
友邦华泰价值增长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 姓名	陈晖	唐州徽

露负责 人	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

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

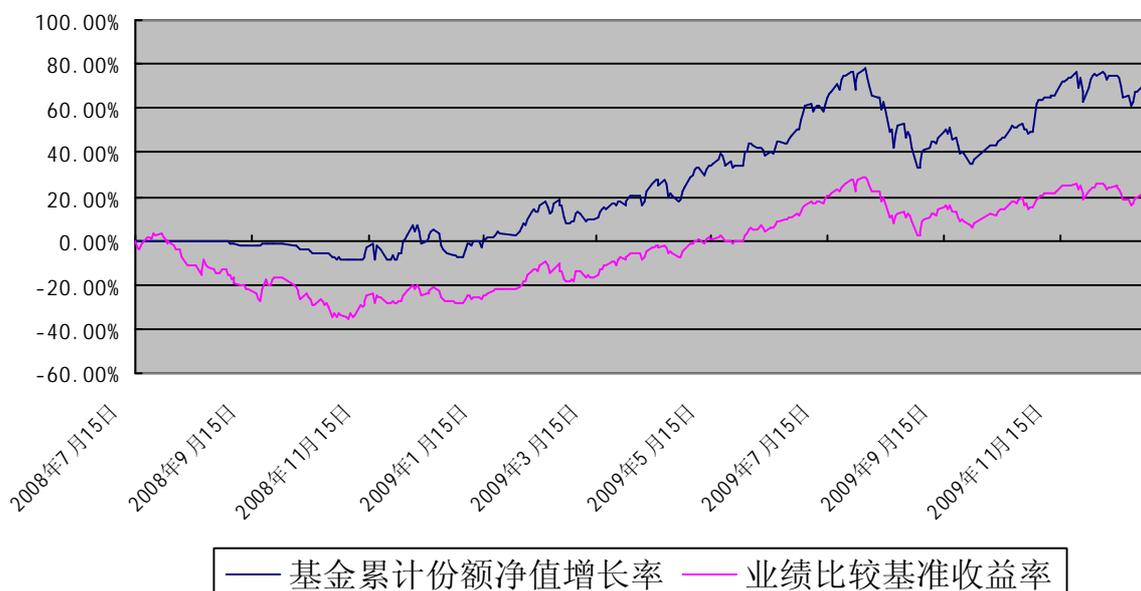
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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日-2009年12月31日)	61.94%	1.84%	23.74%	1.94%	38.20%	-0.10%

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

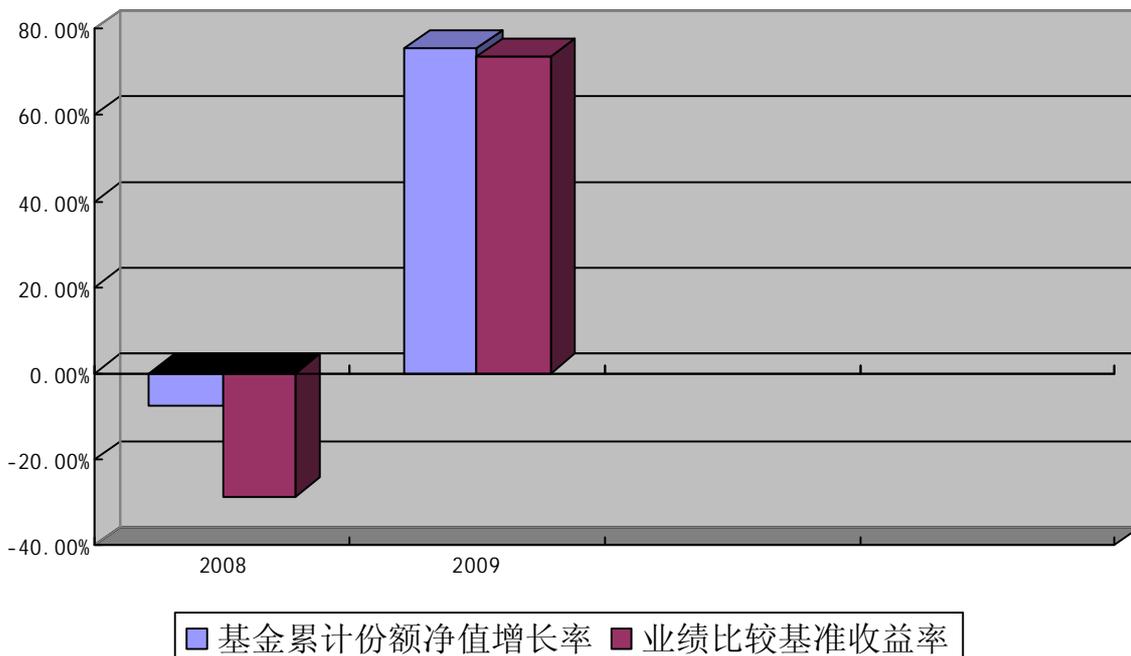
基金累计份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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。

§ 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20174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	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
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(基金净值)	274,400,011.91	-20,997,132.24	253,402,879.67

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 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收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%

7.4.7.1.2 权证交易

无。

7.4.7.1.3 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%

7.4.7.1.4 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	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监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。

7.4.7.2 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。

7.4.7.2.2 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。

7.4.7.3 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	-	-	-	-	-	-
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	—	—	—	—	—
------------	----------------	---	---	---	---	---

7.4.7.4 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自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。

7.4.7.4.2 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

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。

7.4.7.5 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。

7.4.7.6 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
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。

7.4.8.2 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
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。

7.4.8.3 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	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	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

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	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	户均持有的基	持有人结构
-------	--------	-------

(户)	金份额	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 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、本报告期内未新增租用交易单元。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。