
友邦华泰价值增长股票型证券投资基金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	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	14
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	14
§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中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6	审计报告	14
§7	年度财务报表	16
7.1	资产负债表	16
7.2	利润表	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	18
7.4	报表附注	20
§8	投资组合报告	41
8.1	期末基金资产组合情况	41
8.2	期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	50
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	56
§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	57
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	57
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
11.8	其他重大事件	59
§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	62
13.2	存放地点	62
13.3	查阅方式	62

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金
基金简称	友邦华泰价值增长股票
交易代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年07月16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	550,435,012.30
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于市场估值相对较低、基本面良好、能够为股东持续创造价值的公司，重点关注其中基本面有良性变化、市场认同度逐步提高的优质个股，在充分控制投资组合风险的前提下，实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基于对宏观经济和投资环境的分析和预测，全面评估证券市场各大类资产的中长期预期风险收益率，确定基金资产在股票、债券和现金及其他资产之间的配置比例，适度控制系统性风险。 主要通过积极主动地精选为股东持续创造价值的股票来获取超额收益。重点投资于基本面趋势良好或出现良性转折、价格相对低估、基本面趋势认同度逐步或加速提高的优质股票，辅以适度的行业配置调整来优化股票的选择和配置的权重。
业绩比较基准	沪深300指数×80%+上证国债指数×20%
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 负责人	姓名	陈晖	唐州徽
	联系电话	021-38601777	010-66594855
	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7月16日-2008年12月31日
本期已实现收益	127,587,245.41	-22,751,823.88

本期利润	188,351,071.78	-26,235,753.16
加权平均基金份额本期利润	0.6015	-0.0727
本期加权平均净值利润率	45.30%	-7.44%
本期基金份额净值增长率	75.36%	-7.65%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末
期末可供分配利润	39,027,189.46	-20,997,132.24
期末可供分配基金份额利润	0.0709	-0.0765
期末基金资产净值	706,659,426.99	253,402,879.67
期末基金份额净值	1.2838	0.9235
3.1.3 累计期末指标	2009年末	2008年末
基金份额累计净值增长率	61.94%	-7.65%

- 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2008年7月16日，2008年的主要财务指标根据当天的实际存续期计算。

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

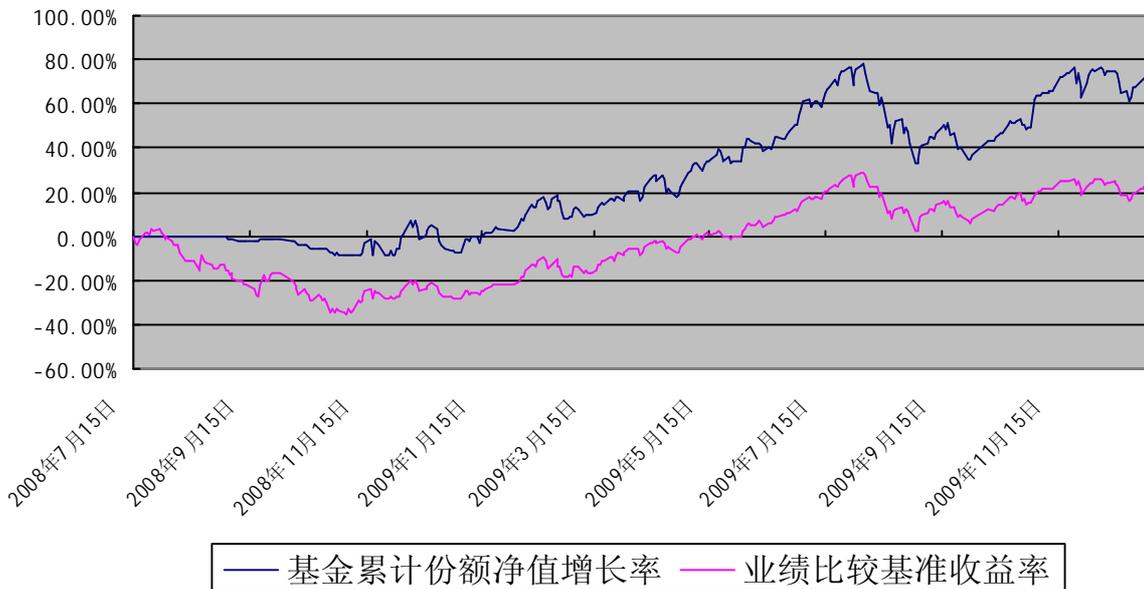
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	18.45%	1.62%	15.23%	1.41%	3.22%	0.21%
过去六个月	7.60%	2.04%	10.92%	1.70%	-3.32%	0.34%
过去一年	75.36%	1.92%	73.60%	1.64%	1.76%	0.28%
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同生效日起至今（2008年07月16	61.94%	1.84%	23.74%	1.94%	38.20%	-0.10%

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

注：本基金的业绩基准由沪深300指数和上证国债指数按照80%与20%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

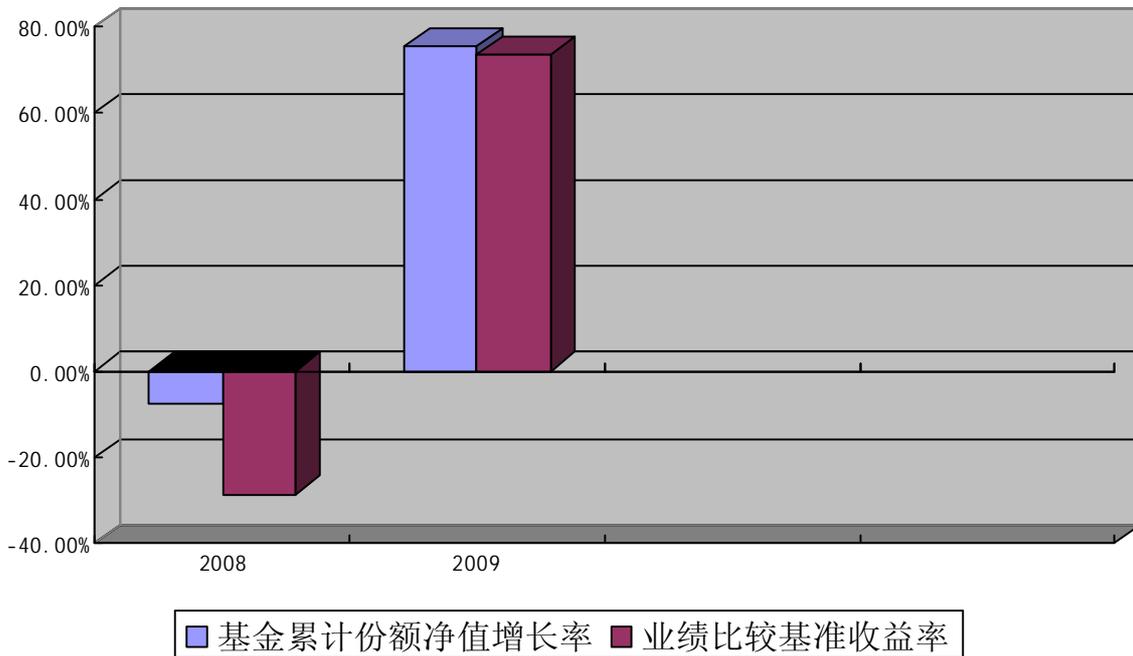
基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2008年7月16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60%-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%-40%。

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2008年7月16日，2008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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009年	3.100	225,901,199.29	23,372,098.66	249,273,297.95	11月2日实施
2008年	—	—	—	—	
合计	3.100	225,901,199.29	23,372,098.66	249,273,297.95	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准，于2004年11月18日成立的合资基金管理公司，注册资本为2亿元人民币。

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		
汪晖	本基金的基金经理、投资部总监	2008年07月16日	—	16年	汪晖先生，硕士。历任华泰证券股份有限公司高级经理、华宝信托投资有限公司信托基金经理、华泰证券股份有限公司投资经理。2004年7月加入友邦华泰基金管理有限公司，历任友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金经理助理、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金经理、友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金基金经理。2008年7月起任友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金经理。2009年8月起任友邦华泰投资部副总监，2009年

					11月18日起兼任友邦盛世基金经理，2009年12月起任友邦华泰投资部总监。
--	--	--	--	--	--

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《友邦华泰价值增长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

2009年，为了应对美国次贷危机对全球实体经济和金融市场的冲击，中国政府实施积极的财政政策和宽松的货币政策，大幅度增加信贷货币投放，扩大投资规模刺激国内需求，成功地抵御了金融危机的不利影响。宏观经济指标逐季向好，经济强劲复苏，全年GDP增速达到8.7%。在市场流动性和经济复苏超预期的刺激下，股票市场呈现牛市行情，沪深300指数涨幅达到96.71%。

上半年宽松的货币政策为市场提供了充裕的流动性，特别是信贷增速强化了投资者对流动性的预期，周期性行业表现出色。本基金较准确把握了股票市场的拐点，大幅度提高股票资产配置，获得较高收益。三季度，央行和银监会从管理通胀的角度考虑，逐步回收流动性、控制信贷规模。市场预期变化导致股市大幅度调整，特别是周期性行业。本基金对政策变化和行业轮动估计不足，遭受一定损失。四季度本基金调整行业配置，增加小市值，防御性行业配置比例，取得较好收益。2009年，本基金净值增长率 75.36%，超越业绩基准1.76个百分点，每份分红0.31元。

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1.2838元，累计净值为1.5938元，本报告期内基金份额净值上涨75.36%，本基金的业绩比较基准上涨73.60%。

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，市场面临因素更加复杂，经济、政策、流动性等各种因素纠结在一起，而且变动趋势和方向出现分歧。从宏观经济和政策相互关系来看，经济复苏态势延续、上市公司利润增速加快，对市场构成一定支撑。但是，为预防经济过热，管理通胀预期，刺激政策逐步退出。货币信贷收紧，流动性预期下降对市场产生不利影响。从市场来看，整体估值水平趋于中性，但行业间估值分化达到历史较高水平。另一方面，流通市值急剧扩张，再融资规模庞大，对估值扩张构成压力。因此，市场趋势性上升机会可能不多，存在着主题性和行业性投资热点，市场可能呈现宽幅振荡格局。

本基金在保持一定仓位，控制风险前提下，强调行业配置和个股精选，把握市场调整后带来的投资机会。

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10%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本报告期内，基金于2009年11月2日分红一次，每份基金份额分红0.31元，总计分配利润249,273,297.95元。

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”）在友邦华泰价值增长股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

普华永道中天审字(2010)第 20174 号

友邦华泰价值增长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价值增长股票型证券投资基金(以下简称“友邦华泰价值增长基金”)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价值增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价值增长基金 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：友邦华泰价值增长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	86,320,701.93	37,836,182.33
结算备付金		4,940,096.33	2,314,207.98
存出保证金		500,000.00	500,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	617,471,855.80	219,249,475.30
其中：股票投资		617,471,855.80	219,249,475.30
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		—	38,967.25
应收利息	7.4.7.5	23,528.50	7,573.45
应收股利		—	—
应收申购款		1,168,011.87	89,073.38
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		710,424,194.43	260,035,479.69
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		—	4,815,157.12
应付赎回款		919,190.02	284,391.53
应付管理人报酬		909,163.05	369,503.35
应付托管费		151,527.16	61,583.88
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	891,442.57	424,940.69
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
其他负债	7.4.7.8	893,444.64	677,023.45
负债合计		3,764,767.44	6,632,600.02
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	550,435,012.30	274,400,011.91
未分配利润	7.4.7.10	156,224,414.69	-20,997,132.24
所有者权益合计		706,659,426.99	253,402,879.67
负债和所有者权益总计		710,424,194.43	260,035,479.69

注：报告截止日2009年12月31日，基金份额净值1.2838元，基金份额总额550,435,012.30份。

7.2 利润表

会计主体：友邦华泰价值增长股票型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年01月01日	上年度可比期间 2008年7月16日-2008
----	-----	-------------------	----------------------------

		-2009年12月31日	年12月31日
一、收入		200,253,131.29	-22,096,454.26
1.利息收入		535,054.61	2,351,298.19
其中：存款利息收入	7.4.7.11	468,169.09	608,248.93
债券利息收入		66,885.52	1,654,706.05
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	88,343.21
2.投资收益		137,803,517.95	-21,175,474.94
其中：股票投资收益	7.4.7.12	135,681,499.94	-18,868,869.10
债券投资收益	7.4.7.13	-478,450.99	-2,457,762.98
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	2,600,469.00	151,157.14
3.公允价值变动收益	7.4.7.16	60,763,826.37	-3,483,929.28
4.其他收入	7.4.7.17	1,150,732.36	211,651.77
减：二、费用		11,902,059.51	4,139,298.90
1. 管理人报酬		6,136,199.95	2,437,691.28
2. 托管费		1,022,699.98	406,281.88
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.18	4,410,869.94	1,115,045.38
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	332,289.64	180,280.36
三、利润总额		188,351,071.78	-26,235,753.16

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰价值增长股票型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期
	2009年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)	274,400,011.91	-20,997,132.24	253,402,879.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	188,351,071.78	188,351,071.78
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	276,035,000.39	238,143,773.10	514,178,773.49
其中：1.基金申购款	987,289,994.16	460,395,796.93	1,447,685,791.09
2.基金赎回款	-711,254,993.77	-222,252,023.83	-933,507,017.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动	—	-249,273,297.95	-249,273,297.95
五、期末所有者权益(基金净值)	550,435,012.30	156,224,414.69	706,659,426.99
项 目	上年度可比期间 2008年7月16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)	406,303,580.25	—	406,303,580.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-26,235,753.16	-26,235,753.16
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-131,903,568.34	5,238,620.92	-126,664,947.42
其中：1.基金申购款	24,396,440.21	395,568.06	24,792,008.27
2.基金赎回款	-156,300,008.55	4,843,052.86	-151,456,955.69
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	274,400,011.91	-20,997,132.24	253,402,879.67

金净值)			
------	--	--	--

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：陈培

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

友邦华泰价值增长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[2008]第543号《关于核准友邦华泰价值增长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《友邦华泰价值增长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人民币406,224,705.76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(2008)第109号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》于2008年7月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为406,303,580.25份基金份额，其中认购资金利息折合78,874.49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(以下简称“中国银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《友邦华泰价值增长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、权证、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资产占基金资产的60% - 95%；现金、债券资产(含短期融资券和资产证券化产品)、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% - 40%，其中，基金持有权证的市值不得超过基金资产净值的3%，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%。本基金的业绩比较基准为沪深300指数×80% + 上证国债指数×20%。

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》、《友邦华泰价值增长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。比较财务报表的实际编制期间为2008年7月16日(基金合同生效日)至2008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。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内列示。

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	86,320,701.93	37,836,182.33
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	86,320,701.93	37,836,182.33

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		560,191,958.71	617,471,855.80	57,279,897.09
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		560,191,958.71	617,471,855.80	57,279,897.09
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		222,733,404.58	219,249,475.30	-3,483,929.28
债券	交易所市场	—	—	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		222,733,404.58	219,249,475.30	-3,483,929.28

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	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	21,626.60	6,451.14
应收结算备付金利息	1,901.90	1,122.31
应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
其他	—	—
合计	23,528.50	7,573.45

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	891,442.57	424,665.69
银行间市场应付交易费用	—	275.00
合计	891,442.57	424,940.69

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	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	3,444.64	1,068.09
预提审计费	50,000.00	50,000.00

预提信息披露费	340,000.00	125,955.36
合计	893,444.64	677,023.45

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	274,400,011.91	274,400,011.91
本期申购	987,289,994.16	987,289,994.16
本期赎回	-711,254,993.77	-711,254,993.77
本期末	550,435,012.30	550,435,012.30

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	-17,639,511.40	-3,357,620.84	-20,997,132.24
本期利润	127,587,245.41	60,763,826.37	188,351,071.78
本期基金份额交易产生的变动数	178,352,753.40	59,791,019.70	238,143,773.10
其中：基金申购款	252,987,513.72	207,408,283.21	460,395,796.93
基金赎回款	-74,634,760.32	-147,617,263.51	-222,252,023.83
本期已分配利润	-249,273,297.95	—	-249,273,297.95
本期末	39,027,189.46	117,197,225.23	156,224,414.69

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7月16日-2008年12月31 日
活期存款利息收入	450,805.45	588,173.94

结算备付金利息收入	17,363.64	20,074.99
其他	—	—
合计	468,169.09	608,248.93

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7月16日-2008年12月31 日
卖出股票成交总额	1,379,689,326.04	257,512,106.92
减：卖出股票成本总额	1,244,007,826.10	276,380,976.02
买卖股票差价收入	135,681,499.94	-18,868,869.10

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7月16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	54,322,508.72	260,684,665.48
减：卖出债券、债转股及债券到期兑付成本总额	54,491,312.50	259,764,717.74
减：应收利息总额	309,647.21	3,377,710.72
债券投资收益	-478,450.99	-2,457,762.98

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01月01日-2009年	上年度可比期间 2008年7月16日-2008年12月
----	-------------------------	--------------------------------

	12月31日	31日
股票投资产生的股利收益	2,600,469.00	151,157.14
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	2,600,469.00	151,157.14

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7月16日-2008年12月31 日
1.交易性金融资产	60,763,826.37	-3,483,929.28
——股票投资	60,763,826.37	-3,483,929.28
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
2.衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3.其他	—	—
合计	60,763,826.37	-3,483,929.28

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7月16日-2008年12月31日
基金赎回费收入	1,118,823.17	188,804.69
转换费收入	31,909.19	500.38
基金合同生效日 前利息收入	—	22,346.70
合计	1,150,732.36	211,651.77

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01月01日-2009年12月 31日	上年度可比期间 2008年7月16日-2008年12月 31日
交易所市场交易费用	4,410,869.94	1,113,420.38
银行间市场交易费用	—	1,625.00
合计	4,410,869.94	1,115,045.38

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7月16日-2008年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	264,044.64	125,955.36
其他费用	18,245.00	4,325.00
合计	332,289.64	180,280.36

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7月16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	953,294,665.38	32.19%	73,362,123.42	9.74%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

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7月16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

华泰证券股份 有限公司	—	—	44,639,951.32	37.06%
----------------	---	---	---------------	--------

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	774,560.01	31.32%	297,505.02	33.37%
关联方名称	上年度可比期间 2008年7月16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	60,992.08	9.68%	16,773.21	3.95%

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和经手费后的净额列示。

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7月16日-2008年 12月31日

当期发生的基金应支付的管理费	6,136,199.95	2,437,691.28
其中：支付销售机构的客户维护费	345,945.11	154,456.95

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 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年01月01日-2009年12月31日	2008年7月16日-2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,022,699.98	406,281.88

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	—	—	—	—	—	—
上年度可比期间						
2008年7月16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	148,255,000.00	—	—	—	—	—

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7月16日-2008年12 月31日
基金合同生效日（2008年07月16日）持有的基金份额	—	10,007,525.00
期初持有的基金份额	10,007,525.00	—
期间申购/买入总份额	9,738,657.58	—
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	19,746,182.58	10,007,525.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	3.59%	3.65%

注：基金管理人友邦华泰基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易通过代销机构华泰证券办理，投资本基金的费用均参照本基金对外公告的费率收取，适用手续费 1,000 元。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年12月31日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例	持有的 基金份额	持有的基金 份额 占基金总份 额的比例
华泰证券股 份有限公司	—	—	10,000,000.00	3.64%

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01月01日-2009年12月31日		上年度可比期间 2008年7月16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	86,320,701.93	450,805.45	37,836,182.33	588,173.94

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

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
1	2009-11-02	2009-11-02	3.100	225,901,199.29	23,372,098.66	249,273,297.95	—

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
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	-

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
600739	辽宁成大	2009/12/28	公告重大事项	38.09	2010/01/11	41.90	308,400	11,217,824.61	11,746,956.00	-
000685	中山公用	2009/12/28	公告重大事项	30.47	2010/01/11	33.52	84,529	2,461,702.01	2,575,598.63	-
000547	闽福发A	2009/12/28	公告重大事项	9.58	2010/01/11	10.54	79,680	717,664.46	763,334.40	-

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

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股票型证券投资基金，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“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，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及结算备付金等。

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	86,320,701.93						86,320,701.93
结算备付金	4,940,096.33						4,940,096.33
存出保证金						500,000.00	500,000.00
交易性金融资产						617,471,855.80	617,471,855.80
衍生金融资产							
应收证券清算款							
应收利息						23,528.50	23,528.50
应收申购款	1,168,011.87						1,168,011.87
资产总计	92,428,810.13					617,995,384.30	710,424,194.43
负债							
应付证券清算款							
应付赎回款						919,190.02	919,190.02
应付管理人报酬						909,163.05	909,163.05
应付托管费						151,527.16	151,527.16
应付交易费用						891,442.57	891,442.57
其他负债						893,444.64	893,444.64
负债总计						3,764,767.44	3,764,767.44
利率敏感度缺口	92,428,810.13					614,230,616.86	706,659,426.99
本期末2008年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产							
银行存款	37,836,182.33						37,836,182.33
结算备付金	2,314,207.98						2,314,207.98
存出保证金						500,000.00	500,000.00
交易性金融资产						219,249,475.30	219,249,475.30
应收证券清算款						38,967.25	38,967.25
应收利息						7,573.45	7,573.45
应收申购款	89,073.38						89,073.38
资产总计	40,239,463.69					219,796,016.00	260,035,479.69
负债							
应付证券清算款						4,815,157.12	4,815,157.12
应付赎回款						284,391.53	284,391.53
应付管理人报酬						369,503.35	369,503.35
应付托管费						61,583.88	61,583.88
应付交易费用						424,940.69	424,940.69
其他负债						677,023.45	677,023.45
负债总计						6,632,600.02	6,632,600.02
利率敏感度缺口	40,239,463.69					213,163,415.98	253,402,879.67

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，本基金未持有交易性债券投资(2008 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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 60%-95%；现金、债券资产（含短期融资券和资产证券化产品）、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%-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	617,471,855.80	87.38	219,249,475.30	86.52
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	617,471,855.80	87.38	219,249,475.30	86.52

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%	0.3	0.12
	沪深300指数下跌5%	-0.3	-0.12

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	617,471,855.80	86.92
	其中：股票	617,471,855.80	86.92
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	91,260,798.26	12.85
6	其他资产	1,691,540.37	0.24
7	合计	710,424,194.43	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	13,249,697.24	1.87
B	采掘业	37,661,842.02	5.33
C	制造业	236,228,414.71	33.43
C0	食品、饮料	23,024,116.14	3.26
C1	纺织、服装、皮毛	5,611,686.23	0.79
C2	木材、家具	1,608,273.00	0.23
C3	造纸、印刷	4,345,526.12	0.61
C4	石油、化学、塑胶、塑料	46,811,117.47	6.62

C5	电子	12,627,894.80	1.79
C6	金属、非金属	56,772,159.07	8.03
C7	机械、设备、仪表	63,062,933.74	8.92
C8	医药、生物制品	18,878,604.60	2.67
C99	其他制造业	3,486,103.54	0.49
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,067,023.00	2.27
E	建筑业	14,825,550.06	2.10
F	交通运输、仓储业	25,115,196.55	3.55
G	信息技术业	25,063,662.07	3.55
H	批发和零售贸易	40,863,774.31	5.78
I	金融、保险业	147,915,798.46	20.93
J	房地产业	26,120,769.32	3.70
K	社会服务业	8,647,418.07	1.22
L	传播与文化产业	3,746,039.61	0.53
M	综合类	21,966,670.38	3.11
	合计	617,471,855.80	87.38

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	000001	深发展 A	1,128,180	27,493,746.60	3.89
2	600000	浦发银行	1,171,853	25,417,491.57	3.60
3	601166	兴业银行	592,137	23,869,042.47	3.38
4	600016	民生银行	1,841,193	14,563,836.63	2.06
5	600739	辽宁成大	308,400	11,746,956.00	1.66
6	601318	中国平安	202,460	11,153,521.40	1.58
7	600830	香溢融通	921,489	10,458,900.15	1.48
8	601998	中信银行	1,143,779	9,413,301.17	1.33
9	601398	工商银行	1,438,909	7,827,664.96	1.11
10	601939	建设银行	1,254,497	7,765,336.43	1.10
11	600887	*ST 伊利	292,064	7,733,854.72	1.09

12	601601	中国太保	292,500	7,493,850.00	1.06
13	601328	交通银行	669,972	6,264,238.20	0.89
14	000060	中金岭南	198,602	5,540,995.80	0.78
15	601699	潞安环能	103,600	5,364,408.00	0.76
16	000612	焦作万方	184,100	5,154,800.00	0.73
17	601169	北京银行	244,872	4,735,824.48	0.67
18	600573	惠泉啤酒	380,079	4,291,091.91	0.61
19	600976	武汉健民	273,500	4,088,825.00	0.58
20	600097	开创国际	199,950	3,777,055.50	0.53
21	600508	上海能源	149,948	3,771,192.20	0.53
22	000960	锡业股份	121,339	3,742,094.76	0.53
23	000933	神火股份	100,000	3,688,000.00	0.52
24	600348	国阳新能	74,600	3,608,402.00	0.51
25	600123	兰花科创	78,546	3,435,602.04	0.49
26	600597	光明乳业	358,800	3,419,364.00	0.48
27	002063	远光软件	149,991	3,415,295.07	0.48
28	002217	联合化工	220,045	3,377,690.75	0.48
29	000898	鞍钢股份	210,727	3,371,632.00	0.48
30	600178	东安动力	199,999	3,361,983.19	0.48
31	600581	八一钢铁	209,100	3,345,600.00	0.47
32	000937	金牛能源	80,005	3,328,208.00	0.47
33	600121	郑州煤电	258,700	3,295,838.00	0.47
34	600546	山煤国际	95,707	3,291,363.73	0.47
35	600740	山西焦化	343,000	3,213,910.00	0.45
36	000602	金马集团	170,901	3,192,430.68	0.45
37	601666	平煤股份	99,636	3,188,352.00	0.45
38	000932	华菱钢铁	414,178	3,176,745.26	0.45
39	601001	大同煤业	70,000	3,149,300.00	0.45
40	002125	湘潭电化	172,784	3,136,029.60	0.44
41	000717	韶钢松山	466,100	3,118,209.00	0.44
42	600742	一汽富维	106,200	2,974,662.00	0.42
43	601111	中国国航	301,838	2,930,846.98	0.41
44	002267	陕天然气	131,900	2,924,223.00	0.41
45	000825	太钢不锈	298,100	2,843,874.00	0.40

46	000598	蓝星清洗	235,852	2,797,204.72	0.40
47	600388	龙净环保	80,625	2,768,662.50	0.39
48	000860	顺鑫农业	156,350	2,762,704.50	0.39
49	600292	九龙电力	279,400	2,732,532.00	0.39
50	600063	皖维高新	220,200	2,717,268.00	0.38
51	600193	创兴置业	228,845	2,702,659.45	0.38
52	000421	南京中北	412,790	2,699,646.60	0.38
53	000958	东方热电	472,400	2,659,612.00	0.38
54	000525	红太阳	156,913	2,658,106.22	0.38
55	002065	东华软件	114,110	2,651,916.40	0.38
56	002165	红宝丽	94,063	2,609,307.62	0.37
57	600231	凌钢股份	200,000	2,604,000.00	0.37
58	000022	深赤湾A	171,289	2,591,602.57	0.37
59	600004	白云机场	253,935	2,577,440.25	0.36
60	000685	中山公用	84,529	2,575,598.63	0.36
61	000700	模塑科技	365,000	2,573,250.00	0.36
62	600741	华域汽车	222,100	2,571,918.00	0.36
63	000096	广聚能源	330,037	2,567,687.86	0.36
64	000537	广宇发展	179,600	2,564,688.00	0.36
65	000830	鲁西化工	415,600	2,560,096.00	0.36
66	000520	长航凤凰	451,500	2,555,490.00	0.36
67	000895	双汇发展	47,800	2,538,180.00	0.36
68	000589	黔轮胎A	141,700	2,532,179.00	0.36
69	600389	江山股份	157,760	2,513,116.80	0.36
70	600717	天津港	201,183	2,500,704.69	0.35
71	600470	六国化工	193,308	2,493,673.20	0.35
72	000420	吉林化纤	441,141	2,488,035.24	0.35
73	600282	南钢股份	407,969	2,484,531.21	0.35
74	600967	北方创业	200,000	2,484,000.00	0.35
75	000782	美达股份	395,100	2,465,424.00	0.35
76	600298	安琪酵母	82,200	2,457,780.00	0.35
77	601333	广深铁路	512,900	2,446,533.00	0.35
78	600425	青松建化	106,200	2,395,872.00	0.34
79	600026	中海发展	164,600	2,362,010.00	0.33

80	000966	长源电力	436,500	2,348,370.00	0.33
81	600307	酒钢宏兴	153,000	2,321,010.00	0.33
82	600575	芜湖港	150,610	2,289,272.00	0.32
83	002182	云海金属	141,900	2,281,752.00	0.32
84	600446	金证股份	151,600	2,280,064.00	0.32
85	000581	威孚高科	119,745	2,257,193.25	0.32
86	600839	四川长虹	341,700	2,241,552.00	0.32
87	000909	数源科技	161,900	2,234,220.00	0.32
88	600327	大厦股份	154,640	2,217,537.60	0.31
89	000883	三环股份	248,100	2,208,090.00	0.31
90	600428	中远航运	207,201	2,185,970.55	0.31
91	000625	长安汽车	155,300	2,178,859.00	0.31
92	600653	申华控股	487,400	2,173,804.00	0.31
93	600635	大众公用	202,200	2,163,540.00	0.31
94	002010	传化股份	149,944	2,156,194.72	0.31
95	000594	国恒铁路	361,492	2,140,032.64	0.30
96	600551	时代出版	111,500	2,095,085.00	0.30
97	002158	汉钟精机	110,904	2,094,976.56	0.30
98	600150	中国船舶	26,800	2,086,112.00	0.30
99	600883	博闻科技	200,000	2,082,000.00	0.29
100	600835	上海机电	150,000	2,052,000.00	0.29
101	002272	川润股份	73,759	2,009,932.75	0.28
102	002252	上海莱士	54,000	2,002,320.00	0.28
103	600393	东华实业	172,300	1,991,788.00	0.28
104	600390	金瑞科技	146,110	1,981,251.60	0.28
105	000778	新兴铸管	159,200	1,978,856.00	0.28
106	002082	栋梁新材	138,680	1,966,482.40	0.28
107	000948	南天信息	124,968	1,956,998.88	0.28
108	600166	福田汽车	102,296	1,948,738.80	0.28
109	600837	海通证券	99,945	1,917,944.55	0.27
110	601958	金钼股份	99,944	1,904,932.64	0.27
111	600496	精工钢构	160,800	1,903,872.00	0.27
112	000521	美菱电器	144,400	1,895,972.00	0.27
113	600499	科达机电	85,600	1,868,648.00	0.26

114	002062	宏润建设	91,500	1,836,405.00	0.26
115	600386	北巴传媒	125,612	1,833,935.20	0.26
116	002208	合肥城建	84,821	1,821,955.08	0.26
117	000903	云内动力	133,200	1,815,516.00	0.26
118	600549	厦门钨业	95,800	1,813,494.00	0.26
119	600037	歌华有线	126,819	1,799,561.61	0.25
120	600726	华电能源	364,600	1,779,248.00	0.25
121	002086	东方海洋	132,000	1,774,080.00	0.25
122	002112	三变科技	119,264	1,760,336.64	0.25
123	002181	粤传媒	175,890	1,757,141.10	0.25
124	000417	合肥百货	118,894	1,744,174.98	0.25
125	600239	云南城投	63,705	1,740,420.60	0.25
126	002132	恒星科技	122,100	1,733,820.00	0.25
127	600577	精达股份	215,000	1,730,750.00	0.24
128	601186	中国铁建	188,900	1,726,546.00	0.24
129	000016	深康佳 A	223,700	1,720,253.00	0.24
130	600416	湘电股份	71,100	1,713,510.00	0.24
131	000066	长城电脑	105,887	1,704,780.70	0.24
132	600487	亨通光电	52,450	1,676,302.00	0.24
133	600351	亚宝药业	100,000	1,669,000.00	0.24
134	600970	中材国际	44,862	1,667,520.54	0.24
135	600170	上海建工	107,400	1,660,404.00	0.24
136	600071	凤凰光学	214,000	1,643,520.00	0.23
137	000961	中南建设	73,400	1,643,426.00	0.23
138	000404	华意压缩	193,700	1,638,702.00	0.23
139	600068	葛洲坝	139,200	1,630,032.00	0.23
140	600053	中江地产	168,700	1,627,955.00	0.23
141	002152	广电运通	49,245	1,617,698.25	0.23
142	600195	中牧股份	78,613	1,593,485.51	0.23
143	600566	洪城股份	151,600	1,567,544.00	0.22
144	000616	亿城股份	224,300	1,545,427.00	0.22
145	600787	中储股份	158,899	1,539,731.31	0.22
146	600271	航天信息	75,000	1,521,000.00	0.22
147	000797	中国武夷	191,768	1,513,049.52	0.21

148	000987	广州友谊	54,300	1,506,825.00	0.21
149	000530	大冷股份	157,600	1,506,656.00	0.21
150	000506	ST 中润	183,145	1,503,620.45	0.21
151	002133	广宇集团	153,500	1,498,160.00	0.21
152	601588	北辰实业	252,000	1,494,360.00	0.21
153	000558	莱茵置业	187,320	1,489,194.00	0.21
154	000836	鑫茂科技	153,200	1,478,380.00	0.21
155	000651	格力电器	51,000	1,475,940.00	0.21
156	600802	福建水泥	187,000	1,475,430.00	0.21
157	600522	中天科技	59,552	1,475,103.04	0.21
158	000718	苏宁环球	107,400	1,472,454.00	0.21
159	600252	中恒集团	55,500	1,471,860.00	0.21
160	000680	山推股份	116,123	1,470,117.18	0.21
161	000042	深 长 城	65,730	1,467,750.90	0.21
162	000671	阳 光 城	61,100	1,460,290.00	0.21
163	600322	天房发展	229,800	1,454,634.00	0.21
164	000059	辽通化工	125,000	1,452,500.00	0.21
165	000150	宜华地产	181,600	1,440,088.00	0.20
166	000006	深振业 A	126,000	1,427,580.00	0.20
167	600540	新赛股份	107,450	1,426,936.00	0.20
168	600169	太原重工	81,900	1,425,060.00	0.20
169	600189	吉林森工	142,200	1,423,422.00	0.20
170	600539	狮头股份	169,900	1,418,665.00	0.20
171	000014	沙河股份	91,300	1,415,150.00	0.20
172	002244	滨江集团	97,000	1,403,590.00	0.20
173	000425	徐工机械	39,700	1,394,264.00	0.20
174	000157	中联重科	53,520	1,392,055.20	0.20
175	600079	人福科技	98,100	1,389,096.00	0.20
176	000735	罗 牛 山	224,000	1,379,840.00	0.20
177	600810	神马实业	108,600	1,372,704.00	0.19
178	600052	浙江广厦	164,800	1,367,840.00	0.19
179	000043	中航地产	89,400	1,352,622.00	0.19
180	000829	天音控股	99,200	1,328,288.00	0.19
181	000989	九 芝 堂	92,200	1,316,616.00	0.19

182	600291	西水股份	78,800	1,303,352.00	0.18
183	600383	金地集团	93,900	1,303,332.00	0.18
184	000028	一致药业	45,900	1,270,512.00	0.18
185	600491	龙元建设	70,900	1,244,295.00	0.18
186	600529	山东药玻	82,641	1,234,656.54	0.17
187	600966	博汇纸业	119,420	1,220,472.40	0.17
188	600226	升华拜克	99,900	1,217,781.00	0.17
189	002240	威华股份	105,300	1,212,003.00	0.17
190	000659	珠海中富	151,600	1,185,512.00	0.17
191	600436	片仔癀	30,120	1,184,017.20	0.17
192	002001	新 和 成	23,614	1,154,724.60	0.16
193	600216	浙江医药	32,300	1,148,911.00	0.16
194	002103	广博股份	115,800	1,147,578.00	0.16
195	600479	千金药业	41,200	1,107,456.00	0.16
196	600535	天士力	49,357	1,105,596.80	0.16
197	600104	上海汽车	42,004	1,097,564.52	0.16
198	600707	彩虹股份	89,220	1,091,160.60	0.15
199	000597	东北制药	40,300	1,061,099.00	0.15
200	600750	江中药业	45,620	1,057,471.60	0.15
201	000919	金陵药业	85,900	1,047,980.00	0.15
202	002138	顺络电子	49,500	1,001,385.00	0.14
203	600365	通葡股份	84,000	990,360.00	0.14
204	000726	鲁 泰 A	84,600	989,820.00	0.14
205	600987	航民股份	109,010	979,999.90	0.14
206	600584	长电科技	110,500	966,875.00	0.14
207	002139	拓邦股份	59,700	960,573.00	0.14
208	000715	中兴商业	83,500	954,405.00	0.14
209	002003	伟星股份	44,573	952,970.74	0.13
210	000889	渤海物流	117,980	952,098.60	0.13
211	600362	江西铜业	23,310	937,295.10	0.13
212	600207	ST 安彩	160,600	936,298.00	0.13
213	000507	粤 富 华	97,000	917,620.00	0.13
214	002034	美 欣 达	68,500	904,885.00	0.13
215	000516	开元控股	103,900	885,228.00	0.13

216	600366	宁波韵升	57,600	884,160.00	0.13
217	002045	广州国光	61,810	872,757.20	0.12
218	000501	鄂武商 A	58,518	869,577.48	0.12
219	000564	西安民生	117,999	868,472.64	0.12
220	600177	雅戈尔	59,200	858,992.00	0.12
221	600250	南纺股份	113,500	845,575.00	0.12
222	600415	小商品城	18,699	836,406.27	0.12
223	600755	厦门国贸	52,800	824,736.00	0.12
224	002083	孚日股份	90,499	820,825.93	0.12
225	000963	华东医药	44,500	818,800.00	0.12
226	600500	中化国际	67,700	803,599.00	0.11
227	600626	申达股份	98,300	796,230.00	0.11
228	600593	大连圣亚	55,000	774,400.00	0.11
229	000547	闽福发 A	79,680	763,334.40	0.11
230	000560	昆百大 A	62,100	755,757.00	0.11
231	600183	生益科技	72,600	751,410.00	0.11
232	002056	横店东磁	50,200	741,956.00	0.11
233	601888	中国国旅	34,700	726,618.00	0.10
234	600153	建发股份	54,600	707,616.00	0.10
235	002200	绿大地	24,596	705,659.24	0.10
236	600051	宁波联合	55,706	702,452.66	0.10
237	600622	嘉宝集团	57,100	700,617.00	0.10
238	000721	西安饮食	88,325	700,417.25	0.10
239	000679	大连友谊	44,300	689,308.00	0.10
240	000062	深圳华强	67,400	685,458.00	0.10
241	601007	金陵饭店	77,017	652,333.99	0.09
242	000701	厦门信达	58,100	634,452.00	0.09
243	000983	西山煤电	14,793	590,092.77	0.08
244	600973	宝胜股份	28,000	557,200.00	0.08
245	000969	安泰科技	20,810	551,881.20	0.08
246	000916	华北高速	87,500	461,125.00	0.07
247	600269	赣粤高速	51,800	450,142.00	0.06
248	600012	皖通高速	72,600	431,244.00	0.06
249	600978	宜华木业	51,000	396,270.00	0.06

250	002191	劲嘉股份	24,238	349,996.72	0.05
251	600168	武汉控股	40,000	327,200.00	0.05
252	600763	通策医疗	24,780	260,933.40	0.04
253	600375	星马汽车	15,100	224,990.00	0.03
254	601088	中国神华	5,800	201,956.00	0.03
255	000900	现代投资	6,600	197,934.00	0.03
256	600831	广电网络	21,394	189,336.90	0.03
257	000913	钱江摩托	21,500	185,330.00	0.03
258	600449	赛马实业	4,900	182,623.00	0.03
259	002159	三特索道	12,570	179,499.60	0.03
260	600221	海南航空	26,700	177,555.00	0.03
261	000877	天山股份	8,300	176,209.00	0.02
262	600690	青岛海尔	6,800	168,572.00	0.02
263	600686	金龙汽车	15,300	167,841.00	0.02
264	600720	祁连山	9,200	159,160.00	0.02
265	600797	浙大网新	22,701	156,636.90	0.02
266	002078	太阳纸业	7,500	155,025.00	0.02
267	600352	浙江龙盛	13,500	154,170.00	0.02
268	600035	楚天高速	25,300	139,150.00	0.02
269	600697	欧亚集团	5,600	137,032.00	0.02
270	600350	山东高速	25,400	133,604.00	0.02
271	000888	峨眉山 A	10,100	129,280.00	0.02
272	000881	大连国际	15,100	129,105.00	0.02
273	000926	福星股份	10,581	127,924.29	0.02
274	002123	荣信股份	2,557	96,398.90	0.01
275	601117	中国化学	14,000	76,020.00	0.01
276	002333	罗普斯金	500	11,000.00	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	600000	浦发银行	44,156,461.63	17.43

2	000001	深发展 A	41,872,230.10	16.52
3	601166	兴业银行	30,659,185.71	12.10
4	600036	招商银行	25,582,075.10	10.10
5	601318	中国平安	23,178,844.58	9.15
6	000969	安泰科技	22,427,587.96	8.85
7	601328	交通银行	21,374,233.66	8.43
8	000983	西山煤电	19,991,838.96	7.89
9	601169	北京银行	19,862,440.90	7.84
10	600015	华夏银行	19,511,406.73	7.70
11	600016	民生银行	19,427,056.04	7.67
12	000686	东北证券	19,326,228.83	7.63
13	601001	大同煤业	19,225,164.71	7.59
14	600739	辽宁成大	18,104,126.19	7.14
15	000060	中金岭南	17,147,170.34	6.77
16	600362	江西铜业	16,023,832.08	6.32
17	601699	潞安环能	15,998,619.76	6.31
18	000825	太钢不锈	15,288,515.53	6.03
19	601939	建设银行	14,956,146.00	5.90
20	000960	锡业股份	14,639,545.37	5.78
21	600432	吉恩镍业	14,149,625.73	5.58
22	601398	工商银行	13,539,207.37	5.34
23	000839	中信国安	13,354,384.40	5.27
24	000937	金牛能源	13,313,783.86	5.25
25	601601	中国太保	12,996,298.36	5.13
26	600123	兰花科创	11,905,465.05	4.70
27	600383	金地集团	11,438,673.65	4.51
28	601958	金钼股份	11,237,653.55	4.43
29	600830	香溢融通	11,162,561.82	4.41
30	601666	平煤股份	10,663,173.58	4.21
31	600837	海通证券	9,922,140.10	3.92
32	600030	中信证券	9,913,208.81	3.91
33	000933	神火股份	9,843,433.55	3.88
34	600887	*ST 伊利	9,791,284.91	3.86
35	000878	云南铜业	9,750,486.46	3.85
36	002202	金风科技	9,665,536.93	3.81
37	000783	长江证券	9,566,922.03	3.78
38	601998	中信银行	9,415,888.80	3.72
39	600307	酒钢宏兴	9,294,960.67	3.67
40	600583	海油工程	9,083,623.36	3.58

41	002092	中泰化学	8,801,448.10	3.47
42	600104	上海汽车	8,750,884.39	3.45
43	000024	招商地产	8,734,149.84	3.45
44	000932	华菱钢铁	8,456,353.54	3.34
45	600997	开滦股份	8,086,488.10	3.19
46	600497	驰宏锌锗	7,983,275.39	3.15
47	600005	武钢股份	7,951,458.05	3.14
48	600325	华发股份	7,731,153.58	3.05
49	002123	荣信股份	7,727,258.25	3.05
50	002254	烟台氨纶	7,666,654.07	3.03
51	600282	南钢股份	7,521,807.90	2.97
52	000157	中联重科	7,499,352.50	2.96
53	002200	绿大地	7,329,503.80	2.89
54	000012	南玻A	7,274,591.26	2.87
55	600581	八一钢铁	7,225,619.27	2.85
56	000562	宏源证券	6,697,628.15	2.64
57	600415	小商品城	6,640,257.88	2.62
58	600348	国阳新能	6,320,149.00	2.49
59	600050	中国联通	6,307,586.00	2.49
60	000966	长源电力	6,092,708.91	2.40
61	600549	厦门钨业	6,031,730.80	2.38
62	600048	保利地产	5,656,148.17	2.23
63	600597	光明乳业	5,599,594.00	2.21
64	000655	金岭矿业	5,590,004.11	2.21
65	000898	鞍钢股份	5,519,812.61	2.18
66	000718	苏宁环球	5,451,501.99	2.15
67	002182	云海金属	5,443,868.41	2.15
68	000028	一致药业	5,106,900.70	2.02
69	600052	浙江广厦	5,088,175.31	2.01

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	000983	西山煤电	40,269,297.85	15.89
2	600000	浦发银行	31,174,875.03	12.30
3	600036	招商银行	30,850,891.14	12.17

4	000969	安泰科技	28,034,219.51	11.06
5	601699	潞安环能	23,966,839.65	9.46
6	601001	大同煤业	22,778,046.63	8.99
7	000001	深发展 A	22,549,279.61	8.90
8	600015	华夏银行	22,244,071.78	8.78
9	000686	东北证券	21,271,748.63	8.39
10	600415	小商品城	17,544,798.00	6.92
11	600362	江西铜业	17,528,389.30	6.92
12	601601	中国太保	16,920,929.53	6.68
13	601169	北京银行	16,889,397.90	6.67
14	600432	吉恩镍业	16,545,819.38	6.53
15	600030	中信证券	16,059,374.76	6.34
16	601328	交通银行	15,782,191.80	6.23
17	600104	上海汽车	13,778,546.71	5.44
18	000623	吉林敖东	13,656,071.36	5.39
19	601318	中国平安	13,507,256.32	5.33
20	000960	锡业股份	13,130,960.95	5.18
21	600123	兰花科创	13,039,577.45	5.15
22	000839	中信国安	13,002,766.50	5.13
23	601166	兴业银行	12,929,652.82	5.10
24	000060	中金岭南	12,789,015.52	5.05
25	002123	荣信股份	12,488,909.54	4.93
26	000825	太钢不锈	12,239,034.84	4.83
27	600383	金地集团	11,414,355.26	4.50
28	002202	金风科技	11,367,286.30	4.49
29	002200	绿大地	11,274,402.94	4.45
30	000024	招商地产	10,886,783.04	4.30
31	000878	云南铜业	10,852,414.57	4.28
32	600031	三一重工	10,763,059.98	4.25
33	601808	中海油服	10,654,686.09	4.20
34	600739	辽宁成大	10,628,347.50	4.19
35	000937	金牛能源	10,262,160.32	4.05
36	000157	中联重科	10,002,586.87	3.95
37	601666	平煤股份	9,902,606.71	3.91
38	600048	保利地产	9,899,872.50	3.91
39	601958	金钼股份	9,612,376.59	3.79
40	601899	紫金矿业	9,568,730.79	3.78
41	600325	华发股份	9,412,277.84	3.71
42	002092	中泰化学	9,219,742.49	3.64

43	600887	*ST 伊利	9,211,985.20	3.64
44	600583	海油工程	9,131,438.04	3.60
45	600348	国阳新能	8,973,153.30	3.54
46	600607	上实医药	8,967,469.69	3.54
47	600307	酒钢宏兴	8,551,908.33	3.37
48	600497	驰宏锌锗	8,386,892.67	3.31
49	600997	开滦股份	8,226,037.15	3.25
50	002254	烟台氨纶	8,175,643.60	3.23
51	600001	邯郸钢铁	8,067,909.00	3.18
52	600352	浙江龙盛	7,970,603.41	3.15
53	000951	中国重汽	7,939,196.07	3.13
54	000028	一致药业	7,864,821.75	3.10
55	601939	建设银行	7,732,945.94	3.05
56	000562	宏源证券	7,684,902.86	3.03
57	000932	华菱钢铁	7,480,021.72	2.95
58	000783	长江证券	7,437,746.78	2.94
59	000012	南玻A	6,959,414.41	2.75
60	600005	武钢股份	6,929,699.00	2.73
61	000422	湖北宜化	6,606,851.93	2.61
62	600078	澄星股份	6,562,358.71	2.59
63	000425	徐工机械	6,364,112.59	2.51
64	000655	金岭矿业	6,346,535.06	2.50
65	600703	三安光电	6,306,490.06	2.49
66	600837	海通证券	6,247,593.97	2.47
67	600779	水井坊	6,236,194.08	2.46
68	601398	工商银行	6,193,768.75	2.44
69	000933	神火股份	6,139,081.59	2.42
70	002028	思源电气	5,929,526.00	2.34
71	600016	民生银行	5,771,379.21	2.28
72	002147	方圆支承	5,637,611.94	2.22
73	600581	八一钢铁	5,568,775.50	2.20
74	000963	华东医药	5,506,324.06	2.17
75	600694	大商股份	5,463,682.32	2.16
76	000608	阳光股份	5,352,887.83	2.11
77	600282	南钢股份	5,326,548.17	2.10
78	000911	南宁糖业	5,302,749.61	2.09
79	002191	劲嘉股份	5,237,972.00	2.07
80	600017	日照港	5,203,505.00	2.05
81	002215	诺普信	5,192,156.05	2.05

82	600050	中国联通	5,166,910.00	2.04
83	000680	山推股份	5,140,892.21	2.03
84	601088	中国神华	5,083,898.52	2.01

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	1,581,466,380.23
卖出股票收入（成交）总额	1,379,689,326.04

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	500,000.00
2	应收证券清算款	—

3	应收股利	—
4	应收利息	23,528.50
5	应收申购款	1,168,011.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,691,540.37

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600739	辽宁成大	11,746,956.00	1.66	重大资产重组

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 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
7,693	71,550.11	423,646,959.05	76.97%	126,788,053.25	23.03%

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	1,462,457.36	0.27%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年07月16日)基金份额总额	406,303,580.25
本报告期期初基金份额总额	274,400,011.91
本报告期基金总申购份额	987,289,994.16
减:本报告期基金总赎回份额	711,254,993.77
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	550,435,012.30

§ 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。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为50,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了2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 (%)
渤海证券	1	985,649,824.05	33.29	837,796.68	33.88
华泰证券	2	953,294,665.38	32.19	774,560.01	31.32
东海证券	1	633,776,498.62	21.40	538,709.60	21.78
江南证券	1	218,346,171.15	7.37	177,408.79	7.17
银河证券	1	169,961,027.07	5.74	144,468.35	5.84

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 (%)
东海证券	1	107,620,332.20	99.54
渤海证券	1	494,015.40	0.46

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

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人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、本报告期内未新增租用交易单元。

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	友邦华泰关于运用公司固有资金申购旗下友邦华泰价值增长股票型证券投资基金的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-11-10
9	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 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
10	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金第一次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2009-10-22
11	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
12	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
13	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
14	友邦华泰关于参加农业银行网上	中国证券报、上海证券报、	2009-9-8

	银行开放式基金申购费率优惠活动的公告	证券时报	
15	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金更新的招募说明书 2009 年第 2 号	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-8-29
16	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金更新的招募说明书(摘要) 2009 年第 2 号	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-8-29
17	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 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
18	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 2009 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-8-26
19	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
20	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
21	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
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	2009-7-28
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	2009-7-24
24	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 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
25	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
26	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
27	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
28	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
29	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

30	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 2009 年第一季度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-4-22
31	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
32	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
33	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 2008 年年度报告	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-3-28
34	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 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
35	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
36	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金更新的招募说明书 2009 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-2-27
37	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金更新的招募说明书(摘要) 2009 年第 1 号	中国证券报、上海证券报、 证券时报	2009-2-27
38	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
39	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
40	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
41	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
42	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金 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
43	友邦华泰价值增长基金在工商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	2009-1-14
44	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
45	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
46	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价值增长股票型证券投资基金募集的文件
- 2、《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金基金合同》
- 3、《友邦华泰价值增长股票型证券投资基金招募说明书》
- 4、《友邦华泰价值增长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、友邦华泰价值增长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