
友邦华泰积极成长混合型证券投资基金2009年年度报告

2009年12月31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1月1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	其他相关资料	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	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6	审计报告	15
§7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	18
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4	报表附注	21
§8	投资组合报告	43
8.1	期末基金资产组合情况	43
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55
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	55
8.9	投资组合报告附注	55
§9	基金份额持有人信息	56
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
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	57
§10	开放式基金份额变动	57
§11	重大事件揭示	57
11.1	基金份额持有人大会决议	57
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	57
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
11.4	基金投资策略的改变	57
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况	58
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8	其他重大事件	60
§12	影响投资者决策的其他重要信息	62
§13	备查文件目录	62
13.1	备查文件目录	63
13.2	存放地点	63
13.3	查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金
基金简称	友邦华泰积极成长混合
交易代码	460002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年05月29日
基金管理人	友邦华泰基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,229,280,836.11
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和风险管理手段，投资于具备持续突出增长能力的优秀企业，辅以特定市场状况下的大类资产配置调整，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。 本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	沪深300指数×60%+中信标普国债指数×40%
风险收益特征	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	中国银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	陈晖	唐州徽
	联系电话	021-38601777	010-66594855

人	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com	tgxxpl@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	北京市复兴门内大街1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	北京市复兴门内大街1号
邮政编码		200135	100818
法定代表人		齐亮	肖钢

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.aig-huatai.com
基金年度报告备置地点	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	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	2008年	2007年5月29日-2007年12月31日
本期已实现收益	622,503,487.77	-1,424,535,898.61	1,496,425,442.64

本期利润	1,721,767,238.10	-3,275,993,711.26	2,689,683,744.25
加权平均基金份额本期利润	0.3482	-0.5679	0.3089
本期加权平均净值利润率	35.61%	-58.43%	25.94%
本期基金份额净值增长率	43.16%	-43.14%	29.46%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配利润	127,385,184.91	-1,413,928,517.76	1,256,021,135.18
期末可供分配基金份额利润	0.0301	-0.2639	0.1724
期末基金资产净值	4,456,666,313.44	3,944,670,299.81	9,432,163,984.44
期末基金份额净值	1.0538	0.7361	1.2946
3.1.3 累计期末指标	2009年末	2008年末	2007年末
基金份额累计净值增长率	5.38%	-26.39%	29.46%

- 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2007年5月29日，2007年度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

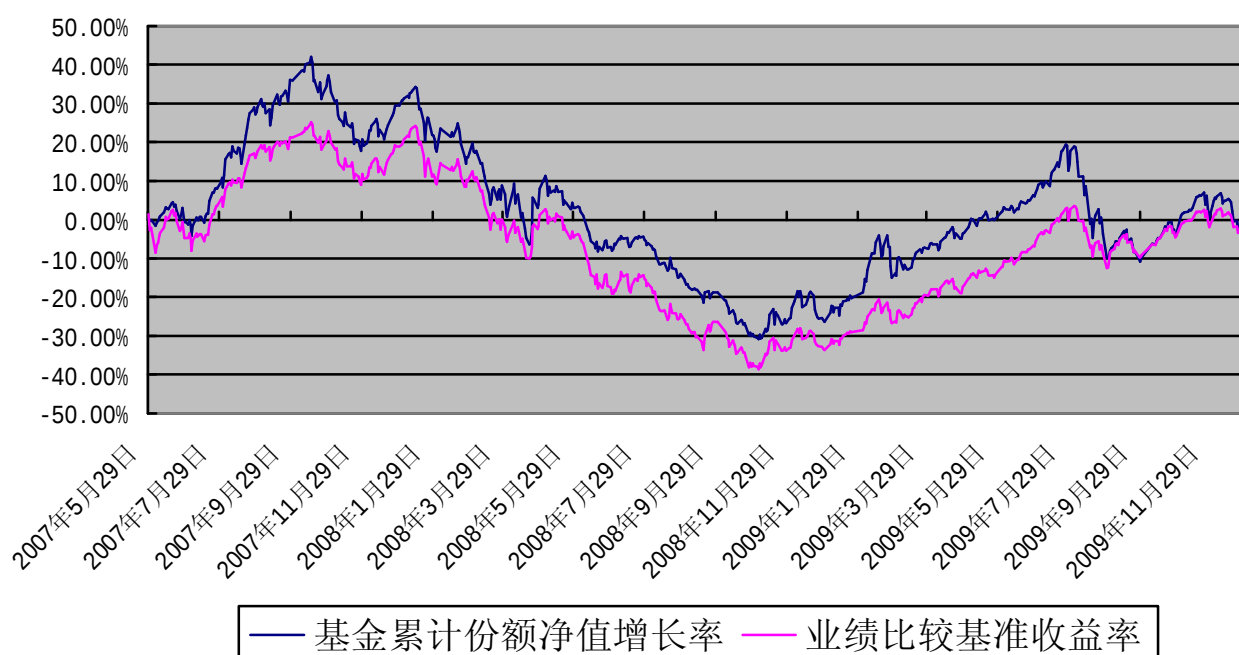
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.96%	1.48%	11.50%	1.05%	5.46%	0.43%
过去六个月	-0.60%	1.89%	8.71%	1.28%	-9.31%	0.61%
过去一年	43.16%	1.73%	52.60%	1.23%	-9.44%	0.50%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效日起至 至今（2007年05月29	5.38%	1.71%	1.27%	1.53%	4.11%	0.18%

日-2009年12月31日)						
----------------	--	--	--	--	--	--

注：本基金的业绩基准由沪深300指数和中信标普国债指数按照60%与40%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

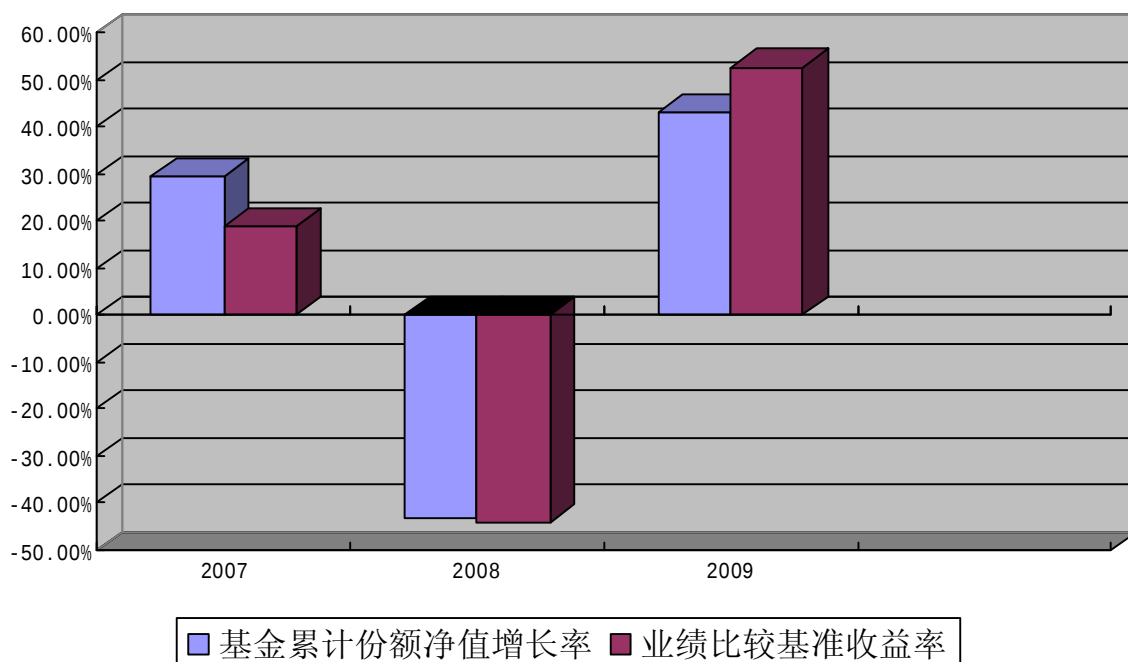
基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2007年5月29日至2009年12月31日。

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，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资范围、（十）之2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金资产的30%-95%，现金、债券资产、权证以及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%-70%。

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



注：基金合同生效日为2007年5月29日，2007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

注：本基金报告期末可供分配利润为127,385,184.91元。根据基金合同约定，本基金已于2010年1月对2009年度可分配利润实施了分红，每10份基金份额派发现金红利0.3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

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		
秦岭松	本基金的基金经理	2007年05月29日	—	8年	秦岭松先生，注册金融分析师（CFA），美国南加州大学会计学硕士、霍夫斯塔大学MBA（金融投资专业）。2002年9月至2005年10月在海通证券公司担任交易员及产品开发工作。2005年11月加入本公司，历任研究部高级研究员、友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金经理助理，2007年5月起任友邦华泰积极成长混合型基金基金经理。
卞亚军	本基金的基金经理助理	2009年11月2日	—	5年	卞亚军，金融学硕士，毕业于中国社会科学院研究生院。2004年7月-2006年7月就职于红塔证券资产管理部，任行业研究员、投资经理助理。2006年7月加入友邦华泰基金管理有限公司，历任宏观及债券研究员、行业研究员，

					2009 年 11 月起兼任本基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	---------------------------

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《友邦华泰积极成长混合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

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

09 上半年，A 股市场在积极财政政策和宽松货币政策的推动下经历了持续的估值修复过程。政府投资的适时启动对相关行业产生了明显的拉动作用；银行信贷投放创出近

十年新高，上半年累积贷款发放已超过 7 万亿。在实体经济尚处在触底恢复的阶段，大量流动性的注入强化了未来的通胀预期，并直接推动了资产（股票、房地产、大宗商品）价格的快速上涨。进入二季度，国内的主要经济指标（PMI、固定资产投资增速、工业增加值等）已陆续出现企稳恢复的迹象，随着市场对经济复苏的信心不断增强，同时政府也推出一系列启动内需政策，社会消费很快恢复至长期增长轨道，一些主要可选消费品（房地产、汽车）创出销量新高。随着全球各主要央行通过定量宽松的方式向经济体注入巨量流动性，一部分资金开始流入复苏较快的新兴市场，进一步强化了包括中国在内的新兴市场资产价格的上升趋势。上半年，A 股市场在政策、流动性和通胀预期的综合作用下保持了强劲的上升态势，行情的主线从基建、新能源等主题逐步过渡到抗通胀和内需拉动行业，呈现出较为明显的板块轮动特征。进入 3 季度后，由于商业银行的信贷增速受到有效控制以及市场获利丰厚和基金仓位较高等因素叠加，导致 A 股市场在 8-9 月出现较大幅度调整。此后，在房地产开工数据的持续回暖和其他基本面因素好转的支持下市场逐步企稳。在海外市场方面，美欧等经济体均出现持续的复苏迹象。

在 09 年的基金管理中，二季度由于管理人对信贷刺激和市场估值修复的持续性估计不足，导致股票配置比例低于业绩基准；此后投资风格在不恰当的时机发生漂移，并没有按照一致的投资逻辑对资产和行业配置进行调整，导致 09 年的运作未达到预期的结果，在此向持有人表示深深的歉意。09 年的操作暴露出管理人对自身认知的局限，在未来的运作中，管理人将在大类资产配置的原则和逻辑、投资标的的系统性筛选和风险管理三个方面大力加强和改进，期望以实际的良好业绩来回报各位投资者。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为 1.0538 元，累计净值为 1.0538 元，本报告期内基金份额净值上涨 43.16%，本基金的业绩比较基准上涨 52.60%。

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，我们对市场的前景仍相对乐观。由于货币政策逐步恢复正常化，由流动性驱动的估值全面趋势性上升的阶段已经过去，市场的驱动因素正经历切换的过程。

在政府政策方面，积极财政政策和适度宽松的货币政策基调得以维持，但政策应对新变化的灵活性也在逐步增强。随着实体经济增长的快速恢复，扩张性政策对市场的支持作用将逐步让位于市场内生性因素（业绩）的驱动。

从流动性角度看，预计 2010 年信贷增量可能达到 7-7.5 万亿元，同比增长近 16%，总体资金宽松的局面有望保持一段时间；随着股市和房地产市场财富效应的释放，部分居民储蓄也开始重新流向资本市场。在 10 年上半年，随着整体经济活动的改善和提升，物价指数也将进入快速回升的过程中，潜在的负利率预期也可能进一步推动存款活期化的趋势，对资产价格提供潜在的资金支持。在大量流动性注入实体经济后，通胀预期的强化也为资源（大宗商品）和抗通胀资产提供了较好的投资环境。

从企业盈利的角度看，预计 2009 年上市公司净利润同比增长 22% 左右，10 年也将有望保持 20% 以上的同比增速。从历史上看，在 PPI 触底回升的过程中，周期性行业的利润将出现较快的增长（03 年和 06 年可比上市公司净利润增速分别达到 63% 和 49%）。考虑到最大的周期性行业-银行的净利差已经触底，如果信贷总量仍保持 7 万亿以上的增速，银行业坏账在 2010 年之前上升的幅度相对有限（估计为 0.5% 左右），预计 10 年上市公司企业利润保持 20% 增长的基础较为坚实。

未来 A 股市场面临两大主要的风险：1）通胀水平超出预期；2）随着股票供应的快速增长，市场利益格局发生变化，新增流通股减持的动机不断增加。从目前大类资产的相对收益看，A 股公司 09 年盈利将超过 1 万亿，目前市值 28 万亿左右，对应市盈率 28 倍，隐含的股票收益率为 3.6%，和 10 年期国债水平相当，也超过了当前的现金收益率（一年期存款利率 2.25%），股票相对于其他资产类别的吸引力和 08 年底相比已有所弱化，但尚未出现非常明显的不利变化。未来我们将密切关注通胀水平和货币政策的可能变化，以判断对资产价格的潜在影响。

我们将沿着经济复苏的路径，按照系统性的筛选标准，从企业商业模式、盈利持续性和估值等方面精心筛选优势行业中的龙头企业，配置方向上继续突出内需拉动的消费行业（医药、食品、零售等）和通胀受益类行业（煤炭、有色、地产、金融），努力为投资人创造优异的回报。

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进行事先合规性设置，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6次；全年基金收益分配比例不得低于年度基金已实现净收益的25%；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。

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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在友邦华泰积极成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

本基金本期利润1,721,767,238.10元、本期已实现收益622,503,487.77元、期末可供分配利润127,385,184.91元。本报告期内，本基金未实施收益分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20173 号

友邦华泰积极成长混合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积极成长混合型证券投资基金(以下简称“友邦华泰积极成长基金”)的财务报表，包括2009年12月31日的资产负债表、2009年度的利润表、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积极成长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积极成长基金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。

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 26 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：友邦华泰积极成长混合型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	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	7.4.7.1	233,267,203.33	261,625,661.15
结算备付金		4,328,431.92	12,472,858.12
存出保证金		4,654,930.07	1,594,493.38
交易性金融资产	7.4.7.2	4,216,486,913.66	3,669,167,366.84
其中：股票投资		4,017,146,913.66	3,532,713,366.84
债券投资		199,340,000.00	136,454,000.00
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	1,235,832.99
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		22,411,526.72	38,301,033.51
应收利息	7.4.7.5	469,743.64	2,906,886.96
应收股利		—	—
应收申购款		317,010.84	108,091.78
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		4,481,935,760.18	3,987,412,224.73

负债和所有者权益	附注号	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		—	31,161,445.48
应付赎回款		12,349,506.51	723,779.06
应付管理人报酬		5,630,330.45	5,305,428.08
应付托管费		938,388.42	884,238.02
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	3,947,510.69	2,443,396.57
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
其他负债	7.4.7.8	2,403,710.67	2,223,637.71
负债合计		25,269,446.74	42,741,924.92
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	4,229,280,836.11	5,358,598,817.57
未分配利润	7.4.7.10	227,385,477.33	-1,413,928,517.76
所有者权益合计		4,456,666,313.44	3,944,670,299.81
负债和所有者权益总计		4,481,935,760.18	3,987,412,224.73

注：报告截止日2009年12月31日，基金份额净值1.0538元，基金份额总额4,229,280,836.11份。

7.2 利润表

会计主体：友邦华泰积极成长混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2009年01月01日 -2009年12月31日	2008年01月01日 -2008年12月31日
一、收入		1,851,367,706.27	-3,117,577,432.86
1.利息收入		14,184,090.90	42,008,732.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	6,329,801.14	9,828,957.17
债券利息收入		7,854,289.76	28,990,236.22
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	3,189,539.44
2.投资收益		737,425,674.25	-1,311,094,434.49
其中：股票投资收益	7.4.7.12	732,628,388.12	-1,343,071,779.73
债券投资收益	7.4.7.13	-13,329,667.04	5,701,231.80
资产支持证券投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	307,032.70	5,641,924.25
股利收益	7.4.7.15	17,819,920.47	20,634,189.19
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	1,099,263,750.33	-1,851,457,812.65
4.其他收入	7.4.7.17	494,190.79	2,966,081.45
减：二、费用		129,600,468.17	158,416,278.40
1. 管理人报酬		72,052,205.02	84,671,171.87
2. 托管费		12,008,700.85	14,111,862.04
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	45,108,127.56	59,200,184.66
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.19	431,434.74	433,059.83
三、利润总额		1,721,767,238.10	-3,275,993,711.26

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰积极成长混合型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2009年01月01日-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)	5,358,598,817.57	-1,413,928,517.76	3,944,670,299.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	1,721,767,238.10	1,721,767,238.10
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,129,317,981.46	-80,453,243.01	-1,209,771,224.47
其中：1.基金申购款	498,552,177.59	-10,629,111.36	487,923,066.23
2.基金赎回款	-1,627,870,159.05	-69,824,131.65	-1,697,694,290.70
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)	4,229,280,836.11	227,385,477.33	4,456,666,313.44
项 目	上年度可比期间		
	2008年01月01日-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)	7,286,045,078.41	2,146,118,906.03	9,432,163,984.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	-3,275,993,711.26	-3,275,993,711.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,927,446,260.84	-284,053,712.53	-2,211,499,973.37
其中：1.基金申购款	232,162,548.56	4,066,581.42	236,229,129.98
2.基金赎回款	-2,159,608,809.40	-288,120,293.95	-2,447,729,103.35

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）	5,358,598,817.57	-1,413,928,517.76	3,944,670,299.81

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：

基金管理人负责人：陈国杰 主管会计工作负责人：房伟力 会计机构负责人：陈培

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

友邦华泰积极成长混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监基金字[2007]第131号《关于同意友邦华泰积极成长混合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《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币8,920,448,257.95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(2007)第065号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》于2007年5月29日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为8,921,315,668.58份基金份额，其中认购资金利息折合867,410.63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《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、现金、短期金融工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的30%-95%；现金、债券资产、权证以及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%-70%，其中，本基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的3%，本基金保留的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%。本基金的业绩基准为：沪深300指数×60%+中信标普国债指数×40%。

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》、《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2009年12月31日的财务状况以及2009年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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。

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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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的事件的，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 其他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，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自2009年6月15日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 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	上年度末
----	-----	------

	2009年12月31日	2008年12月31日
活期存款	233,267,203.33	261,625,661.15
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	233,267,203.33	261,625,661.15

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		3,576,082,674.37	4,017,146,913.66	441,064,239.29
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	199,340,000.00	199,340,000.00	0.00
	合计	199,340,000.00	199,340,000.00	0.00
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		3,775,422,674.37	4,216,486,913.66	441,064,239.29
项目		上年度末 2008年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,192,229,939.23	3,532,713,366.84	-659,516,572.39
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	135,071,840.00	136,454,000.00	1,382,160.00
	合计	135,071,840.00	136,454,000.00	1,382,160.00
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		4,327,301,779.23	3,669,167,366.84	-658,134,412.39

注：

1. 于 2009 年 12 月 31 日，股票投资余额中无按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票(2008 年 12 月 31 日：106,201,785.69 元，采用该估值技术的股票投资于 2008 年度利润表中确认的公允价值变动损失为 179,313,160.40 元)。

2、债券投资中银行间同业市场交易债券均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公司独立提供。采用该估值技术的银行间同业市场交易债券于本年度利润表中确认的公允价值变动损失为 1,382,160.00 元(2008 年度：公允

价值变动收益 1,064,660.00 元)。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日			
	名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	—	—	
项目	上年度末 2008年12月31日			
	名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	1,235,832.99	—	成本:1,300,931.64
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	1,235,832.99	—	

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	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	61,923.29	63,528.03
应收结算备付金利息	1,666.50	6,049.34
应收债券利息	406,153.85	2,837,309.59
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
其他	—	—

合计	469,743.64	2,906,886.96
----	------------	--------------

7.4.7.6 其他资产

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	上年度末 2008年12月31日
交易所市场应付交易费用	3,946,860.69	2,439,396.57
银行间市场应付交易费用	650.00	4,000.00
合计	3,947,510.69	2,443,396.57

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	1,750,000.00	1,750,000.00
应付赎回费	3,710.67	1,637.71
预提审计费	110,000.00	132,000.00
预提信息披露费	540,000.00	340,000.00
合计	2,403,710.67	2,223,637.71

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2009年01月01日-2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,358,598,817.57	5,358,598,817.57
本期申购	498,552,177.59	498,552,177.59
本期赎回	-1,627,870,159.05	-1,627,870,159.05
本期末	4,229,280,836.11	4,229,280,836.11

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

7.4.7.10 未分配利润

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
上年度末	-484,571,309.87	-929,357,207.89	-1,413,928,517.76
本期利润	622,503,487.77	1,099,263,750.33	1,721,767,238.10
本期基金份额交易产生的变动数	-10,546,992.99	-69,906,250.02	-80,453,243.01
其中：基金申购款	-22,119,864.87	11,490,753.51	-10,629,111.36
基金赎回款	11,572,871.88	-81,397,003.53	-69,824,131.65
本期已分配利润	—	—	—
本期末	127,385,184.91	100,000,292.42	227,385,477.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
活期存款利息收入	6,196,405.14	9,672,155.01
结算备付金利息收入	133,396.00	156,802.16
其他	—	—
合计	6,329,801.14	9,828,957.17

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
卖出股票成交总额	15,270,134,531.83	10,356,902,051.59
减：卖出股票成本总额	14,537,506,143.71	11,699,973,831.32
买卖股票差价收入	732,628,388.12	-1,343,071,779.73

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
卖出债券、债转股及债券到期 兑付成交总额	919,057,104.64	4,107,559,908.10
减：卖出债券、债转股及债券 到期兑付成本总额	921,039,731.80	4,026,212,108.28
减：应收利息总额	11,347,039.88	75,646,568.02
债券投资收益	-13,329,667.04	5,701,231.80

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
卖出权证成交总额	1,607,964.34	36,868,110.20
减：卖出权证成本总额	1,300,931.64	31,226,185.95
买卖权证差价收入	307,032.70	5,641,924.25

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
股票投资产生的股利收益	17,819,920.47	20,634,189.19
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	17,819,920.47	20,634,189.19

7.4.7.16 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 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
1.交易性金融资产	1,099,198,651.68	-1,851,351,052.35
——股票投资	1,100,580,811.68	-1,852,384,974.82
——债券投资	-1,382,160.00	1,033,922.47
——资产支持证券投资	—	—
2.衍生工具	65,098.65	-106,760.30
——权证投资	65,098.65	-106,760.30
3.其他	—	—
合计	1,099,263,750.33	-1,851,457,812.65

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
基金赎回费收入	466,175.57	2,779,847.08
转换费收入	22,195.14	93,443.56
其他收入	5,820.08	92,790.81
合计	494,190.79	2,966,081.45

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、本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用中的25%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01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
交易所市场交易费用	45,100,302.56	59,183,784.66
银行间市场交易费用	7,825.00	16,400.00

合计	45,108,127.56	59,200,184.66
----	---------------	---------------

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009年 12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年 12月31日
审计费用	110,000.00	132,000.00
信息披露费	300,000.00	267,714.08
其他费用	21,434.74	33,345.75
合计	431,434.74	433,059.83

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

本基金的基金管理人于 2010 年 1 月 14 日宣告分红，向截至 2010 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人友邦华泰基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.3 元。

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

注：

1、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。

2、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。

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

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日-2008年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	3,785,919,137.92	13.02%	3,613,427,034.31	17.43%
华泰联合证券有限责任公司	304,285,452.76	1.05%	734,971,102.28	3.54%

7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日-2008年12月31日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	—	—	11,585,857.81	31.43%
华泰联合证券有限责任公司	—	—	—	—

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日-2008年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券股份有限公司	108,510,681.80	50.64%	30,884,234.60	28.23%
华泰联合证券有限责任公司	—	—	—	—

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
华泰证券股份有限公司	3,218,014.40	13.19%	1,118,637.33	28.34%
华泰联合证券有限责任公司	247,233.99	1.01%	160,666.39	4.07%
关联方名称	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
华泰证券股份有限公司	3,071,397.48	17.65%	402,236.79	16.49%
华泰联合证券有限责任公司	597,168.78	3.43%	—	—

注：

1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。权证交易不计佣金。

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

3、关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

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01月01日-2009 年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	72,052,205.02	84,671,171.87
其中：支付销售机构的客户维护费	8,689,090.03	10,667,213.51

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1.50%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2009年01月01日-2009 年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	12,008,700.85	14,111,862.04

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0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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。

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

单位：人民币元

本期 2009年01月01日-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
中国银行股份有限公司	178,464,680.44	213,498,441.28	—	—	—	—
上年度可比期间 2008年01月01日-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
中国银行股份有限公司	1,197,645,479.91	—	—	—	—	—

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

份额单位：份

项目	本期 2009年01月01日-2009年12月 31日	上年度可比期间 2008年01月01日-2008年12 月31日
基金合同生效日（2007年05月29日）持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	4,661,072.26	—
期间申购/买入总份额	—	4,661,072.26
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	4,661,072.26	4,661,072.26
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.11%	0.09%

7.4.10.4.2 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

注：本报告期及2008年度，基金管理公司的主要股东及其控制的机构未投资本基金。

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01月01日-2009年12月31 日		上年度可比期间 2008年01月01日-2008年12月31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	233,267,203.33	6,196,405.14	261,625,661.15	9,672,155.01

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.11 利润分配情况

本年度无利润分配情况。本基金于资产负债表日后宣告分红情况见附注 7.4.8.2。

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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300002	神州泰岳	2009/09/29	2010/02/01	网下新股申购	58.00	105.20	11,389	660,562.00	1,198,122.80	-
300001	特锐德	2009/09/29	2010/02/01	网下新股申购	23.80	42.24	12,797	304,568.60	540,545.28	-
601117	中国化学	2009/12/29	2010/01/07	网上新股申购	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
002333	罗普斯金	2009/12/30	2010/01/12	网上新股申购	22.00	22.00	500	11,000.00	11,000.00	-
002332	仙琚制药	2009/12/30	2010/01/12	网上新股申购	8.20	8.20	500	4,100.00	4,100.00	-

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000709	唐钢股份	2009/12/16	吸收合并	7.09	2010/01/25	6.60	6,936,128	49,177,147.52	49,177,147.52	复牌后更名为河北钢铁
000623	吉林敖东	2009/12/28	公告重大事项	49.19	2010/01/11	54.11	357,198	15,821,275.65	17,570,569.62	-
600739	辽宁成大	2009/12/28	公告重大事项	38.09	2010/01/11	41.90	345,368	10,760,093.28	13,155,067.12	-

注：1、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

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

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。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“风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益”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内。

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；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。

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（2008 年 12 月 31 日：同）。

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，其余亦可在银行间同业市场交易，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

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	233,267,203.33						233,267,203.33
结算备付金	4,328,431.92						4,328,431.92
存出保证金						4,654,930.07	4,654,930.07
交易性金融资产		199,340,000.00				4,017,146,913.66	4,216,486,913.66
衍生金融资产							
应收证券清算款						22,411,526.72	22,411,526.72
应收利息						469,743.64	469,743.64
应收申购款	317,010.84						317,010.84
资产总计	237,912,646.09	199,340,000.00	—	—	—	4,044,683,114.09	4,481,935,760.18
负债							
应付证券清算款							
应付赎回款						12,349,506.51	12,349,506.51
应付管理人报酬						5,630,330.45	5,630,330.45
应付托管费						938,388.42	938,388.42
应付交易费用						3,947,510.69	3,947,510.69
其他负债						2,403,710.67	2,403,710.67
负债总计	—	—	—	—	—	25,269,446.74	25,269,446.74
利率敏感度缺口	237,912,646.09	199,340,000.00	—	—	—	4,019,413,667.35	4,456,666,313.44
上年度末2008	1个月以内	1-3	3个月	1-5	5年以上	不计息	合计

年12月31日		个月	-1年	年			
资产							
银行存款	261,625,661.15						261,625,661.15
结算备付金	12,472,858.12						12,472,858.12
存出保证金						1,594,493.38	1,594,493.38
交易性金融资产			136,454,000.00			3,532,713,366.84	3,669,167,366.84
衍生金融资产						1,235,832.99	1,235,832.99
应收证券清算款						38,301,033.51	38,301,033.51
应收利息						2,906,886.96	2,906,886.96
应收申购款	108,091.78						108,091.78
资产总计	274,206,611.05	—	136,454,000.00	—	—	3,576,751,613.68	3,987,412,224.73
负债							
应付证券清算款						31,161,445.48	31,161,445.48
应付赎回款						723,779.06	723,779.06
应付管理人报酬						5,305,428.08	5,305,428.08
应付托管费						884,238.02	884,238.02
应付交易费用						2,443,396.57	2,443,396.57
其他负债						2,223,637.71	2,223,637.71
负债总计	—	—	—	—	—	42,741,924.92	42,741,924.92
利率敏感度缺口	274,206,611.05	—	136,454,000.00	—	—	3,534,009,688.76	3,944,670,299.81

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 4.47%(2008 年 12 月 31 日：3.46%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2008 年 12 月 31 日：同)。

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资产占基金资产的 30%-95%；现金、债券资产、权证以及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%-70%，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 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日		上年度末 2008年12月31日	
	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	4,017,146,913.66	90.14	3,532,713,366.84	89.56
衍生金融资产—权证投资	—	—	1,235,832.99	0.03
其他	—	—	—	—
合计	4,017,146,913.66	90.14	3,533,949,199.83	89.59

7.4.13.4.3.2 其他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：人民币亿元）	
		本期末	上年度末
	沪深300指数上涨5%	1.87	1.67
	沪深300指数下跌5%	-1.87	-1.67

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	4,017,146,913.66	89.63
	其中：股票	4,017,146,913.66	89.63
2	固定收益投资	199,340,000.00	4.45
	其中：债券	199,340,000.00	4.45
	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	237,595,635.25	5.30
6	其他资产	27,853,211.27	0.62
7	合计	4,481,935,760.18	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	72,972,815.35	1.64
B	采掘业	363,771,555.01	8.16
C	制造业	1,685,929,784.97	37.83
C0	食品、饮料	263,768,097.25	5.92
C1	纺织、服装、皮毛	54,147,880.35	1.21
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	6,758,923.23	0.15
C4	石油、化学、塑胶、塑料	196,216,187.70	4.40
C5	电子	61,575,149.07	1.38
C6	金属、非金属	468,368,875.08	10.51
C7	机械、设备、仪表	395,239,577.00	8.87
C8	医药、生物制品	182,519,306.13	4.10

C99	其他制造业	57,335,789.16	1.29
D	电力、煤气及水的生产和供应业	94,747,427.09	2.13
E	建筑业	47,639,807.30	1.07
F	交通运输、仓储业	111,480,237.94	2.50
G	信息技术业	68,384,226.26	1.53
H	批发和零售贸易	223,083,659.53	5.01
I	金融、保险业	1,006,423,573.38	22.58
J	房地产业	217,793,771.38	4.89
K	社会服务业	76,020.00	0.00
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	124,844,035.45	2.80
	合计	4,017,146,913.66	90.14

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	600036	招商银行	8,936,726	161,307,904.30	3.62
2	601169	北京银行	8,078,170	156,231,807.80	3.51
3	601166	兴业银行	3,620,013	145,922,724.03	3.27
4	000001	深发展 A	4,930,442	120,154,871.54	2.70
5	600694	大商股份	1,966,176	86,098,847.04	1.93
6	600000	浦发银行	3,958,720	85,864,636.80	1.93
7	600015	华夏银行	6,582,597	81,755,854.74	1.83
8	600016	民生银行	10,202,316	80,700,319.56	1.81
9	000537	广宇发展	5,646,084	80,626,079.52	1.81
10	601318	中国平安	1,334,325	73,507,964.25	1.65
11	600348	国阳新能	1,459,950	70,617,781.50	1.58
12	002110	三钢闽光	3,721,206	67,204,980.36	1.51
13	000538	云南白药	1,068,435	64,533,474.00	1.45
14	000780	平庄能源	3,782,275	57,566,225.50	1.29
15	000969	安泰科技	2,161,983	57,335,789.16	1.29
16	600887	*ST 伊利	2,143,614	56,762,898.72	1.27

17	600971	恒源煤电	1,608,479	54,430,929.36	1.22
18	600511	国药股份	2,048,418	52,439,500.80	1.18
19	601699	潞安环能	998,602	51,707,611.56	1.16
20	000709	唐钢股份	6,936,128	49,177,147.52	1.10
21	000898	鞍钢股份	2,886,127	46,178,032.00	1.04
22	002024	苏宁电器	2,024,516	42,069,442.48	0.94
23	600362	江西铜业	1,001,204	40,258,412.84	0.90
24	601168	西部矿业	2,553,000	37,529,100.00	0.84
25	000858	五 粮 液	1,182,300	37,431,618.00	0.84
26	600075	新疆天业	3,847,090	36,316,529.60	0.81
27	600030	中信证券	1,139,908	36,214,877.16	0.81
28	000562	宏源证券	1,497,679	35,644,760.20	0.80
29	600540	新赛股份	2,647,440	35,158,003.20	0.79
30	000807	云铝股份	2,537,550	34,485,304.50	0.77
31	601088	中国神华	982,671	34,216,604.22	0.77
32	600809	山西汾酒	777,130	33,362,190.90	0.75
33	002165	红 宝 丽	1,158,944	32,149,106.56	0.72
34	600317	营口港	3,867,252	32,059,519.08	0.72
35	600849	上海医药	2,230,874	31,232,236.00	0.70
36	600519	贵州茅台	173,934	29,537,471.88	0.66
37	000983	西山煤电	730,043	29,121,415.27	0.65
38	000878	云南铜业	943,489	28,880,198.29	0.65
39	600415	小商品城	616,400	27,571,572.00	0.62
40	002202	金风科技	934,901	26,794,262.66	0.60
41	600309	烟台万华	1,111,401	26,684,738.01	0.60
42	600987	航民股份	2,960,073	26,611,056.27	0.60
43	000792	盐湖钾肥	459,182	26,168,782.18	0.59
44	000568	泸州老窖	630,500	24,614,720.00	0.55
45	600588	用友软件	874,077	24,176,969.82	0.54
46	600125	铁龙物流	2,159,452	23,775,566.52	0.53
47	000060	中金岭南	830,203	23,162,663.70	0.52
48	600837	海通证券	1,200,000	23,028,000.00	0.52
49	600416	湘电股份	943,792	22,745,387.20	0.51
50	600600	青岛啤酒	595,575	22,399,575.75	0.50

51	000869	张 裕 A	287,664	21,868,217.28	0.49
52	600839	四川长虹	3,320,907	21,785,149.92	0.49
53	000533	万 家 乐	1,928,344	21,539,602.48	0.48
54	600219	南山铝业	1,571,000	20,784,330.00	0.47
55	600048	保利地产	913,700	20,466,880.00	0.46
56	000550	江铃汽车	883,185	20,295,591.30	0.46
57	000157	中联重科	759,911	19,765,285.11	0.44
58	600782	新钢股份	2,147,148	19,238,446.08	0.43
59	600115	ST 东航	2,929,807	18,047,611.12	0.41
60	000155	川化股份	1,961,234	17,572,656.64	0.39
61	000623	吉林敖东	357,198	17,570,569.62	0.39
62	002037	久联发展	941,800	17,404,464.00	0.39
63	600019	宝钢股份	1,788,600	17,277,876.00	0.39
64	000418	小天鹅 A	1,167,714	17,083,655.82	0.38
65	000024	招商地产	632,300	16,838,149.00	0.38
66	600011	华能国际	2,099,114	16,813,903.14	0.38
67	600303	曙光股份	1,143,710	16,446,549.80	0.37
68	600533	栖霞建设	2,434,902	16,338,192.42	0.37
69	000002	万 科 A	1,503,400	16,251,754.00	0.36
70	600393	东华实业	1,387,810	16,043,083.60	0.36
71	002170	芭田股份	1,543,251	15,849,187.77	0.36
72	600325	华发股份	842,608	15,790,473.92	0.35
73	600376	首开股份	798,300	15,710,544.00	0.35
74	600166	福田汽车	815,000	15,525,750.00	0.35
75	000957	中通客车	1,433,938	15,228,421.56	0.34
76	002065	东华软件	643,039	14,944,226.36	0.34
77	000528	柳 工	687,543	14,940,309.39	0.34
78	000422	湖北宣化	693,598	14,808,317.30	0.33
79	600425	青松建化	651,400	14,695,584.00	0.33
80	000338	潍柴动力	214,761	13,847,789.28	0.31
81	000006	深振业 A	1,220,944	13,833,295.52	0.31
82	000911	南宁糖业	581,938	13,669,723.62	0.31
83	600686	金龙汽车	1,225,576	13,444,568.72	0.30
84	600718	东软集团	592,769	13,402,507.09	0.30

85	601919	中国远洋	950,857	13,216,912.30	0.30
86	600739	辽宁成大	345,368	13,155,067.12	0.30
87	000558	莱茵置业	1,646,994	13,093,602.30	0.29
88	600509	天富热电	1,367,964	12,954,619.08	0.29
89	601808	中海油服	780,300	12,687,678.00	0.28
90	600591	*ST 上航	1,762,705	12,673,848.95	0.28
91	600859	王府井	343,140	12,658,434.60	0.28
92	600031	三一重工	343,627	12,648,909.87	0.28
93	600375	星马汽车	831,452	12,388,634.80	0.28
94	000012	南 玻 A	614,382	12,041,887.20	0.27
95	000050	深天马 A	1,771,213	11,778,566.45	0.26
96	002209	达 意 隆	657,973	11,705,339.67	0.26
97	000651	格力电器	398,800	11,541,272.00	0.26
98	000932	华菱钢铁	1,482,881	11,373,697.27	0.26
99	600165	宁夏恒力	1,398,052	11,338,201.72	0.25
100	600068	葛洲坝	933,920	10,936,203.20	0.25
101	002063	远光软件	469,047	10,680,200.19	0.24
102	600820	隧道股份	765,700	10,635,573.00	0.24
103	002208	合肥城建	478,240	10,272,595.20	0.23
104	002154	报 喜 鸟	449,563	10,142,141.28	0.23
105	002137	实 益 达	994,704	9,857,516.64	0.22
106	600064	南京高科	386,400	9,830,016.00	0.22
107	002029	七 匹 狼	420,600	9,762,126.00	0.22
108	600021	上海电力	1,662,735	9,643,863.00	0.22
109	600027	华电国际	1,792,500	9,625,725.00	0.22
110	600396	金山股份	1,099,979	9,580,817.09	0.22
111	000966	长源电力	1,772,741	9,537,346.58	0.21
112	600098	广州控股	1,286,999	9,523,792.60	0.21
113	000042	深 长 城	422,724	9,439,426.92	0.21
114	600863	内蒙华电	1,245,500	9,428,435.00	0.21
115	600240	华业地产	1,145,100	9,321,114.00	0.21
116	600785	新华百货	326,891	9,280,435.49	0.21
117	600246	万通地产	923,100	9,249,462.00	0.21
118	600741	华域汽车	797,950	9,240,261.00	0.21

119	002081	金 螳 螂	298,001	9,208,230.90	0.21
120	600970	中材国际	243,700	9,058,329.00	0.20
121	000755	山西三维	921,800	9,033,640.00	0.20
122	600889	南京化纤	901,700	8,818,626.00	0.20
123	000949	新乡化纤	1,229,038	8,763,040.94	0.20
124	000401	冀东水泥	446,000	8,607,800.00	0.19
125	600819	耀皮玻璃	980,062	8,369,729.48	0.19
126	600449	赛马实业	219,536	8,182,106.72	0.18
127	000559	万向钱潮	1,057,900	8,166,988.00	0.18
128	600881	亚泰集团	891,800	8,097,544.00	0.18
129	000885	同力水泥	571,406	8,085,394.90	0.18
130	002146	荣盛发展	383,800	7,948,498.00	0.18
131	002244	滨江集团	548,450	7,936,071.50	0.18
132	000895	双汇发展	148,871	7,905,050.10	0.18
133	600266	北京城建	436,080	7,801,471.20	0.18
134	601588	北辰实业	1,314,100	7,792,613.00	0.17
135	002039	黔源电力	415,159	7,638,925.60	0.17
136	000982	中银绒业	671,880	7,632,556.80	0.17
137	000739	普洛股份	721,299	7,212,990.00	0.16
138	600291	西水股份	428,200	7,082,428.00	0.16
139	600480	凌云股份	531,049	7,062,951.70	0.16
140	600812	华北制药	595,264	6,964,588.80	0.16
141	000597	东北制药	263,700	6,943,221.00	0.16
142	002026	山东威达	531,400	6,844,432.00	0.15
143	002001	新 和 成	139,574	6,825,168.60	0.15
144	600178	东安动力	406,013	6,825,078.53	0.15
145	600664	哈药股份	369,300	6,820,971.00	0.15
146	002105	信隆实业	904,809	6,758,923.23	0.15
147	002048	宁波华翔	477,500	6,723,200.00	0.15
148	000903	云内动力	492,500	6,712,775.00	0.15
149	600685	广船国际	252,999	6,701,943.51	0.15
150	002031	巨轮股份	515,900	6,618,997.00	0.15
151	601766	中国南车	1,162,900	6,616,901.00	0.15
152	600760	东安黑豹	787,469	6,598,990.22	0.15

153	000527	美的电器	278,287	6,456,258.40	0.14
154	600218	全柴动力	670,548	6,410,438.88	0.14
155	000655	金岭矿业	335,975	6,343,208.00	0.14
156	000521	美菱电器	478,800	6,286,644.00	0.14
157	000404	华意压缩	735,600	6,223,176.00	0.14
158	600336	澳柯玛	802,916	6,206,540.68	0.14
159	600690	青岛海尔	249,486	6,184,757.94	0.14
160	000783	长江证券	315,700	6,089,853.00	0.14
161	000970	中科三环	632,650	5,826,706.50	0.13
162	002056	横店东磁	382,051	5,646,713.78	0.13
163	002035	华帝股份	604,900	5,625,570.00	0.13
164	000425	徐工机械	157,000	5,513,840.00	0.12
165	600366	宁波韵升	356,500	5,472,275.00	0.12
166	600497	驰宏锌锗	200,000	5,290,000.00	0.12
167	000062	深圳华强	508,529	5,171,739.93	0.12
168	000876	新 希 望	374,520	5,160,885.60	0.12
169	000061	农 产 品	338,900	4,703,932.00	0.11
170	600123	兰花科创	100,000	4,374,000.00	0.10
171	000952	广济药业	299,965	4,316,496.35	0.10
172	002185	华天科技	394,700	4,254,866.00	0.10
173	002156	通富微电	351,581	4,176,782.28	0.09
174	600221	海南航空	619,352	4,118,690.80	0.09
175	002119	康强电子	421,900	4,075,554.00	0.09
176	000963	华东医药	219,000	4,029,600.00	0.09
177	600270	外运发展	434,523	3,819,457.17	0.09
178	600351	亚宝药业	228,384	3,811,728.96	0.09
179	600676	交运股份	455,400	3,802,590.00	0.09
180	600737	中粮屯河	225,300	3,773,775.00	0.08
181	000099	中信海直	484,400	3,768,632.00	0.08
182	600993	马应龙	98,200	3,764,988.00	0.08
183	002118	紫鑫药业	188,200	3,701,894.00	0.08
184	000999	三九医药	184,100	3,674,636.00	0.08
185	600582	天地科技	99,944	3,473,054.00	0.08
186	000612	焦作万方	119,971	3,359,188.00	0.08

187	000661	长春高新	121,400	3,243,808.00	0.07
188	600573	惠泉啤酒	284,960	3,217,198.40	0.07
189	002252	上海莱士	85,330	3,164,036.40	0.07
190	002022	科华生物	144,200	3,156,538.00	0.07
191	600226	升华拜克	253,200	3,086,508.00	0.07
192	600195	中牧股份	143,600	2,910,772.00	0.07
193	002038	双鹭药业	64,500	2,863,800.00	0.06
194	600071	凤凰光学	361,800	2,778,624.00	0.06
195	000829	天音控股	200,000	2,678,000.00	0.06
196	600508	上海能源	100,000	2,515,000.00	0.06
197	600742	一汽富维	80,000	2,240,800.00	0.05
198	600050	中国联通	300,000	2,187,000.00	0.05
199	600595	中孚实业	80,000	2,079,200.00	0.05
200	002274	华昌化工	100,000	1,989,000.00	0.04
201	600607	上实医药	84,500	1,895,335.00	0.04
202	000937	金牛能源	44,981	1,871,209.60	0.04
203	600231	凌钢股份	142,500	1,855,350.00	0.04
204	000933	神火股份	50,000	1,844,000.00	0.04
205	000800	一汽轿车	69,945	1,819,968.90	0.04
206	600535	天士力	81,200	1,818,880.00	0.04
207	000043	中航地产	120,000	1,815,600.00	0.04
208	600557	康缘药业	85,700	1,795,415.00	0.04
209	600657	信达地产	160,000	1,795,200.00	0.04
210	000625	长安汽车	120,000	1,683,600.00	0.04
211	000667	名流置业	200,000	1,638,000.00	0.04
212	600883	博闻科技	150,000	1,561,500.00	0.04
213	002069	獐子岛	39,901	1,498,282.55	0.03
214	300002	神州泰岳	11,389	1,198,122.80	0.03
215	000893	东凌粮油	40,000	1,154,000.00	0.03
216	300001	特锐德	12,797	540,545.28	0.01
217	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.00
218	002333	罗普斯金	500	11,000.00	0.00
219	002332	仙琚制药	500	4,100.00	0.00

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	000878	云南铜业	507,652,886.57	12.87
2	600015	华夏银行	388,297,728.50	9.84
3	601166	兴业银行	381,423,252.19	9.67
4	601169	北京银行	355,685,683.98	9.02
5	601318	中国平安	324,692,322.72	8.23
6	600036	招商银行	319,211,586.45	8.09
7	600362	江西铜业	297,570,437.34	7.54
8	600887	*ST 伊利	265,166,279.92	6.72
9	601919	中国远洋	241,490,278.58	6.12
10	000060	中金岭南	238,374,510.89	6.04
11	600016	民生银行	233,783,916.60	5.93
12	601088	中国神华	228,978,732.73	5.80
13	000001	深发展 A	225,482,322.11	5.72
14	601001	大同煤业	222,338,723.71	5.64
15	600050	中国联通	220,657,070.49	5.59
16	000983	西山煤电	205,376,684.94	5.21
17	000898	鞍钢股份	178,447,641.79	4.52
18	601699	潞安环能	170,931,023.86	4.33
19	600048	保利地产	169,272,923.82	4.29
20	600694	大商股份	169,092,718.80	4.29
21	000969	安泰科技	168,407,195.72	4.27
22	600383	金地集团	157,025,694.61	3.98
23	600219	南山铝业	154,617,047.50	3.92
24	000562	宏源证券	151,789,328.73	3.85
25	000538	云南白药	145,578,528.72	3.69
26	000002	万 科 A	134,106,470.12	3.40
27	600001	邯郸钢铁	133,510,908.66	3.38
28	600331	宏达股份	130,904,208.28	3.32
29	600497	驰宏锌锗	121,220,530.59	3.07
30	000960	锡业股份	111,757,394.21	2.83
31	600550	天威保变	111,668,634.08	2.83
32	600519	贵州茅台	105,279,507.38	2.67
33	600432	吉恩镍业	102,159,913.40	2.59
34	600325	华发股份	99,737,046.19	2.53
35	000402	金 融 街	98,310,626.70	2.49

36	600348	国阳新能	97,416,414.05	2.47
37	601958	金钼股份	94,848,767.95	2.40
38	601398	工商银行	94,368,432.25	2.39
39	600123	兰花科创	93,924,058.40	2.38
40	600533	栖霞建设	93,476,842.74	2.37
41	600236	桂冠电力	92,184,336.39	2.34
42	002110	三钢闽光	88,999,522.10	2.26
43	600000	浦发银行	87,398,951.26	2.22
44	600337	美克股份	86,313,067.67	2.19
45	600030	中信证券	84,003,112.24	2.13
46	600585	海螺水泥	81,201,240.65	2.06

注：不考虑相关交易费用。

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	000878	云南铜业	492,748,327.23	12.49
2	600887	*ST 伊利	454,812,371.74	11.53
3	600362	江西铜业	349,218,080.04	8.85
4	600015	华夏银行	333,429,608.91	8.45
5	601318	中国平安	330,338,026.96	8.37
6	601001	大同煤业	307,671,937.47	7.80
7	600036	招商银行	304,044,119.13	7.71
8	000983	西山煤电	296,506,488.87	7.52
9	600519	贵州茅台	288,333,683.27	7.31
10	000060	中金岭南	281,334,012.21	7.13
11	601088	中国神华	275,047,941.89	6.97
12	601169	北京银行	270,614,851.53	6.86
13	601919	中国远洋	267,108,574.95	6.77
14	000969	安泰科技	265,650,764.26	6.73
15	600050	中国联通	261,505,496.59	6.63
16	600694	大商股份	237,284,967.39	6.02
17	601166	兴业银行	216,980,764.32	5.50
18	600030	中信证券	200,386,921.82	5.08
19	600236	桂冠电力	185,420,948.90	4.70
20	600511	国药股份	180,632,081.75	4.58
21	600048	保利地产	179,005,274.83	4.54

22	600547	山东黄金	178,400,437.51	4.52
23	600016	民生银行	168,661,225.62	4.28
24	600900	长江电力	161,604,826.81	4.10
25	600383	金地集团	158,784,990.03	4.03
26	000002	万 科 A	142,331,671.44	3.61
27	600331	宏达股份	141,771,863.36	3.59
28	600550	天威保变	140,727,679.63	3.57
29	600219	南山铝业	138,910,520.43	3.52
30	601699	潞安环能	138,331,847.70	3.51
31	000001	深发展 A	138,295,025.60	3.51
32	000402	金 融 街	136,496,635.00	3.46
33	000898	鞍钢股份	129,476,994.00	3.28
34	000538	云南白药	129,260,042.42	3.28
35	600585	海螺水泥	128,168,220.52	3.25
36	000562	宏源证券	119,026,288.63	3.02
37	600123	兰花科创	115,088,619.41	2.92
38	600497	驰宏锌锗	114,634,837.80	2.91
39	601398	工商银行	109,073,483.96	2.77
40	600583	海油工程	108,538,502.46	2.75
41	000966	长源电力	107,951,386.24	2.74
42	000960	锡业股份	105,571,200.12	2.68
43	600001	邯郸钢铁	103,093,812.17	2.61
44	600337	美克股份	101,947,494.87	2.58
45	601958	金钼股份	100,370,561.25	2.54
46	000418	小天鹅 A	98,544,211.23	2.50
47	601808	中海油服	96,857,794.05	2.46
48	600004	白云机场	95,932,974.08	2.43
49	600432	吉恩镍业	92,903,004.87	2.36
50	600026	中海发展	92,563,327.08	2.35
51	600576	万好万家	90,936,794.48	2.31
52	600009	上海机场	90,801,614.13	2.30
53	601857	中国石油	90,102,683.02	2.28
54	000792	盐湖钾肥	88,244,350.59	2.24
55	000768	西飞国际	87,767,026.23	2.22
56	600033	福建高速	85,987,497.07	2.18
57	600533	栖霞建设	81,982,345.12	2.08
58	600664	哈药股份	81,067,824.53	2.06

注：不考虑相关交易费用。

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

买入股票成本（成交）总额	13,921,555,168.85
卖出股票收入（成交）总额	15,270,134,531.83

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

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	199,340,000.00	4.47
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	199,340,000.00	4.47

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	0901055	09 央票 55	2,000,000	199,340,000.00	4.47

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	4,654,930.07
2	应收证券清算款	22,411,526.72
3	应收股利	—
4	应收利息	469,743.64
5	应收申购款	317,010.84
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	27,853,211.27

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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	占总份	持有	占总份

		份额	额比例	份额	额比例
148,439	28,491.71	422,358,736.60	9.99%	3,806,922,099.51	90.01%

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

份额单位：份

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	1,282,114.42	0.03%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年05月29日)基金份额总额	8,921,315,668.58
本报告期期初基金份额总额	5,358,598,817.57
本报告期基金总申购份额	498,552,177.59
减：本报告期基金总赎回份额	1,627,870,159.05
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,229,280,836.11

§ 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

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为110,000元人民币，该事务所已向本基金提供了3年的审计服务。

11.6 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。

11.7 本期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	
		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(%)
银河证券	1	5,450,953,107.73	18.74	4,633,293.29	18.99
华泰证券	1	3,785,919,137.92	13.02	3,218,014.40	13.19
国信证券	1	2,643,792,233.05	9.09	2,148,094.01	8.81
东方证券	1	2,505,364,878.09	8.61	2,129,553.62	8.73
中信证券	1	2,405,086,166.40	8.27	2,044,313.14	8.38
广发证券	1	2,222,268,254.43	7.64	1,888,919.86	7.74
海通证券	1	2,093,072,454.61	7.20	1,700,633.72	6.97
山西证券	1	1,711,951,120.24	5.89	1,390,977.37	5.70
中金公司	1	1,476,552,441.65	5.08	1,255,065.10	5.15
招商证券	1	1,327,050,082.88	4.56	1,078,236.82	4.42
申银万国	1	1,184,030,302.32	4.07	1,006,421.79	4.13
财通证券	1	606,054,718.63	2.08	515,147.67	2.11
南京证券	1	602,921,018.28	2.07	512,480.65	2.10
国泰君安	1	488,286,137.75	1.68	396,736.91	1.63
华泰联合	1	304,285,452.76	1.05	247,233.99	1.01

方正证券	1	280,774,309.36	0.97	228,131.19	0.94
国金证券	1	—	—	—	—

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	交易 单元 数量	债券交易	
		成交金额	占当期成交总额的比例（%）
华泰证券	1	108,510,681.80	50.64
中信证券	1	48,036,147.20	22.42
广发证券	1	32,112,242.30	14.99
银河证券	1	21,289,982.30	9.94
东方证券	1	3,348,958.20	1.56
中金公司	1	986,225.50	0.46
券商名称	交易 单元 数量	权证交易	
		成交金额	占当期成交总额的比例（%）
中信证券	1	1,607,964.34	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，并能为基金提供全面的信息服。
- 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、本报告期内，基金管理人代表基金新增租用了方正证券有限责任公司的专用交易单

元。

4、本报告期内，华泰证券股票交易成交金额中包含原信泰证券成交金额1,563,258,016.22元；应支付华泰证券的佣金中包含应支付原信泰证券佣金1,328,761.66元；华泰证券债券交易成交金额108,510,681.80元均为与原信泰证券产生。

11.8 其他重大事件

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	2009-12-31
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	2009-12-31
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	2009-12-31
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	2009-12-10
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	2009-11-20
6	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	2009-11-18
7	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	2009-11-17
8	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年第三季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-10-27
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	2009-10-20
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	2009-9-24
11	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	2009-9-15

12	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	2009-9-8
13	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-8-26
14	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-8-26
15	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	2009-8-25
16	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	2009-8-11
17	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	2009-8-5
18	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	2009-7-28
19	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	2009-7-24
20	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年第二季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-7-20
21	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金更新的招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-7-11
22	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-7-11
23	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	2009-6-26
24	友邦华泰参加深发展网银定投并开展定投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	2009-6-5
25	友邦华泰关于旗下基金持有的长江电力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	2009-5-19
26	友邦华泰参加中国银行网上银行费率优惠及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	2009-5-4
27	友邦华泰关于参加联合证券实行开放式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	2009-4-30
28	友邦华泰积极成长混合型证券投	中国证券报、上海证券报、	2009-4-22

	资基金 2009 年第一季度报告	证券时报	
29	友邦华泰参加工商银行个人网银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	2009-3-31
30	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	2009-3-31
31	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2008 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-3-28
32	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2008 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-3-28
33	友邦华泰参加华夏银行基金定投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	2009-2-27
34	友邦华泰关于参加中国工商银行“基智定投”营销活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-2-25
35	友邦华泰关于参加交通银行网上交易优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-2-25
36	友邦华泰基金关于在东海证券开办基金定期定额业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-2-21
37	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	2009-2-5
38	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2008 年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-1-21
39	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金更新的招募说明书(摘要)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-1-12
40	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金更新的招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-1-12
41	友邦华泰关于在深圳发展银行开办基金定期定额业务并参加定投申购优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-1-10
42	友邦华泰关于调整建行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	2009-1-6
43	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	2009-1-6

§ 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积极成长混合型证券投资基金募集的文件
- 2、《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《友邦华泰积极成长混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《友邦华泰积极成长混合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、友邦华泰积极成长混合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