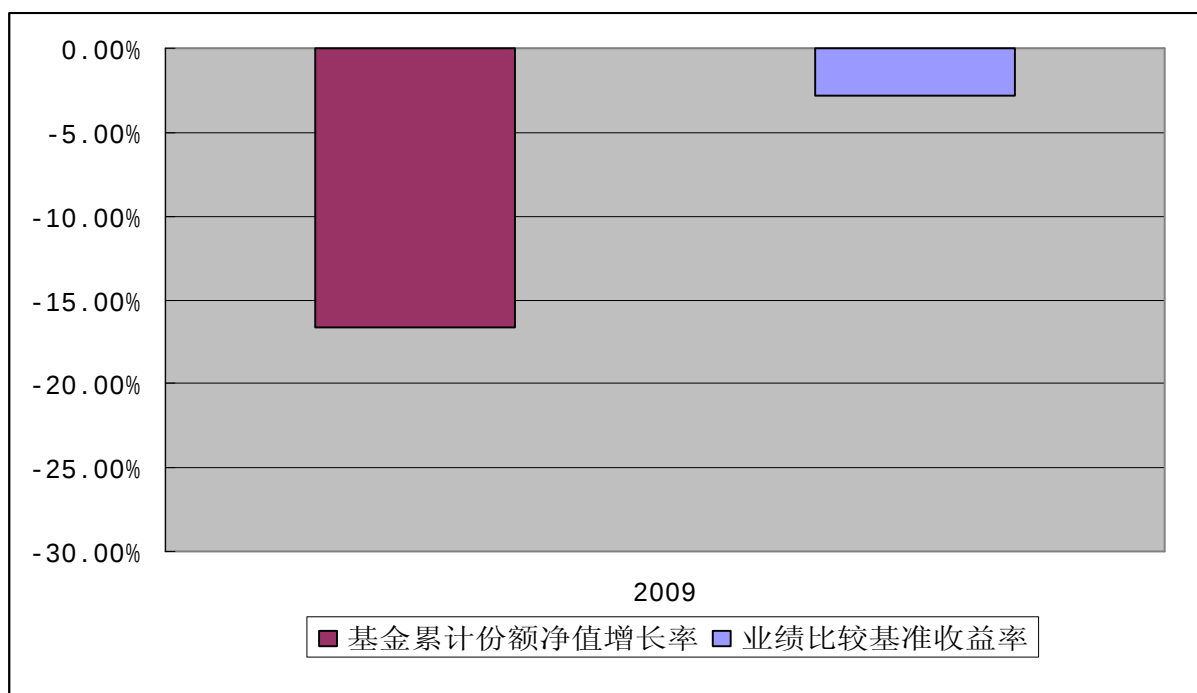
基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2009 年 8 月 3 日至 2009 年 12 月 31 日。

- 1、本基金基金合同生效日为 2009 年 8 月 3 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。
- 2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，各项资产配置比例符合合同规定。

3.2.3 自基金合同生效以来每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效日为 2009 年 8 月 3 日，2009 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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。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、友邦华泰货币市场证券投资基金、友邦华泰行业领先股票型证券投资基金。截至 2009 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 220.68 亿元。

注：公司外方股东 AIG Global Investment Corp. (美国国际集团投资股份有限公司或简称“AIGGIC”)因重组原因，已于 2009 年 12 月 31 日并入 PineBridge Investments LLC (柏瑞投资有限责任公司或简称“PineBridge Investments”)，因此 AIGGIC 的名称变为“PineBridge Investments LLC”。公司已将外方股东的上述变动情况及股东更名报告材料上报中国证监会，目前尚待批准。

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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
梁丰	本基金基金经理	2009年08月03日	-	16	梁丰先生，经济学硕士。历任中信集团中大投资管理有限公司证券投资部总经理、总经理助理、中信基金股权投资部总监、2004年3月至2006年1月任中信经典配置基金的基金经理，2005年11月至2007

					年 4 月任中信红利精选股票基金的基金经理。2007 年 4 月加入友邦华泰基金管理有限公司，2007 年 7 月 26 日至 2009 年 11 月 18 日任友邦盛世基金经理，2009 年 8 月 3 日起任友邦行业基金经理。
吕慧建	本基金基金经理	2009 年 11 月 18 日	-	12	吕慧建先生，1992 年毕业于中国金融学院金融专业，1998 年获新加坡国立大学 MBA 学位。曾就职于深圳发展银行；1998 年 7 月至 2003 年 1 月历任中信集团中大投资管理有限责任公司高级证券分析师、上海业务总部副总、董事会秘书；2003 年 2 月至 2007 年 6 月期间在中信基金管理有限公司分别担任营销总监及行业研究员；2007 年 6 月加入我公司，担任高级研究员，2007 年 11 月起任基金经理助理，自 2009 年 11 月起担任友邦华泰行业领先基金的基金经理。

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公司作出决定之日。

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《友邦华泰行业领先股票型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 本投资组合与其它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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2009 年，受益于四万亿政府投资、产业振兴规划等积极财政政策和宽松的货币政策，中国经济表现出 V 型反转走势，经济数据逐季回升，全年 GDP 增长 8.7%。其中，投资贡献最大拉动 GDP 增长约 8.0%。消费拉动 GDP 增长约 4.6%。

经济复苏，积极宽松的货币信贷政策功不可没，09 年四个季度的人民币新增贷款金额分别达到了 4.58 万亿、2.79 万亿、1.3 万亿、0.92 万亿，累计投放额达到 9.59 万亿。

超预期的经济走势和充足的流动性共同推动了资产价格的大幅上扬。沪深 300 指数从年初的 1848 点最高上涨到 8 月初的 3803 点，最高涨幅 106%，年底收于 3576 点，年涨幅约 96.71%。

本基金成立于 09 年 8 月 3 日，沪深 300 前收盘价为 3735 点成立初期受股市上涨的惯性思维影响，建仓速度较快，造成较大净值损失。在检讨市场判断、操作策略的基础上，本基金充分利用公司投研团队支持，重新调整了投资策略，并在 11 月份对仓位和持股结构进行调整，净值表现有所改善。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.834 元，本报告期份额净值增长率为 -16.60%，同期业

绩比较基准增长率为-2.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

美国次债危机爆发是一个标志性事件，是各种矛盾积累、加剧到不可调和的结果。危机标志着世界经济体系面临调整，资源国-生产国-消费国的分工体系存在重建的可能。

2009年，全球各国在刺激经济政策上取得了前所未有的一致意见。现在，世界经济之船已经稳定，各国政府开始考虑政策的调整。中国也到了“凝聚共识、重启改革”的新阶段。我们需要寻找保持经济持续、稳定增长，促进社会和谐与发展的新路径。

中国的A股市场在外部经济、政策环境面临变化的同时，本身也产生了巨大的变化。首先，2010年将进入股改后全流通的新阶段。这意味着产业资本对于A股市场的定价有极大的发言权。股市期货、融资融券有望在2010年上半年推出，意味着A股市场的估值加入了新因素。

股改完成后，管理层对于A股市场的定位也发生了根本性变化，大力推动直接融资，把直接融资作为支持小企业、推动产业结构调整的新推手。在这种背景下，A股市场的融资规模快速回升，09年12月A股融资达到1180亿元，为历史第三高月份；09年四季度累计融资2200亿元，仅次于07年的第四季度（3100亿元）、第三季度（2800亿元）。

当然，展望2010年，我们也看到了很多积极的因素。09年中国房地产、汽车销售均创出新高，中国农村消费有望进入加速增长的新阶段，内需表现出强劲的韧性，我们预期中国的城市化进程将延续，消费有望在2010年以致更长的时间内继续推动中国经济增长；2009年中国虽然出口金额出现下滑，但重要产品的市场占有率进一步提高，表明中国制造业在危机中全球竞争力不但没有下滑，而且有所提升。

我们预计2010年A股市场盈利有望保持健康增长。目前沪深300估值09年PE约20倍，考虑到2010年相对确定的盈利增长，估值尚属合理。但是，市场估值差异较大，中小板综合指数PE(TTM)约40倍，中证500的PE(TTM)约60倍。

2010年，复杂的投资环境将加大投资管理的难度。我们要避免大起大落式的过分悲观和过分乐观，保持相对较为均衡、稳定的投资策略来应对复杂局面。从全年跨度看，我们相对看好消费品行业的盈利增长机会，关注新产业、新技术、新的商业模式带来的投资机会。对于周期性行业，我们认为仍有可能具有良好的阶段性机会。

本基金在前期净值表现落后基准，管理人表示诚挚歉意！我们将勤勉尽责，努力为投资者信任贡献回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2009年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1)全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措

施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司投资研究业务、公司自有资金投资、投资人员管理、基金销售、市场宣传、员工投资基金合规情况等项目的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3)促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4)通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 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。

4.8 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，在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益分配每年至多 4 次；每次分配比例不低于基金期末可分配利润的 10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。报告期内基金未实施收益分配。截至本报告期末，本基金可分配收益为负。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009 年, 本基金托管人在对友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的托管过程中, 严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定, 不存在任何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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年, 友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的管理人——友邦华泰基金管理有限公司在友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、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, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告/半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对友邦华泰基金管理有限公司编制和披露的友邦华泰行业领先股票型证券投资基金 2009 年度报告中财务指标、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进行了核查, 以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20176 号

友邦华泰行业领先股票型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的友邦华泰行业领先股票型证券投资基金(以下简称“友邦华泰行业领先基金”)的财务报表, 包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是友邦华泰行业领先基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括:

- (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报;
- (2) 选择和运用恰当的会计政策;
- (3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员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，在所有重大方面公允反映了友邦华泰行业领先基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师 薛 竞

中国 · 上海市
2010 年 3 月 24 日

注册会计师 单 峰

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：友邦华泰行业领先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	附注号	本期期末 2009 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	288,201,494.02
结算备付金		12,219,358.49
存出保证金		1,363,430.57
交易性金融资产	7.4.7.2	1,242,173,462.63
其中：股票投资		1,242,173,462.63
债券投资		—

资产支持证券投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	76,842.11
应收股利		—
应收申购款		17,289.56
其它资产	7.4.7.6	—
资产总计		1,544,051,877.38
负债和所有者权益	附注号	本期期末 2009年12月31日
负 债:		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		10,610,573.60
应付管理人报酬		1,975,663.06
应付托管费		329,277.16
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	3,538,914.41
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
其它负债	7.4.7.8	289,989.49
负债合计		16,744,417.72
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	1,831,069,536.62
未分配利润	7.4.7.10	-303,762,076.96
所有者权益合计		1,527,307,459.66
负债和所有者权益总计		1,544,051,877.38

注:1. 报告截止日2009年12月31日,基金份额净值0.834元,基金份额总额1,831,069,536.62份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日。

7.2 利润表

会计主体: 友邦华泰行业领先股票型证券投资基金

本报告期: 2009年08月03日(基金合同生效日)至2009年12月31日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期金额 2009年8月3日至2009年12月31日
一、收入		-363,750,921.33

1. 利息收入		2,605,252.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,966,400.39
债券利息收入		489,222.67
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		149,629.86
其它利息收入		—
2. 投资收益		-405,893,532.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-406,650,886.08
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	618,755.90
资产支持证券投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	—
股利收益	7.4.7.15	138,597.48
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	39,094,917.96
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		442,440.49
5. 其它收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	
减：二、费用		19,506,569.00
1. 管理人报酬		10,546,981.19
2. 托管费		1,757,830.15
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.18	6,947,138.08
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其它费用	7.4.7.19	254,619.58
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-383,257,490.33
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-383,257,490.33

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰行业领先股票型证券投资基金

本报告期：2009年8月3(基金合同生效日)日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3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	2,249,632,307.10	—	2,249,632,307.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-383,257,490.33	-383,257,490.33
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)	-418,562,770.48	79,495,413.37	-339,067,357.11

其中：1.基金申购款	18,514,890.74	-3,635,442.00	14,879,448.74
2.基金赎回款	-437,077,661.22	83,130,855.37	-353,946,805.85
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)	1,831,069,536.62	-303,762,076.96	1,527,307,459.66

注：

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1—7.4 财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：陈国杰

主管会计工作负责人：房伟力

会计机构负责人：陈陪

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

友邦华泰行业领先股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]482号《关于核准友邦华泰行业领先股票型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《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 2,249,392,302.39 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2009)第 132 号验资报告。经向中国证监会备案，《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 3 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,249,632,307.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 240,004.71 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的 60%-95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%。其中，现金以及投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数 X80%+上证国债指数 X15%+同业存款利率 X5%。

本财务报表由本基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司于 2010 年 3 月 26 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》、《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其它有关规定的声明

本基金2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间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8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,取得时发生的相关交易费用计入当期损益;支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息,应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量,应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 其它重要的会计政策和会计估计

(1) 计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外，一般采用历史成本计量。

(2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

7.4.5.3 差错更正的说明

无。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利

个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	288,201,494.02
定期存款	—
其它存款	—
合计：	288,201,494.02

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2009 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,203,078,544.67	1,242,173,462.63	39,094,917.96
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
合计		—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其它		—	—	—
合计		1,203,078,544.67	1,242,173,462.63	39,094,917.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2009 年 12 月 31 日）
应收活期存款利息	72,137.74
应收定期存款利息	—
应收其它存款利息	—
应收结算备付金利息	4,704.37
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其它	—
合计	76,842.11

7.4.7.6 其它资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,538,914.41
银行间市场应付交易费用	—
合计	3,538,914.41

7.4.7.8 其它负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	39,989.49
预提费用	250,000.00
合计	289,989.49

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 8 月 3(基金合同生效日)日至 2009 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,249,632,307.10	2,249,632,307.10
本期申购	18,514,890.74	18,514,890.74
本期赎回(以“-”号填列)	-437,077,661.22	-437,077,661.22
本期末	1,831,069,536.62	1,831,069,536.62

注：

1、申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2、本基金自 2009 年 7 月 1 日至 2009 年 7 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金

2,249,392,302.39 元。根据《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 240,004.71 元在本基金成立后，折算为 240,004.71 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》和《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于 2009 年 8 月 3 日(基金合同生效日)至 2009 年 9 月 10 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购业务、赎回业务及转换业务自 2009 年 9 月 11 日起开始办理。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-422,352,408.29	39,094,917.96	-383,257,490.33
本期基金份额交易产生的变动数	73,912,862.40	5,582,550.97	79,495,413.37
其中：基金申购款	-3,253,856.34	-381,585.66	-3,635,442.00
基金赎回款	77,166,718.74	5,964,136.63	83,130,855.37
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-348,439,545.89	44,677,468.93	-303,762,076.96

7.4.7.11 存款利息收入

金额单位：人民币元

项目	本期 2009 年 8 月 3(基金合同生效日)日至 2009 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,926,112.47
定期存款利息收入	—
其它存款利息收入	—
结算备付金利息收入	40,009.61
其它	278.31
合计	1,966,400.39

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 8 月 3(基金合同生效日)日至 2009 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,745,372,384.41
减：卖出股票成本总额	2,152,023,270.49
买卖股票差价收入	-406,650,886.08

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	354,067,895.00

减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	341,672,953.04
减：应收利息总额	11,776,186.06
债券投资收益	618,755.90

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	138,597.48
基金投资产生的股利收益	—
合计	138,597.48

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年8月3日(基金合同生效日)至 2009年12月31日
1. 交易性金融资产	39,094,917.96
——股票投资	39,094,917.96
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其它	—
合计	39,094,917.96

7.4.7.17 其它收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
基金赎回费收入	427,610.71
转换费收入	14,829.78
合计	442,440.49

注：

- 1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25%归入基金财产。
- 2、本基金的转换费由转出基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用的 25%的部分归入基金财产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
交易所市场交易费用	6,945,663.08
银行间市场交易费用	1,475.00
合计	6,947,138.08

7.4.7.19 其它费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
审计费用	100,000.00
信息披露费	150,000.00
债券托管帐户维护费	1,500.00
银行划款手续费	2,219.58
其他	900.00
合计	254,619.58

注：其他为本基金证券帐户开户费用。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

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、基金注册登记机构、基金直销机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
华泰联合证券有限责任公司(“华泰联合证券”)(i)	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构
华泰证券股份有限公司(“华泰证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
AIG Global Investment Corp.(“AIGGIC”)	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东

注：

(i)根据中国证监会证监许可[2009]921号文《关于核准联合证券有限责任公司变更公司章程重要条款的批复》批准，联合证券有限责任公司于2009年9月17日起更名为华泰联合证券有限责任公司。

关联方与资产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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,546,981.19
其中：支付销售机构的客户维护费	3,194,993.59

注：支付基金管理人友邦华泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 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 × 1.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,757,830.15

注：支付基金托管人中国工商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 × 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它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
华泰证券	39,999,800.00	2.18%

注：华泰证券股份有限公司投资本基金的费用均参照本基金的基金管理人公布的费率收取。

7.4.10.5 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8月3日至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	288,201,494.02	1,926,112.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
无。

7.4.10.7 其它关联交易事项的说明
无。

7.4.11 利润分配情况
无。

7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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：）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	2009 年 12 月 29 日	2010 年 01 月 07 日	网上新股申购	5.43	5.43	14,000.00	76,020.00	76,020.00	-
300040	九洲电气	2009 年 12 月 28 日	2010 年 01 月 08 日	网上新股申购	33.00	33.00	500.00	16,500.00	16,500.00	-
300042	朗科科技	2009 年 12 月 28 日	2010 年 01 月 08 日	网上新股申购	39.00	39.00	500.00	19,500.00	19,500.00	-
合计								112,020.00	112,020.00	

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。

7.4.12.2 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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600102	莱钢股份	2009 年 11 月 09 日	资产重组	13.07	2010 年 02 月 24 日	11.88	499,962.00	6,361,075.77	6,534,503.34	-

600739	辽宁成大	2009年12月28日	公告重大事项	38.09	2010年01月11日	41.90	688,800.00	25,923,573.07	26,236,392.00	-
000547	闽福发A	2009年12月28日	公告重大事项	9.58	2010年01月11日	10.54	174,000.00	1,597,341.52	1,666,920.00	-
000685	中山公用	2009年12月28日	公告重大事项	30.47	2010年01月11日	33.52	122,527.00	3,650,099.37	3,733,397.69	-
合计								37,532,089.73	38,171,213.03	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属主动管理的股票型证券投资基金，为证券投资基金中的较高风险较高收益品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金力争通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益。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。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“预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金”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，将风险控制在可承受的范围內。

7.4.13.2 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。

本基金的基金管理人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中国工商银行，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，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券。

7.4.13.3 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

7.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 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、结算备付金和债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2009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	288,201,494.02						288,201,494.02
结算备付金	12,219,358.49						12,219,358.49
存出保证金						1,363,430.57	1,363,430.57
交易性金融资产						1,242,173,462.63	1,242,173,462.63
应收利息						76,842.11	76,842.11
应收申购款	17,289.56						17,289.56
其他资产							
资产总计	300,438,142.07	—	—	—	—	1,243,613,735.31	1,544,051,877.38
负债							
应付赎回款						10,610,573.60	10,610,573.60
应付托管费						329,277.16	329,277.16
应付交易费用						3,538,914.41	3,538,914.41
其他负债						289,989.49	289,989.49
应付管理人报酬						1,975,663.06	1,975,663.06
负债总计	—	—	—	—	—	16,744,417.72	16,744,417.72
利率敏感度缺口	300,438,142.07	—	—	—	—	1,226,869,317.59	1,527,307,459.66

注：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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本

基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其它价格风险

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和外汇汇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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资的比例范围为基金资产的 60%-95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其它价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	1,242,173,462.63	81.33
衍生金融资产—权证投资	—	—
其它	—	—
合计	1,242,173,462.63	81.33

7.4.13.4.3.2 其它价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变	
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：人民币万元）
		本期末（2009 年 12 月 31 日）
	1. 沪深 300 指数上升 5%	上升约 6,053
	2. 沪深 300 指数下降 5%	下降约 6,053

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

§ 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	1,242,173,462.63	80.45

	其中：股票	1,242,173,462.63	80.45
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	300,420,852.51	19.46
6	其它各项资产	1,457,562.24	0.09
7	合计	1,544,051,877.38	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	11,551,453.16	0.76
B	采掘业	117,039,979.21	7.66
C	制造业	493,185,974.16	32.29
C0	食品、饮料	54,298,747.90	3.56
C1	纺织、服装、皮毛	15,515,641.00	1.02
C2	木材、家具	3,485,501.50	0.23
C3	造纸、印刷	5,307,878.00	0.35
C4	石油、化学、塑胶、塑料	70,677,802.33	4.63
C5	电子	21,907,133.76	1.43
C6	金属、非金属	144,921,158.21	9.49
C7	机械、设备、仪表	105,122,471.89	6.88
C8	医药、生物制品	61,374,299.29	4.02
C99	其它制造业	10,575,340.28	0.69
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,578,427.31	2.53
E	建筑业	21,250,801.44	1.39
F	交通运输、仓储业	48,362,271.94	3.17
G	信息技术业	43,690,081.67	2.86
H	批发和零售贸易	78,620,208.04	5.15
I	金融、保险业	293,139,227.86	19.19
J	房地产业	50,351,446.90	3.30
K	社会服务业	14,849,218.77	0.97
L	传播与文化产业	8,528,366.55	0.56
M	综合类	23,026,005.62	1.51
	合计	1,242,173,462.63	81.33

8.3 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	占基金资产净值比例 （%）
1	600016	民生银行	5,126,451.00	40,550,227.41	2.66
2	000001	深发展 A	1,397,257.00	34,051,153.09	2.23
3	601169	北京银行	1,624,800.00	31,423,632.00	2.06
4	601166	兴业银行	742,411.00	29,926,587.41	1.96
5	601699	潞安环能	519,200.00	26,884,176.00	1.76
6	600739	辽宁成大	688,800.00	26,236,392.00	1.72
7	601318	中国平安	448,918.00	24,730,892.62	1.62
8	600036	招商银行	1,369,176.00	24,713,626.80	1.62
9	601601	中国太保	922,600.00	23,637,012.00	1.55
10	600000	浦发银行	1,076,721.00	23,354,078.49	1.53
11	601328	交通银行	2,301,060.00	21,514,911.00	1.41
12	601939	建设银行	3,402,572.00	21,061,920.68	1.38
13	000983	西山煤电	489,073.00	19,509,121.97	1.28
14	000937	金牛能源	462,450.00	19,237,920.00	1.26
15	600581	八一钢铁	855,410.00	13,686,560.00	0.90
16	000858	五 粮 液	397,300.00	12,578,518.00	0.82
17	600123	兰花科创	275,537.00	12,051,988.38	0.79
18	600307	酒钢宏兴	791,700.00	12,010,089.00	0.79
19	000825	太钢不锈	1,152,100.00	10,991,034.00	0.72
20	600887	*ST 伊利	388,644.00	10,291,293.12	0.67
21	600348	国阳新能	212,200.00	10,264,114.00	0.67
22	600508	上海能源	399,924.00	10,058,088.60	0.66
23	600837	海通证券	502,970.00	9,651,994.30	0.63
24	000933	神火股份	250,000.00	9,220,000.00	0.60
25	000987	广州友谊	323,509.00	8,977,374.75	0.59
26	000537	广宇发展	612,599.00	8,747,913.72	0.57
27	000564	西安民生	1,182,368.00	8,702,228.48	0.57
28	600458	时代新材	405,054.00	8,668,155.60	0.57
29	600030	中信证券	268,278.00	8,523,192.06	0.56
30	002088	鲁阳股份	360,815.00	8,334,826.50	0.55
31	000778	新兴铸管	628,900.00	7,817,227.00	0.51
32	000963	华东医药	402,482.00	7,405,668.80	0.48
33	000989	九 芝 堂	518,400.00	7,402,752.00	0.48
34	000521	美菱电器	513,700.00	6,744,881.00	0.44
35	600102	莱钢股份	499,962.00	6,534,503.34	0.43

36	000060	中金岭南	231,500.00	6,458,850.00	0.42
37	600546	山煤国际	180,000.00	6,190,200.00	0.41
38	600693	东百集团	517,782.00	6,032,160.30	0.39
39	600573	惠泉啤酒	533,800.00	6,026,602.00	0.39
40	600660	福耀玻璃	400,000.00	5,976,000.00	0.39
41	600597	光明乳业	625,700.00	5,962,921.00	0.39
42	600812	华北制药	508,000.00	5,943,600.00	0.39
43	000869	张裕A	76,849.00	5,842,060.98	0.38
44	600839	四川长虹	876,700.00	5,751,152.00	0.38
45	000630	铜陵有色	258,945.00	5,735,631.75	0.38
46	000421	南京中北	876,409.00	5,731,714.86	0.38
47	000916	华北高速	1,084,200.00	5,713,734.00	0.37
48	600305	恒顺醋业	419,800.00	5,646,310.00	0.37
49	600279	重庆港九	542,648.00	5,610,980.32	0.37
50	600591	*ST 上航	777,110.00	5,587,420.90	0.37
51	600004	白云机场	548,700.00	5,569,305.00	0.36
52	000520	长航凤凰	974,712.00	5,516,869.92	0.36
53	600787	中储股份	565,600.00	5,480,664.00	0.36
54	000895	双汇发展	102,100.00	5,421,510.00	0.35
55	000612	焦作万方	192,805.00	5,398,540.00	0.35
56	000022	深赤湾A	355,194.00	5,374,085.22	0.35
57	600168	武汉控股	653,798.00	5,348,067.64	0.35
58	600717	天津港	427,100.00	5,308,853.00	0.35
59	000404	华意压缩	612,200.00	5,179,212.00	0.34
60	600551	时代出版	269,297.00	5,060,090.63	0.33
61	601333	广深铁路	1,057,800.00	5,045,706.00	0.33
62	600509	天富热电	529,841.00	5,017,594.27	0.33
63	600797	浙大网新	720,657.00	4,972,533.30	0.33
64	000551	创元科技	460,024.00	4,931,457.28	0.32
65	600050	中国联通	673,200.00	4,907,628.00	0.32
66	000926	福星股份	404,140.00	4,886,052.60	0.32
67	000932	华菱钢铁	623,000.00	4,778,410.00	0.31
68	600291	西水股份	285,300.00	4,718,862.00	0.31
69	600126	杭钢股份	699,910.00	4,696,396.10	0.31
70	000913	钱江摩托	538,960.00	4,645,835.20	0.30
71	600456	宝钛股份	201,570.00	4,626,031.50	0.30
72	002063	远光软件	200,000.00	4,554,000.00	0.30
73	600063	皖维高新	367,042.00	4,529,298.28	0.30
74	600831	广电网络	510,670.00	4,519,429.50	0.30
75	600742	一汽富维	159,510.00	4,467,875.10	0.29

76	600362	江西铜业	110,640.00	4,448,834.40	0.29
77	000758	中色股份	282,800.00	4,386,228.00	0.29
78	600725	云维股份	205,400.00	4,381,182.00	0.29
79	600756	浪潮软件	308,193.00	4,373,258.67	0.29
80	600255	鑫科材料	608,148.00	4,336,095.24	0.28
81	600390	金瑞科技	318,534.00	4,319,321.04	0.28
82	000948	南天信息	275,200.00	4,309,632.00	0.28
83	600677	航天通信	330,100.00	4,155,959.00	0.27
84	002267	陕天然气	184,100.00	4,081,497.00	0.27
85	000417	合肥百货	276,299.00	4,053,306.33	0.27
86	000420	吉林化纤	716,900.00	4,043,316.00	0.26
87	600309	烟台万华	168,207.00	4,038,650.07	0.26
88	000830	鲁西化工	654,900.00	4,034,184.00	0.26
89	000096	广聚能源	518,350.00	4,032,763.00	0.26
90	002181	粤传媒	401,295.00	4,008,937.05	0.26
91	000700	模塑科技	566,152.00	3,991,371.60	0.26
92	000598	蓝星清洗	334,700.00	3,969,542.00	0.26
93	600470	六国化工	306,700.00	3,956,430.00	0.26
94	600801	华新水泥	166,200.00	3,947,250.00	0.26
95	600496	精工钢构	333,300.00	3,946,272.00	0.26
96	600810	神马实业	312,000.00	3,943,680.00	0.26
97	600741	华域汽车	339,500.00	3,931,410.00	0.26
98	002039	黔源电力	213,311.00	3,924,922.40	0.26
99	000782	美达股份	627,699.00	3,916,841.76	0.26
100	600829	三精制药	200,000.00	3,898,000.00	0.26
101	000737	南风化工	623,400.00	3,877,548.00	0.25
102	600019	宝钢股份	399,940.00	3,863,420.40	0.25
103	600744	华银电力	671,800.00	3,862,850.00	0.25
104	600877	中国嘉陵	496,100.00	3,859,658.00	0.25
105	600292	九龙电力	394,200.00	3,855,276.00	0.25
106	000589	黔轮胎A	215,410.00	3,849,376.70	0.25
107	000883	三环股份	431,893.00	3,843,847.70	0.25
108	000952	广济药业	266,497.00	3,834,891.83	0.25
109	600802	福建水泥	484,900.00	3,825,861.00	0.25
110	600785	新华百货	134,554.00	3,819,988.06	0.25
111	000066	长城电脑	235,917.00	3,798,263.70	0.25
112	000581	威孚高科	199,998.00	3,769,962.30	0.25
113	000685	中山公用	122,527.00	3,733,397.69	0.24
114	600967	北方创业	298,564.00	3,708,164.88	0.24
115	600117	西宁特钢	350,000.00	3,671,500.00	0.24

116	600056	中国医药	130,980.00	3,647,793.00	0.24
117	600487	亨通光电	114,100.00	3,646,636.00	0.24
118	600021	上海电力	625,500.00	3,627,900.00	0.24
119	601808	中海油服	222,901.00	3,624,370.26	0.24
120	002062	宏润建设	179,742.00	3,607,421.94	0.24
121	000731	四川美丰	387,800.00	3,606,540.00	0.24
122	000501	鄂武商A	240,800.00	3,578,288.00	0.23
123	600594	益佰制药	199,934.00	3,576,819.26	0.23
124	000698	沈阳化工	434,800.00	3,574,056.00	0.23
125	600383	金地集团	253,300.00	3,515,804.00	0.23
126	000786	北新建材	222,861.00	3,512,289.36	0.23
127	600327	大厦股份	241,900.00	3,468,846.00	0.23
128	601186	中国铁建	379,500.00	3,468,630.00	0.23
129	002152	广电运通	104,500.00	3,432,825.00	0.22
130	600219	南山铝业	257,000.00	3,400,110.00	0.22
131	002158	汉钟精机	177,440.00	3,351,841.60	0.22
132	600755	厦门国贸	214,262.00	3,346,772.44	0.22
133	600393	东华实业	287,300.00	3,321,188.00	0.22
134	600166	福田汽车	171,600.00	3,268,980.00	0.21
135	600522	中天科技	130,200.00	3,225,054.00	0.21
136	600499	科达机电	146,500.00	3,198,095.00	0.21
137	000909	数源科技	224,700.00	3,100,860.00	0.20
138	600068	葛洲坝	264,312.00	3,095,093.52	0.20
139	600750	江中药业	131,590.00	3,050,256.20	0.20
140	002252	上海莱士	81,940.00	3,038,335.20	0.20
141	000903	云内动力	220,543.00	3,006,001.09	0.20
142	600529	山东药玻	201,100.00	3,004,434.00	0.20
143	600226	升华拜克	245,600.00	2,993,864.00	0.20
144	600976	武汉健民	200,000.00	2,990,000.00	0.20
145	002132	恒星科技	206,952.00	2,938,718.40	0.19
146	600577	精达股份	364,800.00	2,936,640.00	0.19
147	600386	北巴传媒	200,000.00	2,920,000.00	0.19
148	000756	新华制药	345,300.00	2,907,426.00	0.19
149	002112	三变科技	194,800.00	2,875,248.00	0.19
150	600268	国电南自	144,900.00	2,869,020.00	0.19
151	600416	湘电股份	117,208.00	2,824,712.80	0.18
152	600763	通策医疗	266,500.00	2,806,245.00	0.18
153	600479	千金药业	102,500.00	2,755,200.00	0.18
154	000797	中国武夷	348,182.00	2,747,155.98	0.18
155	600216	浙江医药	77,200.00	2,746,004.00	0.18

156	600691	ST 东碳	256,434.00	2,741,279.46	0.18
157	600215	长春经开	337,500.00	2,740,500.00	0.18
158	600153	建发股份	210,208.00	2,724,295.68	0.18
159	600436	片仔癀	69,100.00	2,716,321.00	0.18
160	600239	云南城投	99,300.00	2,712,876.00	0.18
161	000530	大冷股份	283,100.00	2,706,436.00	0.18
162	600071	凤凰光学	351,600.00	2,700,288.00	0.18
163	600053	中江地产	279,643.00	2,698,554.95	0.18
164	600664	哈药股份	144,800.00	2,674,456.00	0.18
165	600064	南京高科	104,800.00	2,666,112.00	0.17
166	002086	东方海洋	196,799.00	2,644,978.56	0.17
167	600535	天士力	117,000.00	2,620,800.00	0.17
168	600657	信达地产	232,300.00	2,606,406.00	0.17
169	600201	金宇集团	266,500.00	2,595,710.00	0.17
170	600169	太原重工	148,800.00	2,589,120.00	0.17
171	000597	东北制药	97,700.00	2,572,441.00	0.17
172	002022	科华生物	116,200.00	2,543,618.00	0.17
173	000930	丰原生化	292,770.00	2,529,532.80	0.17
174	600973	宝胜股份	126,100.00	2,509,390.00	0.16
175	600031	三一重工	67,199.00	2,473,595.19	0.16
176	002131	利欧股份	132,400.00	2,471,908.00	0.16
177	000150	宜华地产	311,700.00	2,471,781.00	0.16
178	000608	阳光股份	219,600.00	2,450,736.00	0.16
179	000425	徐工机械	69,248.00	2,431,989.76	0.16
180	000656	ST 东 源	153,600.00	2,426,880.00	0.16
181	600665	天地源	358,015.00	2,384,379.90	0.16
182	600835	上海机电	173,800.00	2,377,584.00	0.16
183	000157	中联重科	91,289.00	2,374,426.89	0.16
184	600641	万业企业	246,900.00	2,350,488.00	0.15
185	000014	沙河股份	149,500.00	2,317,250.00	0.15
186	000816	江淮动力	305,700.00	2,311,092.00	0.15
187	002133	广宇集团	234,700.00	2,290,672.00	0.15
188	600322	天房发展	361,700.00	2,289,561.00	0.15
189	000006	深振业 A	201,900.00	2,287,527.00	0.15
190	000616	亿城股份	331,400.00	2,283,346.00	0.15
191	000671	阳 光 城	94,249.00	2,252,551.10	0.15
192	600052	浙江广厦	270,100.00	2,241,830.00	0.15
193	002234	民和股份	133,300.00	2,236,774.00	0.15
194	000506	ST 中润	272,200.00	2,234,762.00	0.15
195	600540	新赛股份	168,220.00	2,233,961.60	0.15

196	000735	罗 牛 山	360,800.00	2,222,528.00	0.15
197	000043	中航地产	146,560.00	2,217,452.80	0.15
198	600189	吉林森工	221,100.00	2,213,211.00	0.14
199	000024	招商地产	82,915.00	2,208,026.45	0.14
200	600987	航民股份	226,600.00	2,037,134.00	0.13
201	000726	鲁 泰 A	173,800.00	2,033,460.00	0.13
202	000507	粤 富 华	203,200.00	1,922,272.00	0.13
203	002003	伟星股份	89,800.00	1,919,924.00	0.13
204	600582	天地科技	54,714.00	1,901,311.50	0.12
205	600584	长电科技	214,701.00	1,878,633.75	0.12
206	002103	广博股份	187,200.00	1,855,152.00	0.12
207	002240	威华股份	160,250.00	1,844,477.50	0.12
208	000659	珠海中富	227,400.00	1,778,268.00	0.12
209	600177	雅戈尔	120,400.00	1,747,004.00	0.11
210	000910	大亚科技	153,600.00	1,744,896.00	0.11
211	002067	景兴纸业	254,900.00	1,707,830.00	0.11
212	002083	孚日股份	186,700.00	1,693,369.00	0.11
213	000547	闽福发 A	174,000.00	1,666,920.00	0.11
214	600978	宜华木业	211,200.00	1,641,024.00	0.11
215	002138	顺络电子	80,360.00	1,625,682.80	0.11
216	600261	浙江阳光	87,600.00	1,619,724.00	0.11
217	600207	ST 安彩	277,300.00	1,616,659.00	0.11
218	600193	创兴置业	135,800.00	1,603,798.00	0.11
219	600366	宁波韵升	104,400.00	1,602,540.00	0.10
220	002025	航天电器	118,800.00	1,584,792.00	0.10
221	000881	大连国际	184,500.00	1,577,475.00	0.10
222	600051	宁波联合	124,800.00	1,573,728.00	0.10
223	000966	长源电力	288,000.00	1,549,440.00	0.10
224	600027	华电国际	288,000.00	1,546,560.00	0.10
225	000531	穗恒运 A	86,400.00	1,508,544.00	0.10
226	600539	狮头股份	177,200.00	1,479,620.00	0.10
227	600593	大连圣亚	104,200.00	1,467,136.00	0.10
228	000958	东方热电	259,200.00	1,459,296.00	0.10
229	600183	生益科技	139,000.00	1,438,650.00	0.09
230	002045	广州国光	100,740.00	1,422,448.80	0.09
231	600726	华电能源	288,000.00	1,405,440.00	0.09
232	000690	宝新能源	144,000.00	1,391,040.00	0.09
233	000062	深圳华强	134,500.00	1,367,865.00	0.09
234	600138	中青旅	84,790.00	1,352,400.50	0.09
235	002056	横店东磁	91,201.00	1,347,950.78	0.09

236	000721	西安饮食	164,200.00	1,302,106.00	0.09
237	601007	金陵饭店	140,076.00	1,186,443.72	0.08
238	601919	中国远洋	75,785.00	1,053,411.50	0.07
239	600626	申达股份	128,700.00	1,042,470.00	0.07
240	002046	轴研科技	56,400.00	889,992.00	0.06
241	600653	申华控股	198,300.00	884,418.00	0.06
242	600622	嘉宝集团	71,600.00	878,532.00	0.06
243	600029	南方航空	115,200.00	698,112.00	0.05
244	601117	中国化学	14,000.00	76,020.00	0.00
245	300042	朗科科技	500.00	19,500.00	0.00
246	300040	九洲电气	500.00	16,500.00	0.00

8.4 报告期内权益投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	141,930,174.23	9.29
2	601318	中国平安	139,522,089.95	9.14
3	600016	民生银行	131,960,567.18	8.64
4	601166	兴业银行	119,148,983.24	7.80
5	600000	浦发银行	107,495,004.22	7.04
6	600030	中信证券	92,067,697.86	6.03
7	000001	深发展 A	89,682,833.17	5.87
8	000983	西山煤电	88,882,421.68	5.82
9	600048	保利地产	81,422,276.18	5.33
10	600348	国阳新能	81,062,981.70	5.31
11	601088	中国神华	79,605,754.09	5.21
12	000024	招商地产	78,796,913.95	5.16
13	000937	金牛能源	65,889,377.14	4.31
14	000878	云南铜业	60,350,246.55	3.95
15	000623	吉林敖东	58,506,448.38	3.83
16	000898	鞍钢股份	55,246,176.56	3.62
17	000825	太钢不锈	55,179,352.44	3.61
18	600595	中孚实业	53,525,673.56	3.50
19	600031	三一重工	46,327,816.45	3.03
20	600005	武钢股份	43,950,081.26	2.88

21	601939	建设银行	43,466,147.96	2.85
22	600019	宝钢股份	43,108,661.55	2.82
23	601628	中国人寿	42,068,095.50	2.75
24	000060	中金岭南	42,066,351.24	2.75
25	601699	潞安环能	40,998,689.03	2.68
26	601169	北京银行	34,705,946.80	2.27
27	000932	华菱钢铁	33,164,873.66	2.17
28	600028	中国石化	32,699,067.39	2.14
29	000157	中联重科	32,182,795.88	2.11
30	600143	金发科技	32,078,255.11	2.10
31	000792	盐湖钾肥	31,703,478.31	2.08

注：不考虑相关交易费用。本基金基金合同于报告期内生效，占比计算采用期末基金资产净值。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	96,753,169.80	6.33
2	601318	中国平安	86,146,794.49	5.64
3	600016	民生银行	75,496,189.20	4.94
4	601166	兴业银行	68,584,834.45	4.49
5	600048	保利地产	64,361,157.51	4.21
6	000983	西山煤电	63,642,673.39	4.17
7	600000	浦发银行	59,245,499.00	3.88
8	600030	中信证券	58,352,631.62	3.82
9	601088	中国神华	57,967,265.44	3.80
10	600348	国阳新能	57,226,046.52	3.75
11	000024	招商地产	54,595,470.84	3.57
12	000001	深发展 A	52,942,165.57	3.47
13	600031	三一重工	46,588,622.01	3.05
14	000878	云南铜业	42,369,779.37	2.77
15	600595	中孚实业	41,448,336.67	2.71
16	000623	吉林敖东	39,829,280.85	2.61
17	000937	金牛能源	34,627,207.23	2.27
18	000898	鞍钢股份	34,413,904.38	2.25
19	000157	中联重科	33,587,836.40	2.20
20	601628	中国人寿	32,988,029.53	2.16
21	600830	香溢融通	31,299,305.16	2.05
22	000825	太钢不锈	31,160,162.56	2.04

注：不考虑相关交易费用。本基金基金合同于报告期内生效，占比计算采用期末基金资产净值。

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

买入股票成本（成交）总额	3,355,101,815.16
卖出股票收入（成交）总额	1,745,372,384.41

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

注：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

注：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。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其它各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,363,430.57
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	76,842.11
5	应收申购款	17,289.56
6	其它应收款	—
7	待摊费用	—
8	其它	—
9	合计	1,457,562.24

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600739	辽宁成大	26,236,392.00	1.72	公告重大事项

8.9.6 投资组合报告附注的其它文字描述部分

无。

§ 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
30,167.00	60,697.77	146,425,803.19	8.00%	1,684,643,733.43	92.00%

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	1,825,129.91	0.10%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2009年8月3日）基金份额总额	2,249,632,307.10
本报告期期初基金份额总额	2,249,632,307.10
本报告期基金总申购份额	18,514,890.74
减：本报告期基金总赎回份额	-437,077,661.22
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,831,069,536.62

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

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

报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期基金聘请普华永道中天会计师事务所为其提供审计服务。截至本报告期末，本基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 5 个月的审计服务。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

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

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。

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	
安信证券	1	1,729,505,920.56	33.91%	1,405,237.59	32.91%	—
德邦证券	1	1,143,623,001.80	22.42%	972,076.26	22.76%	—

中投证券	1	291,173,255.23	5.71%	247,494.87	5.80%	—
中信证券	1	1,935,602,131.98	37.96%	1,645,252.31	38.53%	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
合计		5,099,904,309.57	100.00%	4,270,061.03	100.00%	—

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
安信证券	—	—	—	—	—	—
德邦证券	—	—	—	—	—	—
中投证券	4,067,895.00	100.00%	254,100,000.00	100.00%	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—
华宝证券	—	—	—	—	—	—
合计	4,067,895.00	100.00%	254,100,000.00	100.00%	—	—

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服务。
- 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。基金管理人与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。

3、上述交易单元均系本报告期内租用。

11.8 其它重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	友邦华泰基金管理有限公司参加中国工商银行“2010 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 12 月 31 日
2	友邦华泰基金管理有限公司关于延长在中信建投证券有限责任公司的基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 12 月 31 日
3	友邦华泰基金管理有限公司关于延长在中国农业银行的基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 12 月 31 日
4	友邦华泰基金管理有限公司关于增加华龙证券有限责任公司和中国建银投资证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 12 月 10 日
5	友邦华泰基金管理有限公司关于增加爱建证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 11 月 20 日
6	友邦华泰基金管理有限公司关于聘任友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 11 月 19 日
7	友邦华泰基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 11 月 18 日
8	友邦华泰关于调整建行卡网上交易申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 11 月 17 日
9	友邦华泰基金管理有限公司关于旗下基金持有的上海医药股票恢复采用收盘价估值的提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 10 月 20 日
10	友邦华泰关于旗下基金参与创业板市场投资的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 24 日
11	友邦华泰行业领先基金在交通银行开通基金转换、定期定额业务及参加定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 18 日
12	友邦华泰关于参加第一创业证券开放式基金网上申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 15 日
13	友邦华泰行业领先基金办理定期定额申购业务并参加相关销售机构定期定额申购费优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 11 日
14	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 11 日

		时报	
15	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金参加相关销售机构网银或电话银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 11 日
16	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 09 日
17	友邦华泰关于参加农业银行网上银行开放式基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 09 月 08 日
18	友邦华泰开通网上交易定期定额转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 08 月 25 日
19	友邦华泰基金关于增加华宝证券和天相投资顾问有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 08 月 11 日
20	友邦华泰关于增加广发华福证券为代销机构并参加其网上交易费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 08 月 05 日
21	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 08 月 04 日
22	友邦华泰关于旗下基金持有的"盐湖钾肥"恢复采用收盘价估值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 07 月 28 日
23	友邦华泰关于旗下基金资产估值方法调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 07 月 24 日
24	友邦华泰行业领先股票型基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 07 月 14 日
25	友邦华泰行业领先股票型基金增加代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 07 月 01 日
26	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 06 月 26 日
27	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 06 月 26 日
28	友邦华泰行业领先股票型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009 年 06 月 26 日
29	友邦华泰行业领先股票型证券投	中国证券报、上	2009 年 06 月 26 日

	资基金基金份额发售公告	海证券报、证券时报	
30	友邦华泰参加邮储银行定期定额投资优惠期间延长的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009年06月26日
31	友邦华泰关于聘任友邦华泰行业领先股票型基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009年06月22日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准友邦华泰行业领先股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《友邦华泰行业领先股票型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、友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的公告

13.2 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

13.3 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