

友邦华泰行业领先股票型证券投资基金2009年年度报告摘要  
2009年12月31日

基金管理人：友邦华泰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2009年03月26日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2009 年 8 月 3 日（基金合同生效日）起至 2009 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		友邦华泰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	蒋松云
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798

## 2.4 信息披露方式

登载基金年度报告/半年度报告正文的 管理人互联网网址	<a href="http://www.aig-huatai.com">http://www.aig-huatai.com</a>
基金年度报告/半年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

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

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

■2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

### 3.2 基金净值表现

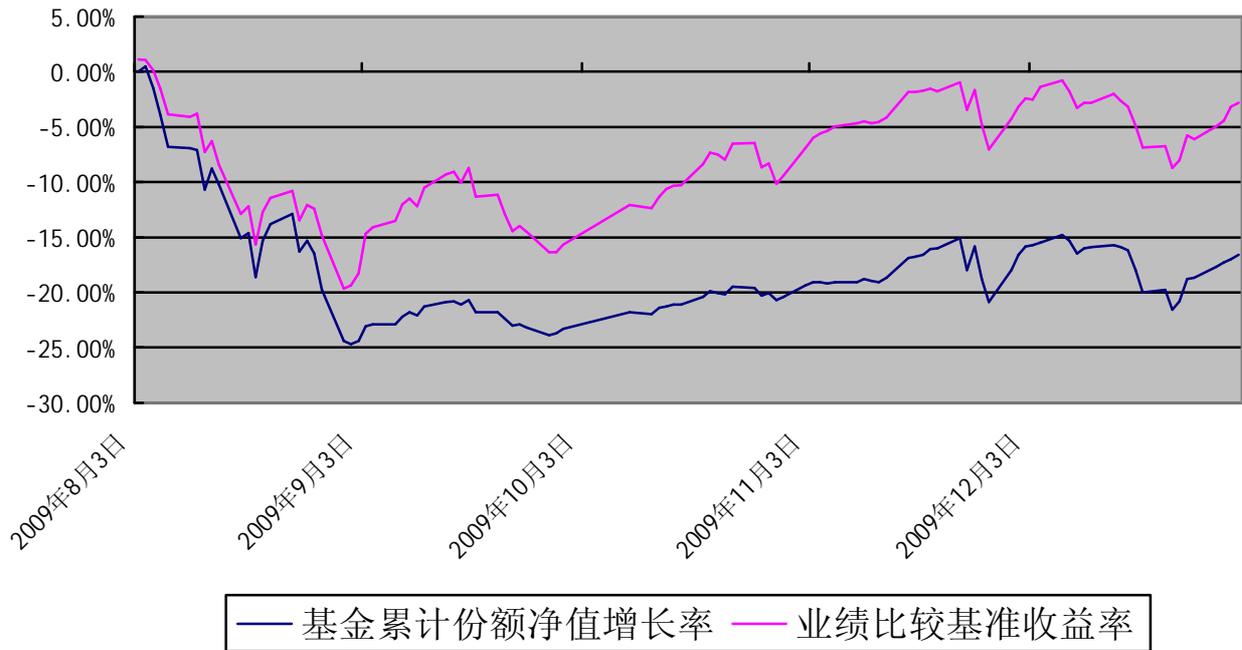
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	8.74%	1.30%	15.21%	1.41%	-6.47%	-0.11%
过去六个月	—	—	—	—	—	—
过去一年	—	—	—	—	—	—
过去三年	—	—	—	—	—	—
过去五年	—	—	—	—	—	—
自基金合同 生效起至今	-16.60%	1.69%	-2.82%	1.75%	-13.78%	-0.06%

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

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

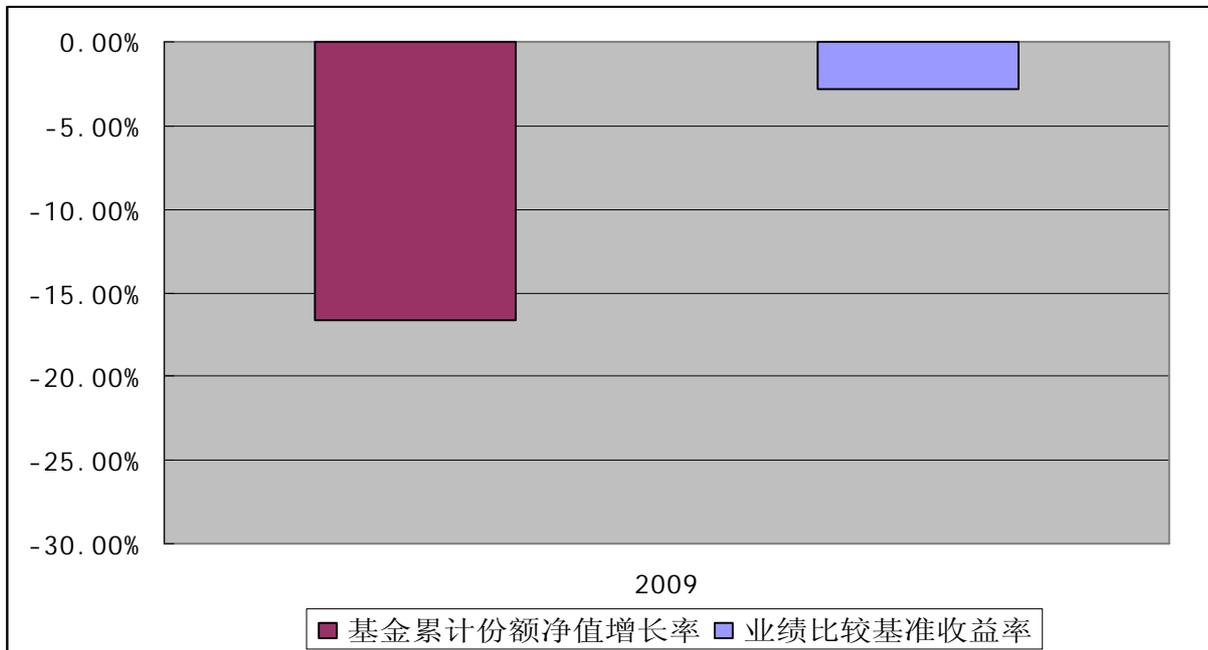


注：图示日期为 2009 年 8 月 3 日至 2009 年 12 月 31 日。

1、本基金基金合同生效日为 2009 年 8 月 3 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。

2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。截至本报告期末，各项资产配置比例符合合同规定。

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



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

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为友邦华泰基金管理有限公司。友邦华泰基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。股东构成为 AIG Global Investment Corp.、华泰证券股份有限公司和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资额分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理友邦华泰盛世中国股票型证券投资基金、友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、友邦华泰积极成长混合型证券投资基金、友邦华泰价值增长股票型证券投资基金、友邦华泰货币市场证券投资基金、友邦华泰行业领先股票型证券投资基金。截至 2009 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 220.68 亿元。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

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

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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 本投资组合与其它投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格均不相同。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

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

绩比较基准增长率为-2.82%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1)全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

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

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

#### (2)开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

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

#### (3)促进公司各项内部管理制度的完善

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

#### (4)通过各种合规培训提高员工合规意识

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

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

### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2009年，本基金托管人在对友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

2009年，友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的管理人——友邦华泰基金管理有限公司在友邦华泰行业领先股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对友邦华泰基金管理有限公司编制和披露的友邦华泰行业领先股票型证券投资基金2009年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

审计报告基本信息普华永道会计师事务所对本基金的年度报告出具了“无保留意见的审计报告”（普华永道中天审字(2010)第20176号），投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：友邦华泰行业领先股票型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

资产	本期期末 2009年12月31日
<b>资产：</b>	
银行存款	288,201,494.02
结算备付金	12,219,358.49
存出保证金	1,363,430.57
交易性金融资产	1,242,173,462.63
其中：股票投资	1,242,173,462.63
债券投资	—

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

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

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

## 7.2 利润表

会计主体：友邦华泰行业领先股票型证券投资基金

本报告期：2009年08月03日(基金合同生效日)至2009年12月31日

单位：人民币元

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

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

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰行业领先股票型证券投资基金

本报告期：2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2009年8月3日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	2,249,632,307.10	—	2,249,632,307.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-383,257,490.33	-383,257,490.33
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-418,562,770.48	79,495,413.37	-339,067,357.11

其中：1. 基金申购款	18,514,890.74	-3,635,442.00	14,879,448.74
2. 基金赎回款	-437,077,661.22	83,130,855.37	-353,946,805.85
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	1,831,069,536.62	-303,762,076.96	1,527,307,459.66

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

本财务报表由本基金的基金管理人友邦华泰基金管理有限公司于2010年3月26日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《友邦华泰行业领先股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其它有关规定的声明

本基金2009年8月3日(基金合同生效日)至2009年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2009年12月31日的财务状况以及2009年8月3

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

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

###### (2) 金融负债的分类

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

##### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 其它重要的会计政策和会计估计

##### (1) 计量属性

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

##### (2) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：

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

关联方与资产进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

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

注：支付基金管理人友邦华泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

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

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累

计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
 日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易  
 无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况  
 无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其它关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2009年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
华泰证券	39,999,800.00	2.18%

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

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

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

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况  
 无。

7.4.10.7 其它关联交易事项的说明  
 无。

7.4.11 利润分配情况  
 无。

7.4.12 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	可 流 通 日	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 (单 位:)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
601117	中	2009	2010	网上新	5.43	5.43	14,000.00	76,020.00	76,020.00	-

	国化学	2009年12月29日	2010年01月07日	股申购						
300040	九州电气	2009年12月28日	2010年01月08日	网上新股申购	33.00	33.00	500.00	16,500.00	16,500.00	-
300042	朗科科技	2009年12月28日	2010年01月08日	网上新股申购	39.00	39.00	500.00	19,500.00	19,500.00	-
合计								112,020.00	112,020.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600102	莱钢股份	2009年11月09日	资产重组	13.07	2010年02月24日	11.88	499,962.00	6,361,075.77	6,534,503.34	-
600739	辽宁成大	2009年12月28日	公告重大事项	38.09	2010年01月11日	41.90	688,800.00	25,923,573.07	26,236,392.00	-
000547	闽福发A	2009年12月28日	公告重大事项	9.58	2010年01月11日	10.54	174,000.00	1,597,341.52	1,666,920.00	-
000685	中山公用	2009年12月28日	公告重大事项	30.47	2010年01月11日	33.52	122,527.00	3,650,099.37	3,733,397.69	-
合计								37,532,089.73	38,171,213.03	-

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

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其它事项

无。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,242,173,462.63	80.45
	其中：股票	1,242,173,462.63	80.45
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
5	银行存款和结算备付金合计	300,420,852.51	19.46
6	其它各项资产	1,457,562.24	0.09
7	合计	1,544,051,877.38	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,551,453.16	0.76
B	采掘业	117,039,979.21	7.66
C	制造业	493,185,974.16	32.29
C0	食品、饮料	54,298,747.90	3.56
C1	纺织、服装、皮毛	15,515,641.00	1.02
C2	木材、家具	3,485,501.50	0.23
C3	造纸、印刷	5,307,878.00	0.35
C4	石油、化学、塑胶、塑料	70,677,802.33	4.63
C5	电子	21,907,133.76	1.43
C6	金属、非金属	144,921,158.21	9.49
C7	机械、设备、仪表	105,122,471.89	6.88

C8	医药、生物制品	61,374,299.29	4.02
C99	其它制造业	10,575,340.28	0.69
D	电力、煤气及水的生产和供应业	38,578,427.31	2.53
E	建筑业	21,250,801.44	1.39
F	交通运输、仓储业	48,362,271.94	3.17
G	信息技术业	43,690,081.67	2.86
H	批发和零售贸易	78,620,208.04	5.15
I	金融、保险业	293,139,227.86	19.19
J	房地产业	50,351,446.90	3.30
K	社会服务业	14,849,218.77	0.97
L	传播与文化产业	8,528,366.55	0.56
M	综合类	23,026,005.62	1.51
	合计	1,242,173,462.63	81.33

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600016	民生银行	5,126,451.00	40,550,227.41	2.66
2	000001	深发展A	1,397,257.00	34,051,153.09	2.23
3	601169	北京银行	1,624,800.00	31,423,632.00	2.06
4	601166	兴业银行	742,411.00	29,926,587.41	1.96
5	601699	潞安环能	519,200.00	26,884,176.00	1.76
6	600739	辽宁成大	688,800.00	26,236,392.00	1.72
7	601318	中国平安	448,918.00	24,730,892.62	1.62
8	600036	招商银行	1,369,176.00	24,713,626.80	1.62
9	601601	中国太保	922,600.00	23,637,012.00	1.55
10	600000	浦发银行	1,076,721.00	23,354,078.49	1.53

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于[www.aig-huatai.com](http://www.aig-huatai.com)网站的年度报告正文。

### 8.4 报告期内权益投资组合的重大变动

#### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	141,930,174.23	9.29
2	601318	中国平安	139,522,089.95	9.14
3	600016	民生银行	131,960,567.18	8.64

4	601166	兴业银行	119,148,983.24	7.80
5	600000	浦发银行	107,495,004.22	7.04
6	600030	中信证券	92,067,697.86	6.03
7	000001	深发展A	89,682,833.17	5.87
8	000983	西山煤电	88,882,421.68	5.82
9	600048	保利地产	81,422,276.18	5.33
10	600348	国阳新能	81,062,981.70	5.31
11	601088	中国神华	79,605,754.09	5.21
12	000024	招商地产	78,796,913.95	5.16
13	000937	金牛能源	65,889,377.14	4.31
14	000878	云南铜业	60,350,246.55	3.95
15	000623	吉林敖东	58,506,448.38	3.83
16	000898	鞍钢股份	55,246,176.56	3.62
17	000825	太钢不锈	55,179,352.44	3.61
18	600595	中孚实业	53,525,673.56	3.50
19	600031	三一重工	46,327,816.45	3.03
20	600005	武钢股份	43,950,081.26	2.88
21	601939	建设银行	43,466,147.96	2.85
22	600019	宝钢股份	43,108,661.55	2.82
23	601628	中国人寿	42,068,095.50	2.75
24	000060	中金岭南	42,066,351.24	2.75
25	601699	潞安环能	40,998,689.03	2.68
26	601169	北京银行	34,705,946.80	2.27
27	000932	华菱钢铁	33,164,873.66	2.17
28	600028	中国石化	32,699,067.39	2.14
29	000157	中联重科	32,182,795.88	2.11
30	600143	金发科技	32,078,255.11	2.10
31	000792	盐湖钾肥	31,703,478.31	2.08

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	96,753,169.80	6.33
2	601318	中国平安	86,146,794.49	5.64
3	600016	民生银行	75,496,189.20	4.94
4	601166	兴业银行	68,584,834.45	4.49
5	600048	保利地产	64,361,157.51	4.21

6	000983	西山煤电	63,642,673.39	4.17
7	600000	浦发银行	59,245,499.00	3.88
8	600030	中信证券	58,352,631.62	3.82
9	601088	中国神华	57,967,265.44	3.80
10	600348	国阳新能	57,226,046.52	3.75
11	000024	招商地产	54,595,470.84	3.57
12	000001	深发展A	52,942,165.57	3.47
13	600031	三一重工	46,588,622.01	3.05
14	000878	云南铜业	42,369,779.37	2.77
15	600595	中孚实业	41,448,336.67	2.71
16	000623	吉林敖东	39,829,280.85	2.61
17	000937	金牛能源	34,627,207.23	2.27
18	000898	鞍钢股份	34,413,904.38	2.25
19	000157	中联重科	33,587,836.40	2.20
20	601628	中国人寿	32,988,029.53	2.16
21	600830	香溢融通	31,299,305.16	2.05
22	000825	太钢不锈	31,160,162.56	2.04

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

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

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

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

### 8.9.3 期末其它各项资产构成

单位:人民币元

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

### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

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

### 8.9.6 投资组合报告附注的其它文字描述部分

无。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
30,167.00	60,697.77	146,425,803.19	8.00%	1,684,643,733.43	92.00%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,825,129.91	0.10%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

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

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期基金聘请普华永道中天会计师事务所为其提供审计服务。截至本报告期末，本基金应支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为 100,000.00 元人民币，该事务所已向

本基金提供了5个月的审计服务。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	1,729,505,920.56	33.91%	1,405,237.59	32.91%	—
德邦证券	1	1,143,623,001.80	22.42%	972,076.26	22.76%	—
中投证券	1	291,173,255.23	5.71%	247,494.87	5.80%	—
中信证券	1	1,935,602,131.98	37.96%	1,645,252.31	38.53%	—
华宝证券	1	—	—	—	—	—
招商证券	1	—	—	—	—	—
合计		5,099,904,309.57	100.00%	4,270,061.03	100.00%	—

#### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其它证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

华宝证券	—	—	—	—	—	—
合计	4,067,895.00	100.00%	254,100,000.00	100.00%	—	—

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：

- 1) 资金雄厚，信誉良好。
- 2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的 处罚。
- 3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求。
- 4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务。
- 5) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时、定期、全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。

2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

3、上述交易单元均系本报告期内租用。