

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招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，投资者在作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。

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金（友邦增利）由友邦华泰中短期债券投资基金（友邦短债）转型而来。转型后基金合同于 2007 年 12 月 3 日生效。原友邦短债的基金份额全部转为友邦增利的 A 类份额，友邦增利的 B 类份额于 2008 年 1 月 9 日开始销售。

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	友邦华泰稳本增利债券	
基金主代码	519519	
交易代码	519519	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2007 年 12 月 3 日	
基金管理人	友邦华泰基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	402,132,543.96 份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级的基金简称:	友邦华泰金字塔稳本增利 债券型基金 A	友邦华泰金字塔稳本增利 债券型基金 B
下属两级的交易代码:	519519	460003
报告期末下属两级基金的份额总额	240,664,049.11 份	161,468,494.85 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在控制本金下跌风险的前提下，充分利用资本市场各类资产定价不准确产生的投资机会，实现基金资产的持续稳定增值。	
投资策略	本基金将以固定收益类资产投资为基础，以其投资收益为保障，参照固定比例组合保险机制（CPPI）对风险类资产上限进行动态调整，以有效保障投资组合本金的安全。	
业绩比较基准	中信全债指数×80%+一年期银行定期存款税后收益率×20%	
风险收益特征	属于主动管理的债券型基金，较低风险较低收益。	
	A 类	B 类
下属两级基金的风险收益特征	属于主动管理的债券型基金，较低风险较低收益。	属于主动管理的债券型基金，较低风险较低收益。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	张燕
	联系电话	021-38601777	0755-83199084
	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		400-888-0001	95555
传真		021-38601799	0755-83195201

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

单位：人民币元

2009年		
3.1.1 期间数据和指标	A类	B类
本期已实现收益	18,775,252.82	19,104,315.28
本期利润	11,254,567.01	12,542,055.80
加权平均基金份额本期利润	0.0589	0.0582
本期基金份额净值增长率	5.98%	5.64%
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0794	0.0725
期末基金资产净值	260,479,717.49	173,650,516.00
期末基金份额净值	1.0823	1.0754
2008年		
3.1.1 期间数据和指标	A类	B类
本期已实现收益	49,011,210.54	25,095,354.11
本期利润	58,636,464.57	32,683,743.31
加权平均基金份额本期利润	0.0707	0.0738
本期基金份额净值增长率	9.37%	9.06%
3.1.2 期末数据和指标	2008年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0723	0.0692
期末基金资产净值	347,840,533.66	320,208,076.86
期末基金份额净值	1.0955	1.0924
2007年		
3.1.4 期间数据和指标	A类	B类

本期已实现收益	444,593.85	—
本期利润	1,266,186.99	—
加权平均基金份额本期利润	0.0097	—
本期基金份额净值增长率	0.98%	—
3.1.5 期末数据和指标	2007年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0119	—
期末基金资产净值	131,590,242.80	—
期末基金份额净值	1.0176	—

注：1、本基金于 2007 年 12 月 3 日由友邦华泰中短期债券投资基金（友邦短债）转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金（友邦增利）。原友邦短债基金的基金份额全部转为 A 类份额，B 类基金份额于 2008 年 1 月 9 日开始销售。本报告列示的 2007 年度期间数据和指标、基金份额累计净值增长率的计算区间均为 2007 年 12 月 3 日至 2007 年 12 月 31 日。2、所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。3、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。

3.2 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

分级 A

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	1.73%	0.30%	0.40%	0.04%	1.33%	0.26%
过去六个月	1.09%	0.40%	0.11%	0.04%	0.98%	0.36%
过去一年	5.98%	0.36%	0.67%	0.05%	5.31%	0.31%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今 (2007 年 12 月 03 日 -2009 年 12 月 31 日)	17.06%	0.28%	9.68%	0.07%	7.38%	0.21%

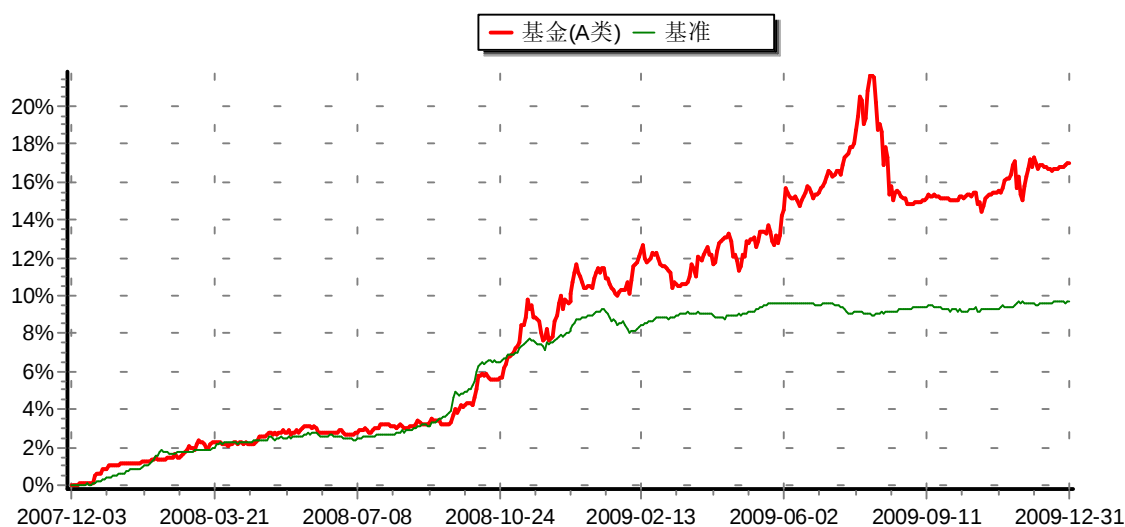
分级 B

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	1.64%	0.30%	0.40%	0.04%	1.24%	0.26%
过去六个月	0.92%	0.40%	0.11%	0.04%	0.81%	0.36%
过去一年	5.64%	0.36%	0.67%	0.05%	4.97%	0.31%

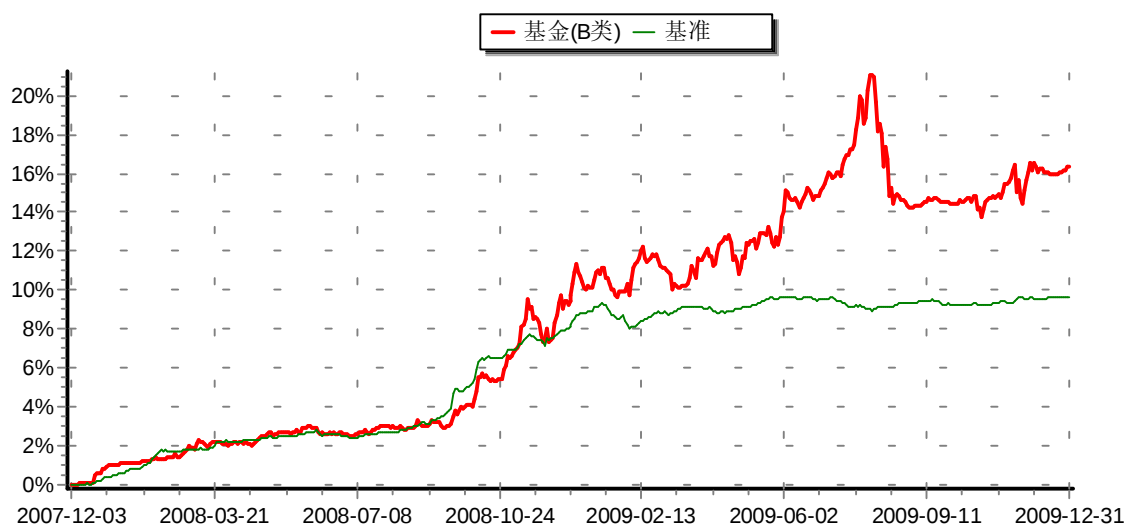
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同 生效起至今 (2007 年 12 月 03 日 -2009 年 12 月 31 日)	16.35%	0.28%	9.68%	0.07%	6.67%	0.21%

注：本基金的业绩基准由中信全债指数和一年期银行定期存款税后收益率按照 80%与 20%之比构建，并每日进行再平衡。

3.2.2 自基金转型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



注：图示日期为2007年12月3日至2009年12月31日。

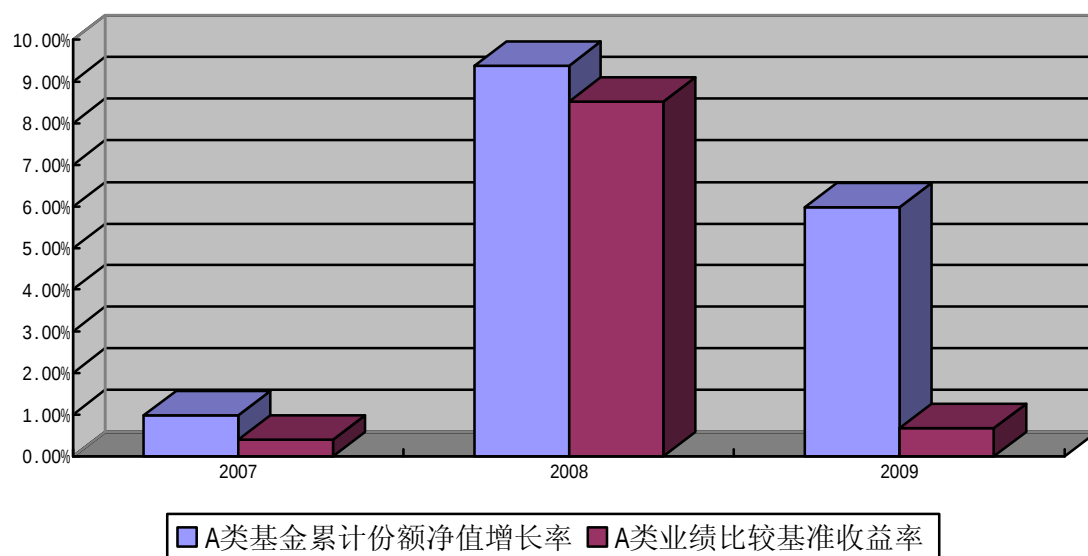


注：图示日期为2007年12月3日至2009年12月31日。

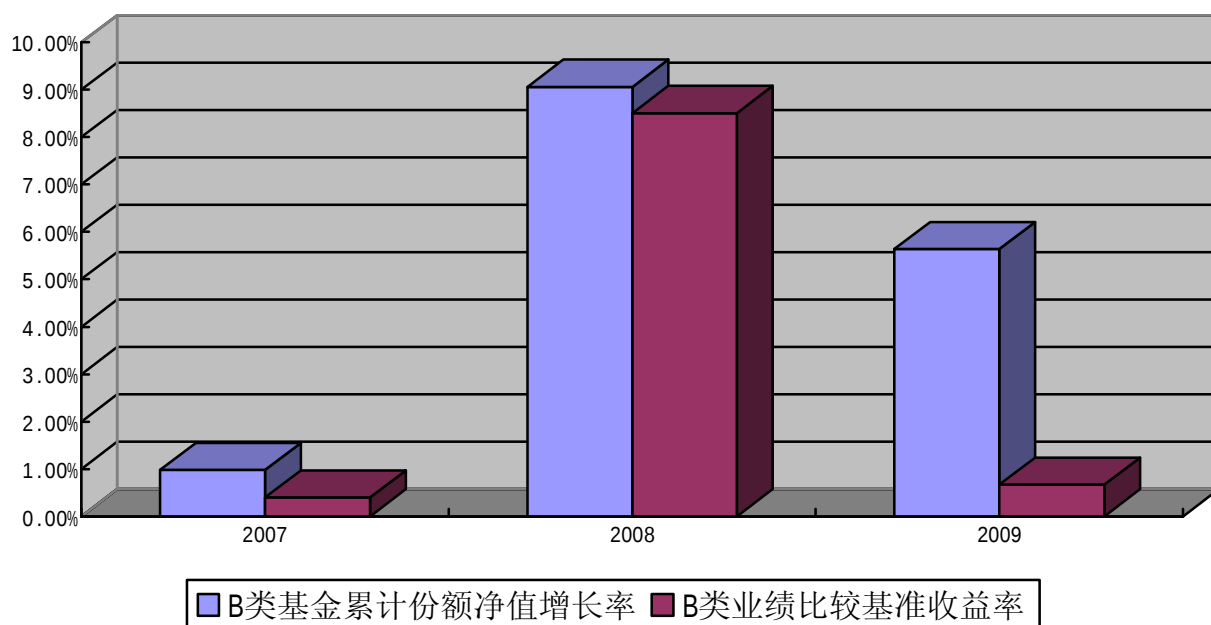
- 1、本基金于2007年12月3日由友邦华泰中短期债券投资基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金。
- 2、按转型后基金合同规定，本基金自转型日起6个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项

投资比例已达到转型后基金合同第十三条（二）投资范围中规定的各项比例，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%，投资于风险类资产（固定收益类资产以外的其它资产，包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的20%。

3.2.3 自基金转型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：基金转型合同于2007年12月3日生效，2007年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。



注：基金转型合同于2007年12月3日生效，2007年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

1、本基金于 2007 年 12 月 3 日由友邦华泰中短期债券投资基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金。

2、按转型后基金合同规定，本基金自转型日起 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转型后基金合同第十三条（二）投资范围中规定的各项比例，投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于风险类资产（固定收益类资产以外的其它资产，包括股票、权证等）的比例不超过基金资产的 20%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

A 类					
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	0.770	10,025,069.17	5,557,828.32	15,582,897.49	4 月 20 日、12 月 28 日实施
2008 年	0.160	406,693.71	1,658,188.75	2,064,882.46	1 月 8 日实施
2007 年	0.130	1,111,333.31	1,355,816.25	2,467,149.56	3 月 5 日、6 月 25 日、9 月 24 日实施
合计	1.06	11,543,096.19	8,571,833.32	20,114,929.51	

B 类					
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	0.770	11,183,305.99	4,625,175.47	15,808,481.46	4 月 20 日、12 月 28 日实施
合计	0.770	11,183,305.99	4,625,175.47	15,808,481.46	

§ 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		
沈涛	本基金的基金经理	2008 年 03 月 04 日	-	16 年	沈涛先生，经济学博士。2005 年 9 月至 2007 年 11 月任易方达基金管理有限公司月月收益中短期债券投资基金基金经理。2007 年 11 月加入友邦华泰基金管理有限公司，2008 年 3 月起任友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金基金经理，2009 年 5 月起兼任友邦华泰货币市场基金基金经理。

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。任职日期和离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《友邦华泰金字塔稳本增利债券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

在整个09年，A股震荡向上，反映了中国经济率先从金融危机中复苏的良好预期。上半年，随着08年底09年初的多项政策一一落实，经济V型反转的趋势越来越明朗，投资者信心也越来越得到加强；而下半年开始，随着复苏的状态被越来越多的反映到上市公司的报表上，宏观政策也逐渐表示出紧缩的倾向。市场在信心和业绩的震荡中不断走强，充裕的流动性提升了整体市场的估值水平，展现了精彩的板块及个股行情，全年看平均涨幅近1倍，许多个股股价涨幅惊人。

相对而言全年债券市场在相信经济复苏的前提下震荡走低，尽管全年看CPI仍是负值，但由于经济环比增速较快，市场已经开始反映由于大量的新增信贷引起的通胀预期，随着紧缩政策的开始，部分投资者积极进入高息票的信用债市场以得到可观的持有期收益。

基金抓住市场的波动，阶段性加大了对权益类投资的比重，获得较好的正收益。除了认购新股以外，基金也进行了部分高收益债券的投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期末，本基金A类和B类基金份额净值分别为1.0823元和1.0754元，分别上涨5.98%和5.64%，同期本基金的业绩比较基准上涨0.67%。

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，我们在无比坚定地确认经济复苏的同时，对可持续发展的路径却开始了争执，而通胀数据的抬头使得我们更多的怀疑流动性充沛的作用。尽管对于工业企业利润增速在上半年继续加快的观点得到越来越多的认同，但股市的表现却未必与此相同，随着央票发行利率的上升，宏观政策的收紧快于大部分投资者的预期，我们未必能期望10年的股市能有09年的收获，但毕竟我们的经济已经开始复苏，阶段性的波动行情应该还是可以期待的。

在债券市场方面，我们可能需要进一步明朗通胀的趋势，但是我们也不能排除经济复苏过程中的反复，好在09年全年市场已经提前反映了相当多的收益率上升的预期，因此对紧缩政策的反应可能不会太过激烈，市场也许能让低风险的投资者有谨慎的乐观的条件。

本基金仍将延续稳定增长的特点，在控制风险的前提下，适当争取更多收益。

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,基金收益每年至少分配一次,基金收益分配每年至多 4 次;全年基金收益分配比例不得低于年度基金可供分配收益的 60%;基金收益分配后每基金份额净值不低于面值。本基金于 2009 年 4 月 20 日实施了本年度第一次收益分配,每 10 份基金份额获得 0.47 元红利,于 2009 年 12 月 28 日实施了本年度第二次收益分配,每 10 份基金份额获得 0.30 元红利。截至本报告期末,基金可分配收益为 A 类: 0.0794 元/份和 B 类: 0.0725 元/份。

§ 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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

招商银行股份有限公司
2010 年 3 月 25 日

§ 6 审计报告

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 20170 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：友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金

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	98,690,657.43	11,569,015.68
结算备付金		1,860,813.70	2,064,122.56
存出保证金		510,000.00	510,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	372,450,530.76	751,271,529.97
其中：股票投资		10,097,148.89	36,550,188.38
基金投资		-	-
债券投资		351,083,446.28	700,280,674.80
资产支持证券投资		11,269,935.59	14,440,666.79
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		-	1,778,008.16
应收利息	7.4.7.5	2,799,195.08	12,121,805.45
应收股利		-	-
应收申购款		127,199.80	3,289,613.96
递延所得税资产		-	-
其它资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		476,438,396.77	782,604,095.78
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		40,000,000.00	109,999,775.00
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		228,356.47	3,305,217.68
应付管理人报酬		263,961.67	393,216.39
应付托管费		75,417.62	112,347.57
应付销售服务费		45,901.57	81,989.33
应付交易费用	7.4.7.7	616,544.19	121,992.21
应交税费		577,311.60	85,200.00
应付利息		5,329.74	10,047.82

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其它负债	7.4.7.8	495,340.42	445,699.26
负债合计		42,308,163.28	114,555,485.26
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	402,132,543.96	610,639,133.45
未分配利润	7.4.7.10	31,997,689.53	57,409,477.07
所有者权益合计		434,130,233.49	668,048,610.52
负债和所有者权益总计		476,438,396.77	782,604,095.78

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额总额为 402,132,543.96 份，其中 A 类基金份额净值 1.0823 元，A 类基金份额总额 240,664,049.11 份；B 类基金份额净值 1.0754 元，B 类基金份额总额 161,468,494.85 份。

7.2 利润表

会计主体：友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金

本报告期：2009 年 01 月 01 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 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
一、收入		32,098,307.30	111,313,672.03
1.利息收入		12,331,117.64	44,684,080.86
其中：存款利息收入	7.4.7.11	311,547.95	2,054,204.51
债券利息收入		11,559,223.19	40,456,446.25
资产支持证券利息收入		460,346.50	728,488.40
买入返售金融资产收入		-	1,444,941.70
其它利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		33,375,150.36	46,029,209.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	30,008,632.37	8,081,911.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,414,875.10	37,433,829.22
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	202,032.91
股利收益	7.4.7.15	951,642.89	311,435.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-14,082,945.29	17,213,643.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其它收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	474,984.59	3,386,738.30
减：二、费用		8,301,684.49	19,993,464.15
1. 管理人报酬		3,144,320.14	9,097,971.20
2. 托管费		898,377.17	2,599,420.31

3. 销售服务费		712,546.29	1,336,614.05
4. 交易费用	7.4.7.18	2,805,724.52	666,528.45
5. 利息支出		558,452.41	6,051,781.58
其中：卖出回购金融资产支出		558,452.41	6,051,781.58
6. 其它费用	7.4.7.19	182,263.96	241,148.56
三、利润总额		23,796,622.81	91,320,207.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日 至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2009 年 01 月 01 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（基金净值）	610,639,133.45	57,409,477.07	668,048,610.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	23,796,622.81	23,796,622.81
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）	-208,506,589.49	-17,817,031.40	-226,323,620.89
其中：1.基金申购款	382,430,067.52	37,693,295.10	420,123,362.62
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-590,936,657.01	-55,510,326.50	-646,446,983.51
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）	-	-31,391,378.95	-31,391,378.95
五、期末所有者权益（基金净值）	402,132,543.96	31,997,689.53	434,130,233.49
项目	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 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）	129,313,489.43	2,276,753.37	131,590,242.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	91,320,207.88	91,320,207.88
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）	481,325,644.02	-34,122,601.72	447,203,042.30
其中：1.基金申购款	2,401,821,008.96	28,419,794.06	2,430,240,803.02
2.基金赎回款（以“-”号填列）	-1,920,495,364.94	-62,542,395.78	-1,983,037,760.72
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	-	-2,064,882.46	-2,064,882.46

减少以“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	610,639,133.45	57,409,477.07	668,048,610.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 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

友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金(原友邦华泰中短期债券投资基金)(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[2006]第 37 号《关于同意友邦华泰中短期债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《友邦华泰中短期债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 5,652,942,702.72 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(2006)第 32 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》于 2006 年 4 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,654,301,635.20 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,358,932.48 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据本基金基金份额持有人大会审议通过的《关于友邦华泰中短期债券投资基金转型为友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金有关事项的议案》,并经中国证监会证监基金字[2007]第 323 号《关于核准友邦华泰中短期债券投资基金基金份额持有人大会有关变更基金类别决议的批复》,本基金的基金类别自 2007 年 12 月 3 日起由原中短期债券基金转型为普通债券型基金。《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金托管协议》自 2007 年 12 月 3 日起生效,原《友邦华泰中短期债券投资基金基金合同》和《友邦华泰中短期债券投资基金托管协议》自同一起失效。

根据《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》和《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,自 2007 年 12 月 3 日起,本基金根据申购费用和销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时分级收取前端申购费用但免收销售服务费的称为 A 类,而不收取前端申购费用只从本类别基金资产中计提销售服务费的称为 B 类。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和实施转型后修订的《友邦华泰金字塔稳本增利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围自 2007 年 12 月 3 日起变更为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票、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。其中,固定收益类资产(包括国债、金融债、企业债、可转换债券、资产支持证券、央行票据、债券回购、同业存款等)的比例不低于基金资产的 80%,投资于风险类资产(固定收益类资产以外的其它资产,包括股票、权证等)的比例不超过基金资产的 20%。此外,本基金可以参与一级市场新股申购,并持有因在一级市场申购所获得的股票以及因可转债转股所形成的股票,也可以直接投资于二级市场中的股票、权证等,还可以持有股

票所派发的权证、可分离债券产生的权证。本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券(含政策性金融债、央行票据)不低于基金资产净值的 5%，持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的 3%。本基金的转型后业绩比较基准为：中信全债指数 $\times 80\%$ +一年期银行定期存款税后收益率 $\times 20\%$ 。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》、《友邦华泰金字塔稳本增利债券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。

7.4.9 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
招商银行股份有限公司	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(“华泰联合证券”)	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、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。

2、根据中国证监会证监许可[2009]921 号《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”的名称于 2009 年 9 月 17 日变更为“华泰联合证券有限责任公司”。

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日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日至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	1,793,859,696.17	100.00%	313,380,752.52	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年01月01日至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	-	-	36,157,942.44	100.00%

7.4.10.1.3 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日至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	占期末应付 佣金总额的 比例
华泰证券股份有限公司	1,500,929.97	100.00%	611,774.99	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2008年01月01日至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	占期末应付 佣金总额的 比例
华泰证券股份有限公司	263,230.88	100.00%	107,725.21	100.00%

注：上述佣金在基金转型之前按债券和回购交易量的十万分之一点五计算，以扣除由交易所或中国证券登记结算有限责任公司收取的费用，以及由券商承担的债券和回购交易的证券结算风险基金后的净额列示，转型之后按股票交易量的千分之一计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。本基金未租用其他券商专用交易单元。

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日至 2009年12月31日	上年度可比期间 2008年01月01日至 2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,144,320.14	9,097,971.20
其中：应支付给销售机构的客户	493,949.02	898,914.68

维护费

注:转型前,本基金应支付基金管理人报酬,按前一日基金资产净值的 0.45%的年费率计提。转型后,本基金应支付基金管理人报酬,按前一日基金资产净值的 0.70%的年费率计提,计算方法如下: $H = E \times 0.70\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资产净值 基金管理人报酬每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	898,377.17	2,599,420.31

注:转型前,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 0.15%的年费率计提。转型后,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 0.20%的年费率计提,计算方法如下: $H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$ 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。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日		
	当期应支付的销售服务费		
	A 级	B 级	合计
友邦华泰基金管理有限公司	-	33,310.38	33,310.38
招商银行股份有限公司	-	78,398.00	78,398.00
华泰证券股份有限公司	-	197,826.89	197,826.89
华泰联合证券有限责任公司	-	1,907.13	1,907.13
合计	-	311,442.40	311,442.40
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日		
	当期应支付的销售服务费		
	A 级	B 级	合计
友邦华泰基金管理有限公司	-	67,132.25	67,132.25
招商银行股份有限公司	-	91,917.91	91,917.91
华泰证券股份有限公司	-	332,251.78	332,251.78
华泰联合证券有限责任公司	-	10,478.93	10,478.93
合计	-	501,780.87	501,780.87

注:转型前,本基金应支付销售机构的销售服务费,按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。转型后,本基金A类基金份额不再计提销售服务费,B类基金份额应支付销售机构的销售服务费,按前一日基金资产净值的0.30%的年费率计提,计算方法如下:

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H为每日B类基金份额应支付的销售服务费

E为前一日的B类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提,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付给基金管理人,由基金管理人支付给各基金销售机构。

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 日至 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
招商银行股份有限公司	-	120,416,101.37	-	-	-	-
上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 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
招商银行股份有限公司	30,195,416.07	48,810,752.74	-	-	645,600,000.00	408,585.21

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

A类		
项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	-	-
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	-	-
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	-

B类		
项目	本期 2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日
基金合同生效日持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	39,849,573.89	-
期间申购/买入总份额	-	39,849,573.89
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	10,000,000.00	-
期末持有的基金份额	29,849,573.89	39,849,573.89
期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.42%	6.53%

注：1、友邦华泰基金管理有限公司于2009年1月9日通过华泰证券股份有限公司赎回友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金B类(基金代码460003) 1000万元，无赎回费。

2、友邦华泰基金管理有限公司于2008年1月9日通过华泰证券股份有限公司申购友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金B类(基金代码460003) 1000万元，无申购费。

3、友邦华泰基金管理有限公司于2008年1月28日通过华泰证券股份有限公司申购友邦华泰金字塔稳本增利债券型基金B类(基金代码460003) 3000万元，无申购费。

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

A 类				
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
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	-	-	102,513,013.01	16.79%

B 类				
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
AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)	-	-	-	-

注：基金管理人的股东 AIG Global Investment Corp.(AIGGIC)通过合格境外机构投资者(QFII)持有本基金 A 类份额，申购费用参照基金管理人公布的费率。

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 日至 2009 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2008 年 01 月 01 日至 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
招商银行股份有限公司	98,690,657.43	280,985.20	11,569,015.68	1,991,683.65

注：本报告期，基金托管人招商银行股份有限公司保管的银行存款按银行间同业存款利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其它关联交易事项的说明

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
002328	新朋股份	2009-12-22	2010-03-30	新发流通受限	19.38	26.55	97,087.00	1,881,546.06	2,577,659.85	.
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	新发流通受限	28.58	55.43	29,714.00	849,226.12	1,647,047.02	.
002307	北新路桥	2009-11-05	2010-02-11	新发流通受限	8.58	27.40	60,106.00	515,709.48	1,646,904.40	.
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	新发流通受限	23.80	31.83	31,977.00	761,052.60	1,017,827.91	.
002326	永太科技	2009-12-15	2010-03-22	新发流通受限	20.00	31.27	28,246.00	564,920.00	883,252.42	.
002332	仙琚制药	2009-12-30	2010-04-12	新发流通受限	8.20	8.20	97,147.00	796,605.40	796,605.40	.
002305	南国置业	2009-10-29	2010-02-08	新发流通受限	12.30	19.57	37,013.00	455,259.90	724,344.41	.
002315	焦点科技	2009-12-01	2010-03-09	新发流通受限	42.00	69.18	10,186.00	427,812.00	704,667.48	.
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新发流通受限	5.43	5.43	13,000.00	70,590.00	70,590.00	.
300041	回天胶业	2009-12-28	2010-01-08	新发流通受限	36.40	36.40	500.00	18,200.00	18,200.00	.
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-01-06	新发流通受限	20.10	20.10	500.00	10,050.00	10,050.00	.

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

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

截至本报告期末，本基金银行间市场债券正回购余额为 0。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 40,000,000.00 元，于 2010 年 1 月 4 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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	10,097,148.89	2.12
	其中：股票	10,097,148.89	2.12
2	固定收益投资	362,353,381.87	76.05
	其中：债券	351,083,446.28	73.69
	资产支持证券	11,269,935.59	2.37
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	100,551,471.13	21.10
6	其它各项资产	3,436,394.88	0.72
7	合计	476,438,396.77	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	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	4,285,767.67	0.99
C0	食品、饮料	10,050.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	901,452.42	0.21
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	2,577,659.85	0.59
C7	机械、设备、仪表	-	-
C8	医药、生物制品	796,605.40	0.18
C99	其它制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	1,717,494.40	0.40
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	1,722,495.39	0.40
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	724,344.41	0.17
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	1,647,047.02	0.38
M	综合类	-	-
	合计	10,097,148.89	2.33

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	002328	新朋股份	97,087.00	2,577,659.85	0.59
2	300027	华谊兄弟	29,714.00	1,647,047.02	0.38

3	002307	北新路桥	60,106.00	1,646,904.40	0.38
4	002308	威创股份	31,977.00	1,017,827.91	0.23
5	002326	永太科技	28,246.00	883,252.42	0.20
6	002332	仙琚制药	97,147.00	796,605.40	0.18
7	002305	南国置业	37,013.00	724,344.41	0.17
8	002315	焦点科技	10,186.00	704,667.48	0.16
9	601117	中国化学	13,000.00	70,590.00	0.02
10	300041	回天胶业	500.00	18,200.00	0.00

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本基金公司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	52,502,116.27	7.86
2	600030	中信证券	41,875,988.80	6.27
3	000629	攀钢钢钒	39,293,500.00	5.88
4	600028	中国石化	33,961,607.93	5.08
5	601328	交通银行	29,694,805.06	4.45
6	000060	中金岭南	29,487,623.58	4.41
7	600837	海通证券	24,873,852.18	3.72
8	601666	平煤股份	24,321,248.53	3.64
9	601628	中国人寿	21,341,771.88	3.19
10	600362	江西铜业	20,376,690.31	3.05
11	000568	泸州老窖	16,545,504.86	2.48
12	002024	苏宁电器	15,535,815.65	2.33
13	000001	深发展 A	15,022,774.54	2.25
14	000537	广宇发展	14,777,527.70	2.21
15	000012	南玻 A	14,742,892.50	2.21
16	601601	中国太保	14,362,241.20	2.15
17	600019	宝钢股份	14,359,875.67	2.15
18	600005	武钢股份	14,339,214.79	2.15
19	600887	*ST 伊利	13,606,758.73	2.04
20	601699	潞安环能	13,244,966.50	1.98

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	55,113,371.26	8.25
2	000629	攀钢钢钒	45,862,480.13	6.87
3	600030	中信证券	43,350,506.49	6.49
4	600028	中国石化	34,015,109.28	5.09
5	000060	中金岭南	31,736,145.46	4.75
6	601328	交通银行	28,700,382.88	4.30
7	600837	海通证券	26,919,808.22	4.03
8	601666	平煤股份	25,583,647.29	3.83
9	600362	江西铜业	24,656,134.97	3.69
10	601628	中国人寿	21,183,766.81	3.17
11	000001	深发展 A	19,136,492.40	2.86
12	000568	泸州老窖	17,998,585.55	2.69
13	002024	苏宁电器	17,111,963.50	2.56
14	601699	潞安环能	16,146,050.12	2.42
15	000012	南玻 A	15,426,673.11	2.31
16	600000	浦发银行	13,743,022.48	2.06
17	600089	特变电工	13,599,657.21	2.04
18	601601	中国太保	13,569,521.73	2.03
19	600219	南山铝业	13,202,187.03	1.98
20	601668	中国建筑	12,729,288.06	1.91

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	875,953,828.50
卖出股票收入（成交）总额	942,742,609.57

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	77,920,831.70	17.95

2	央行票据	69,769,000.00	16.07
3	金融债券	128,642,000.00	29.63
	其中：政策性金融债	128,642,000.00	29.63
4	企业债券	64,757,614.58	14.92
5	企业短期融资券	9,994,000.00	2.30
6	可转债	-	-
7	其它	-	-
8	合计	351,083,446.28	80.87

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	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	080404	08 农发 04	500,000.00	50,075,000.00	11.53
2	0901049	09 央行票据 49	500,000.00	49,835,000.00	11.48
3	010203	02 国债(3)	391,490.00	39,669,681.70	9.14
4	080312	08 进出 12	400,000.00	38,416,000.00	8.85
5	010112	21 国债(12)	373,000.00	38,251,150.00	8.81

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	119004	澜 电 03	100,000.00	10,001,642.59	2.30
2	119005	浦建收益	130,000.00	1,268,293.00	0.29

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

报告期内本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	510,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,799,195.08
5	应收申购款	127,199.80
6	其它应收款	-
7	待摊费用	-
8	其它	-
9	合计	3,436,394.88

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	002328	新朋股份	2,577,659.85	0.59	网下中签新股未上市
2	300027	华谊兄弟	1,647,047.02	0.38	网下中签新股未上市
3	002307	北新路桥	1,646,904.40	0.38	网下中签新股未上市
4	002308	威创股份	1,017,827.91	0.23	网下中签新股未上市
5	002326	永太科技	883,252.42	0.20	网下中签新股未上市
6	002332	仙琚制药	796,605.40	0.18	网下中签新股未上市
7	002305	南国置业	724,344.41	0.17	网下中签新股未上市
8	002315	焦点科技	704,667.48	0.16	网下中签新股未上市
9	601117	中国化学	70,590.00	0.02	网上中签新股未上市
10	300041	回天胶业	18,200.00	0.00	网上中签新股未上市

§ 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

份额 级别	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

A 级	1,290	186,561.28	204,736,665.51	85.07%	35,927,383.60	14.93%
B 级	6,018	26,830.92	31,127,874.41	19.28%	130,340,620.44	80.72%
合计	7,308	55,026.35	235,864,539.92	58.65%	166,268,004.04	41.35%

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	份额级别	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	B 级	4,683.15	0.00%
	合计	4,683.15	0.00%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	A 类	B 类
基金合同生效日（2007 年 12 月 3 日） 基金份额总额	131,333,847.25	-
本报告期期初基金份额总额	317,507,501.75	293,131,631.7
本报告期基金总申购份额	269,242,068.14	113,187,999.38
减：本报告期基金总赎回份额	346,085,520.78	244,851,136.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	240,664,049.11	161,468,494.85

§ 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

报告期内基金管理人、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45,000.00元人民币，该事务所已向本基金提供了4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	
华泰证券	2	1,793,859,696.17	100.00%	1,500,929.97	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，无变更租用证券公司交易单元的情况。

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
华泰证券	450,186,504.88	100.00%	600,000,000.00	100.00%	-	-