
友邦华泰积极成长混合型证券投资基金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1月1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

2.4 信息披露方式

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

§ 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

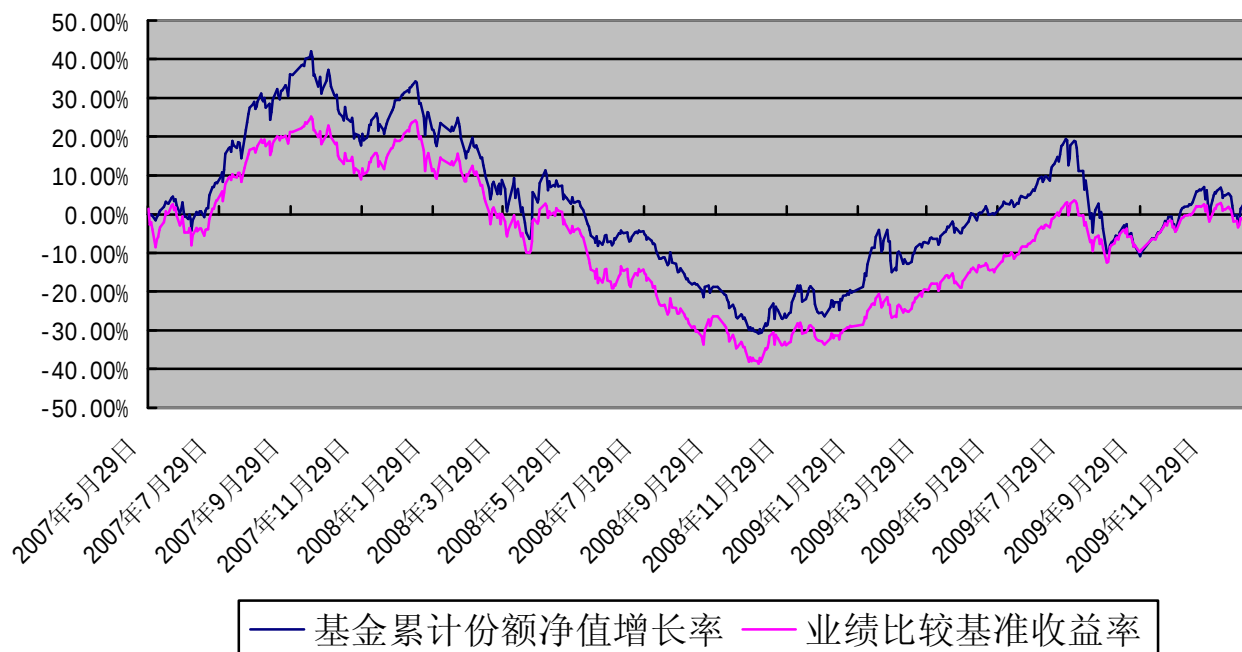
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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今(2007年05月29日-2009年12月31日)	5.38%	1.71%	1.27%	1.53%	4.11%	0.18%

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

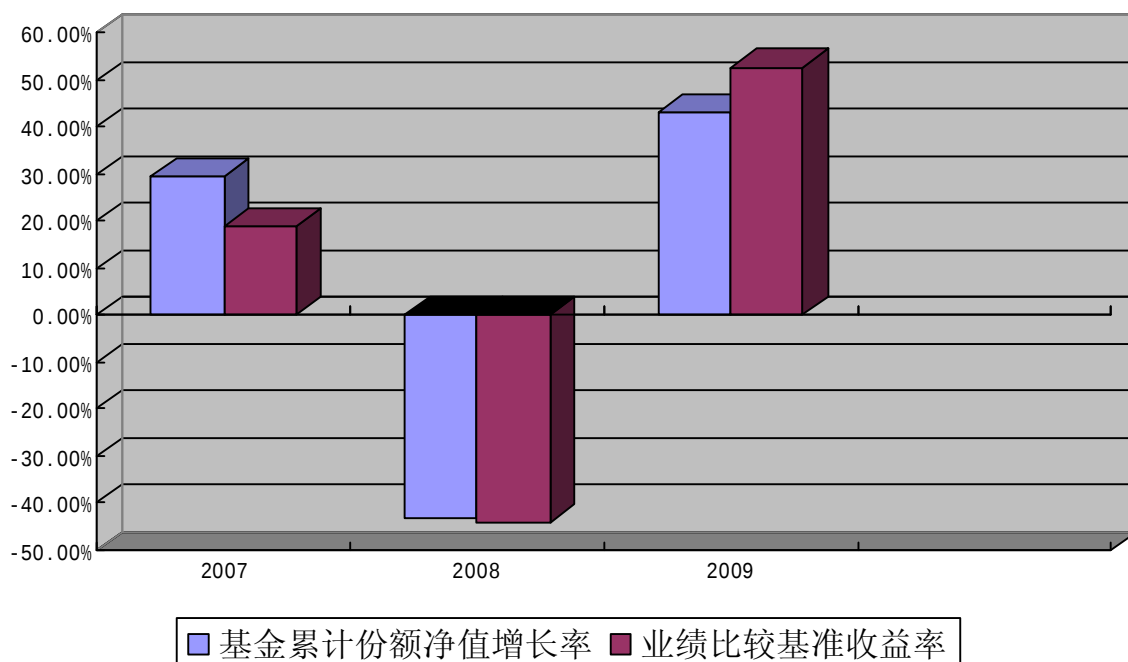
基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，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。

§ 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20173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 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
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			-1,209,771,224.47

易产生的基金净值变动数	-1,129,317,981.46	-80,453,243.01	
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 $\times$ 60%+中信标普国债指数 $\times$ 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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 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%

7.4.7.1.2 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	—	—	—	—

7.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	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

	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	108,510,681.80	50.64%	30,884,234.60	28.23%
华泰联合证券有限责任公司	—	—	—	—

7.4.7.1.4 债券回购交易

无。

7.4.7.1.5 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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 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。

7.4.7.2.2 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。

7.4.7.3 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	—	—	—	—	—

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 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%

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 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。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.8 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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	7.09	2010/01/25	6.60	6,936,128	49,177,147.52	49,177,147.52	复牌后更名

			合并							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。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

7.4.9 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	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

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 网站的年度报告正文。

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 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 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 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、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。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。