

友邦华泰价值增长股票型证券投资基金2009年半年度报告摘要

2009年06月30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：2009年08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。本半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2009年8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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至2009年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	友邦华泰价值增长股票型证券投资基金
基金简称	友邦华泰价值增长股票
交易代码	460005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年07月16日
报告期末基金份额总额	194,090,058.56

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	友邦华泰基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@aig-huatai.com
客户服务电话	400-888-0001	95566
传真	021-38601799	010-66594942
注册地址	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	北京复兴门内大街1号
办公地址	上海市浦东新区民生路1199弄证大五道口广场1号楼17层	北京复兴门内大街1号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	齐亮	肖钢

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.aig-huatai.com
基金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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
本期已实现收益	72,797,897.11
本期利润	135,299,892.64
加权平均基金份额本期利润	0.5862
本期基金份额净值增长率	62.98%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年01月01日-2009年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.2577
期末基金资产净值	292,126,715.87
期末基金份额净值	1.5051

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。

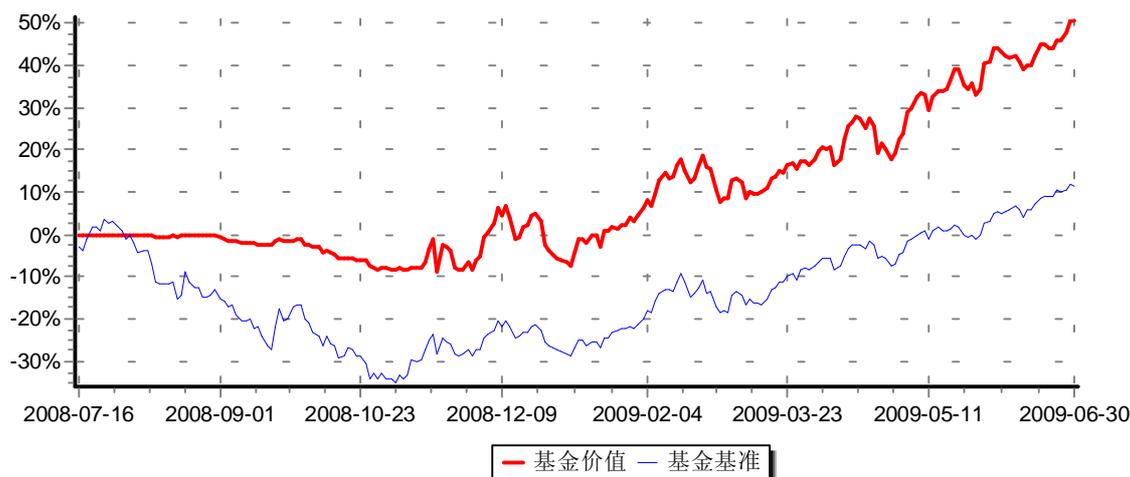
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	11.94%	1.32%	11.62%	0.98%	0.32%	0.34%
过去三个月	27.88%	1.75%	20.74%	1.24%	7.14%	0.51%
过去六个月	62.98%	1.77%	56.52%	1.57%	6.46%	0.20%
自基金合同生效日起至今（2008年07月16日-2009年06月30日）	50.51%	1.72%	11.56%	2.05%	38.95%	-0.33%

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



注：图示日期为2008年7月16日至2009年6月30日。

- 1、本基金基金合同生效日为2008年7月16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%。

§ 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。目前的股东构成为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和友邦华泰货币市场证券投资基金。截至2009年6月30日，公司管理规模为194.63亿元。

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	2008年07月16日	—	15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。
--	--	--	--	--	--

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人公司作出决定之日。

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

1、行情回顾及运作分析

09年上半年，股市见底回升，走出了08年熊市阴影，市场信心从逐步恢复到渐入狂热，上证指数涨幅超过60%。

本基金较为准确地分析了政府投资对中国经济的拉动作用和经济强劲复苏趋势以及投资者对基本面预期的良性变化，保持了较高仓位的股票配置，获得了较好的投资收益。

2、本基金业绩表现

截至本报告期末，本基金份额净值为1.5051元，累计净值为1.5051元，本报告期内基金份额净值上涨62.98%，本基金的业绩比较基准上涨56.52%。

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09年下半年,中国经济将继续沿着复苏的轨道前行。经济增长焕发出新的动力,政府扩大内需的4万亿财政刺激措施继续发挥作用,房地产和汽车等对内需拉动显著的产业超预期快速回升成为经济复苏的新引擎。美国等OECD国家危机已过,拐点初现,预示着中国出口回升的脚步已近。另一方面,全球央行为应对金融危机所释放的流动性由避险转向收益,大规模涌入商品、股票和地产等高风险资产,货币相对于资产贬值的压力越来越大。

展望未来,我们看到有一些新的变化将是重要的投资机会,流动性过剩和经济复苏交织在一起会催生资源和资产价格膨胀,通胀预期可能是重要投资主题,我们看好金融、地产、能源、有色、材料、汽车、家电等资源和资产行业以及受益于资源资产价格上涨的公司。

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。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50,020,402.37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”)在对XXXCX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

本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据核对无误。(注:财务会计报告中的“金融工具风险管理”部分未在托管人复核范围内。)

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年06月30日	上年度末 2008年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	17,621,141.20	37,836,182.33
结算备付金		1,015,407.55	2,314,207.98
存出保证金		710,444.64	500,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	270,072,428.83	219,249,475.30
其中：股票投资		270,072,428.83	219,249,475.30
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		594,000.00	38,967.25
应收利息	6.4.7.5	6,343.41	7,573.45
应收股利		60,264.00	—
应收申购款		5,363,000.19	89,073.38
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		295,443,029.82	260,035,479.69
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年06月30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		1,666,006.94	284,391.53
应付管理人报酬		425,818.21	369,503.35
应付托管费		70,969.69	61,583.88
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	415,552.52	424,940.69
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
其他负债	6.4.7.8	737,966.59	677,023.45
负债合计		3,316,313.95	6,632,600.02

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	194,090,058.56	274,400,011.91
未分配利润	6.4.7.10	98,036,657.31	-20,997,132.24
所有者权益合计		292,126,715.87	253,402,879.67
负债和所有者权益总计		295,443,029.82	260,035,479.69

注：报告截止日2009年6月30日，基金份额净值1.5051元，基金份额总额194,090,058.56份。

6.2 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6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2009年01月01日-2009年06月30日
一、收入		139,999,607.57
1. 利息收入		207,020.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	140,308.62
债券利息收入		66,711.93
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		76,858,715.54
其中：股票投资收益	6.4.7.12	75,338,687.95
债券投资收益	6.4.7.13	-582,292.80
资产支持证券投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	—
股利收益	6.4.7.15	2,102,320.39
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	62,501,995.53
4. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	431,875.95
二、费用（以“-”号填列）		-4,699,714.93
1. 管理人报酬		-2,078,358.95
2. 托管费		-346,393.21
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	-2,110,080.37
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	-164,882.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		135,299,892.64

6.3 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6月30日

单位：人民币元

项目	本期2009年01月01日-2009年06月30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	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	—	135,299,892.64	135,299,892.64
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-80,309,953.35	-16,266,103.09	-96,576,056.44
其中：1. 基金申购款	190,748,688.06	59,073,380.47	249,822,068.53
2. 基金赎回款	-271,058,641.41	-75,339,483.56	-346,398,124.97
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）	194,090,058.56	98,036,657.31	292,126,715.87

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 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”)、中国证监会基金部通知[2009]4号关于发布《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>(试行)》等问题的通知、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所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2009年1月1日至2009年6月30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6月30日的财务状况以及2009年1月1日至2009年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 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》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(a)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。

(b)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。

(c)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。

(d)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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内,关联方关系未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日	
	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	373,019,200.52	27.50%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30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	303,081.72	26.79%	27,075.64	6.52%

注：上述佣金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。

关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
当期应支付的管理费	2,078,358.95
其中：当期已支付	1,652,540.74
期末未支付	425,818.21

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：

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
当期应支付的托管费	346,393.21
其中：当期已支付	275,423.52
期末未支付	70,969.69

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2009年01月01日-2009年06月30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	—	—	—	—	—	—

注：无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2009年01月01日-2009年06月30日
期初持有的基金份额	10,007,525.00
期间申购/买入总份额	—
期间赎回/卖出总份额	—
期间由于拆分增加的份额	—
期末持有的基金份额	10,007,525.00
占基金总份额比例	5.16%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

	2009年06月30日		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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年01月01日-2009年06月30日	
	期末 存款余额	当期 存款利息收入
中国银行股份有限公司	17,621,141.20	132,739.85

注：本报告期，基金托管人中国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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

无。

6.4.12 期末（2009年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	270,072,428.83	91.41
	其中：股票	270,072,428.83	91.41
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	18,636,548.75	6.31
6	其他资产	6,734,052.24	2.28
7	合计	295,443,029.82	100.00

7.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采掘业	60,219,756.00	20.61
C	制造业	55,680,993.01	19.06
C0	食品、饮料	2,864,658.50	0.98
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	6,192,647.24	2.12
C5	电子	1,649,560.00	0.56
C6	金属、非金属	16,490,947.51	5.65
C7	机械、设备、仪表	10,994,827.51	3.76
C8	医药、生物制品	9,816,688.45	3.36
C99	其他制造业	7,671,663.80	2.63
D	电力、煤气及水的生产和供应业	6,246,029.47	2.14
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	1,213,000.00	0.42
G	信息技术业	656,000.00	0.22
H	批发和零售贸易	6,927,000.00	2.37
I	金融、保险业	93,845,707.20	32.12
J	房地产业	37,405,226.65	12.80

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

K	社会服务业	4,336,716.50	1.48
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	3,542,000.00	1.21
	合计	270,072,428.83	92.45

7.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	470,000	17,441,700.00	5.97
2	600000	浦发银行	630,722	14,519,220.44	4.97
3	601001	大同煤业	369,999	13,460,563.62	4.61
4	600383	金地集团	674,500	10,872,940.00	3.72
5	000983	西山煤电	359,999	10,763,970.10	3.68
6	600123	兰花科创	299,846	10,575,568.42	3.62
7	000024	招商地产	290,000	9,207,500.00	3.15
8	601328	交通银行	890,000	8,018,900.00	2.75
9	600016	民生银行	1,000,000	7,920,000.00	2.71
10	601699	潞安环能	199,914	7,894,603.86	2.70

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读载于基金管理人网站（www.aig-huatai.com）的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	19,119,945.88	7.55
2	600036	招商银行	17,829,820.41	7.04
3	000969	安泰科技	17,664,664.26	6.97
4	601001	大同煤业	16,172,309.21	6.38
5	000001	深发展A	15,234,266.00	6.01
6	601166	兴业银行	13,543,020.03	5.34
7	000060	中金岭南	11,967,733.54	4.72
8	600123	兰花科创	11,905,465.05	4.70
9	000983	西山煤电	10,383,305.95	4.10
10	000878	云南铜业	9,750,486.46	3.85
11	002202	金风科技	9,665,536.93	3.81
12	000960	锡业股份	9,131,967.52	3.60
13	600583	海油工程	9,083,623.36	3.58
14	000686	东北证券	9,014,863.91	3.56
15	600383	金地集团	8,795,033.30	3.47

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

16	601318	中国平安	8,598,099.52	3.39
17	600015	华夏银行	8,517,963.43	3.36
18	600997	开滦股份	8,086,488.10	3.19
19	601699	潞安环能	8,063,497.16	3.18
20	600432	吉恩镍业	7,977,283.18	3.15
21	000937	金牛能源	7,822,834.41	3.09
22	002123	荣信股份	7,727,258.25	3.05
23	002254	烟台氨纶	7,666,654.07	3.03
24	601601	中国太保	7,473,921.50	2.95
25	600325	华发股份	7,317,420.79	2.89
26	000024	招商地产	7,094,149.84	2.80
27	600016	民生银行	6,792,020.00	2.68
28	601328	交通银行	6,485,145.00	2.56
29	000933	神火股份	6,328,096.87	2.50
30	601939	建设银行	5,734,490.00	2.26
31	600415	小商品城	5,677,070.70	2.24
32	601958	金钼股份	5,618,418.02	2.22
33	000655	金岭矿业	5,590,004.11	2.21
34	601169	北京银行	5,506,481.35	2.17
35	000562	宏源证券	5,472,413.65	2.16
36	002092	中泰化学	5,229,406.60	2.06
37	600837	海通证券	5,204,197.00	2.05
38	601398	工商银行	5,104,484.00	2.01

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 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	19,610,168.94	7.74
2	600000	浦发银行	19,609,259.28	7.74
3	600415	小商品城	17,339,964.00	6.84
4	601601	中国太保	16,076,755.53	6.34
5	000001	深发展A	15,805,387.68	6.24
6	600036	招商银行	15,491,617.06	6.11
7	000969	安泰科技	15,286,375.99	6.03
8	601699	潞安环能	12,999,364.99	5.13
9	000686	东北证券	11,818,655.42	4.66
10	600015	华夏银行	11,398,146.78	4.50
11	002202	金风科技	11,367,286.30	4.49
12	000060	中金岭南	11,126,792.72	4.39
13	002123	荣信股份	11,022,290.40	4.35

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

14	000878	云南铜业	10,852,414.57	4.28
15	601808	中海油服	10,654,686.09	4.20
16	601899	紫金矿业	9,568,730.79	3.78
17	600583	海油工程	9,131,438.04	3.60
18	600607	上实医药	8,967,469.69	3.54
19	600030	中信证券	8,963,830.00	3.54
20	000623	吉林敖东	8,521,854.36	3.36
21	601001	大同煤业	8,360,490.00	3.30
22	600997	开滦股份	8,226,037.15	3.25
23	002254	烟台氨纶	8,175,643.60	3.23
24	600031	三一重工	8,172,542.98	3.23
25	000951	中国重汽	7,939,196.07	3.13
26	600432	吉恩镍业	7,832,846.88	3.09
27	000157	中联重科	7,380,985.87	2.91
28	000960	锡业股份	6,866,405.52	2.71
29	600078	澄星股份	6,562,358.71	2.59
30	600887	*ST伊利	6,384,817.00	2.52
31	000655	金岭矿业	6,346,535.06	2.50
32	600703	三安光电	6,306,490.06	2.49
33	600325	华发股份	6,296,258.95	2.48
34	600779	水井坊	6,236,194.08	2.46
35	000933	神火股份	6,139,081.59	2.42
36	000937	金牛能源	6,032,458.00	2.38
37	000425	徐工科技	6,012,965.59	2.37
38	002028	思源电气	5,929,526.00	2.34
39	600352	浙江龙盛	5,848,199.40	2.31
40	600048	保利地产	5,649,872.50	2.23
41	002147	方圆支承	5,637,611.94	2.22
42	000562	宏源证券	5,565,224.50	2.20
43	600694	大商股份	5,463,682.32	2.16
44	000608	阳光股份	5,352,887.83	2.11
45	000028	一致药业	5,330,238.89	2.10
46	000963	华东医药	5,295,008.13	2.09
47	600017	日照港	5,203,505.00	2.05
48	002215	诺普信	5,192,156.05	2.05

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	634,614,574.03
卖出股票的收入（成交）总额	721,632,303.98

注：不考虑相关交易费用。

7.5 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	—	—
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	—	—

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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

本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 其他资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	710,444.64
2	应收证券清算款	594,000.00
3	应收股利	60,264.00
4	应收利息	6,343.41
5	应收申购款	5,363,000.19
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	6,734,052.24

7.9.4 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。

7.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
5,060	38,357.72	115,277,447.29	59.39%	78,812,611.27	40.61%

8.2 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	1,638,707.05	0.84%

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	274,400,011.91
报告期期间基金总申购份额	190,748,688.06
报告期期间基金总赎回份额	271,058,641.41
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
报告期期末基金份额总额	194,090,058.56

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例
东海证券	1	457,975,110.53	33.77%	107,620,332.20	100.00%		—		—	389,278.58	34.41%
华泰证券	1	373,019,200.52	27.50%		—		—		—	303,081.72	26.79%
江南证券	1	197,099,965.46	14.53%		—		—		—	160,146.03	14.15%
银河证券	1	169,961,027.07	12.53%		—		—		—	144,468.35	12.77%
渤海证券	1	158,191,574.43	11.66%		—		—		—	134,463.03	11.88%

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。

友邦华泰基金

您的一分投资 我们十分对待

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。

友邦华泰基金管理有限公司
2009-08-26