

---

**华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金**  
**2010 年年度报告（摘要）**  
**2010 年 12 月 31 日**

基金管理人：华宝兴业基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2011 年 3 月 21 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	华宝兴业大盘精选股票
基金主代码	240011
交易代码	240011
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008 年 10 月 7 日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
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	915,990,786.85 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在控制风险的前提下，争取基金净值中长期增长超越业绩比较基准。
投资策略	本基金将深入研究大盘股基本面和长期发展前景，注重价值挖掘，通过定量与定性相结合的个股精选策略精选个股，通过对宏观经济、行业经济的把握以及对行业运行周期的认识，调整股票资产在不同行业的投资比例。本基金的大盘股指沪深 A 股按照流通市值从大至小排名在前 1/3 的股票。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金属于证券投资基金中的较高风险、较高收益的品种。

### 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	华宝兴业基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘月华
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、021-38924558	95566
传真	021-38505777	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	www.fsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人办公场所

§ 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	2010 年	2009 年	2008 年 10 月 7 日（基金合同生效日）至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-10,970,546.41	360,795,789.97	5,136,752.33
本期利润	-130,710,890.23	544,752,967.43	5,411,318.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1399	0.8834	0.0113
本期基金份额净值增长率	-3.18%	91.29%	0.98%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配基金份额利润	0.5590	0.6404	0.0098
期末基金资产净值	1,639,035,446.39	2,002,848,552.80	415,073,696.14
期末基金份额净值	1.7894	1.9316	1.0098

注：1、本基金成立于 2008 年 10 月 7 日，T-2 年度比较期间不完整，特此说明。

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。

4、期末可供分配利润采用资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

5、净值相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

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

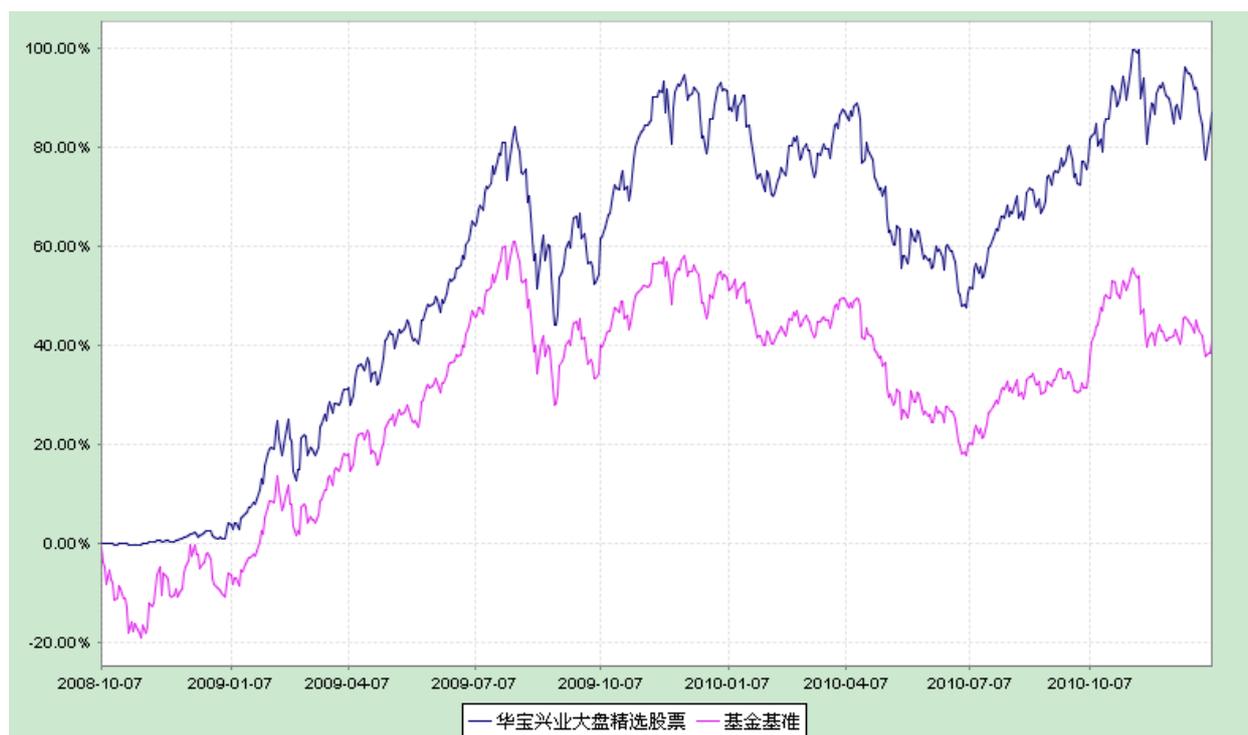
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	5.35%	1.70%	5.31%	1.42%	0.04%	0.28%
过去六个月	24.50%	1.46%	17.68%	1.24%	6.82%	0.22%
过去一年	-3.18%	1.46%	-9.12%	1.26%	5.94%	0.20%
自基金成立起至今	87.01%	1.50%	40.82%	1.60%	46.19%	-0.10%

注：1、本基金比较基准为：沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

2、净值以及比较基准相关数据计算中涉及天数的，包括所有交易日以及季末最后一自然日（如非交易日）。

### 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

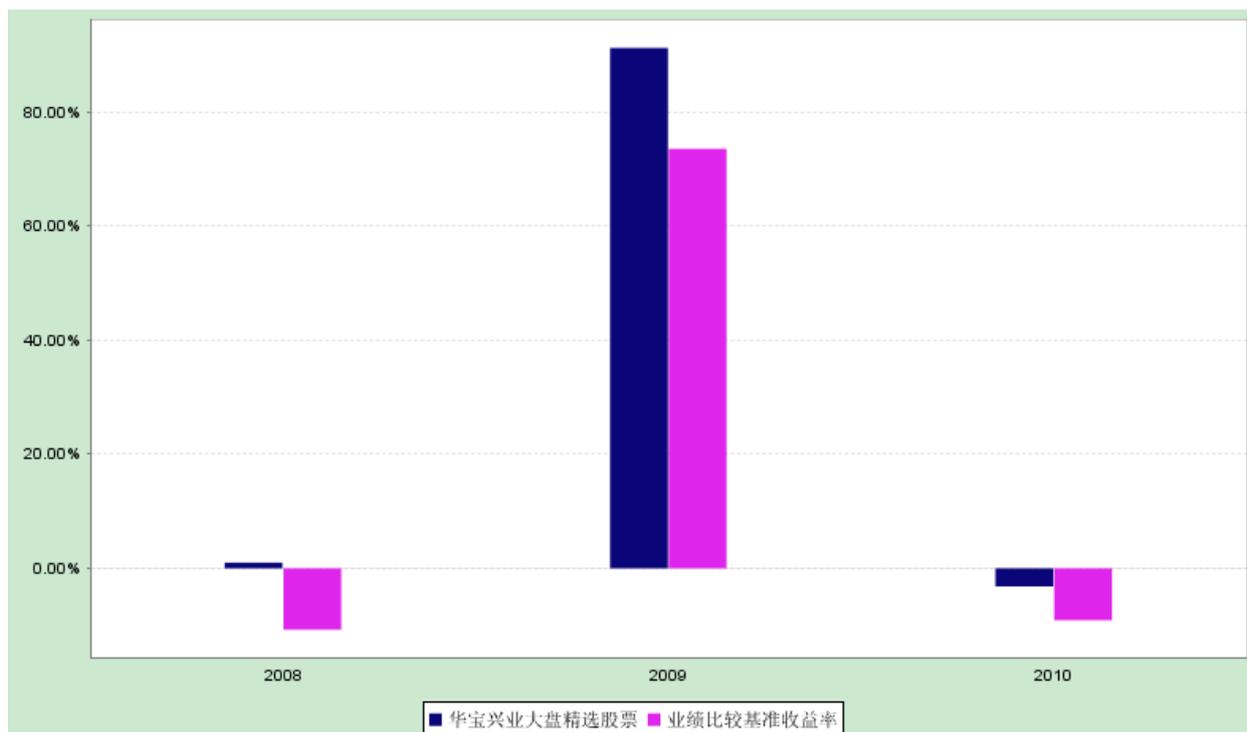
华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2008 年 10 月 7 日至 2010 年 12 月 31 日)



注：按照基金合同的约定，自基金成立日期的 6 个月内达到规定的资产组合，截至 2009 年 4 月 7 日，本基金已达到基金合同规定的资产配置比例。

### 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

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金  
基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：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
2010	0.800	40,915,739.99	44,130,330.42	85,046,070.41	-
2009	-	-	-	-	-
2008	-	-	-	-	-
合计	0.800	40,915,739.99	44,130,330.42	85,046,070.41	-

## § 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

基金管理人是在 2003 年 3 月 7 日正式成立的合资基金管理公司，截至本报告期末（2010 年 12 月 31 日），所管理的开放式证券投资基金包括宝康系列基金、多策略基金、现金宝货币市场基金、动力组合基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金、海外中国成长基金、大盘精选基金、增强收益基金、中证 100 基金、上证 180ETF、上证 180ETF 联接基金以及新兴产业基金，所管理的开放式证券

投资基金资产净值合计 49,349,759,796.83 元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
范红兵	本基金基金经理	2010-07-28	-	10 年	硕士。曾在南方证券股份有限公司、中新苏州工业园创业投资有限公司和平安证券股份有限公司从事证券研究、风险投资工作，于 2007 年 7 月加入华宝兴业基金管理有限公司，先后任高级分析师、基金经理助理。2009 年 2 月至 2010 年 9 月任华宝兴业行业精选股票型证券投资基金基金经理，2010 年 7 月起任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理。
冯刚	本基金基金经理、华宝兴业收益增长混合基金经理	2008-10-07	2010-07-28	10 年	硕士，曾在联合证券有限公司、华安基金管理公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004 年 3 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任高级分析师、基金经理助理，2006 年 6 月至 2010 年 7 月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理，2008 年 10 月至 2010 年 7 月任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理，2009 年 5 月至 2010 年 7 月任国内投资部总经理。
邵喆阳	本基金基金经理助理、华宝兴业收益增长混合基金经理	2008-10-07	2010-08-04	4 年	硕士，拥有 CFA 资格。2005 年 7 月至 2006 年 12 月任安永会计师事务所审计员。2006 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司任行业分析师，2008 年 5 月起任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理，2008 年 9 月至 2010 年 8 月兼任华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金经理助理，2010 年 6 月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期以及离任日期均以基金公告为准。

2、证券从业含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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》及其各项实施细则、《华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于股、债市的系统性风险，大盘精选证券投资基金在短期内出现过个股投资比例略高于 10% 的情况。发生此类情况后，该基金均在合理期限内得到了调整，没有给投资人带来额外风险或损失。

#### 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

本报告期内，基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易部相对投资部门独立、每日交易日结报告等机制，确保所管理的各基金在交易中被公平对待。

本报告期内，基金管理人严格实施公平交易制度；加强了对所管理的不同投资组合间向交易价差的分析；分析结果没有发现交易价差异常。

##### 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

本报告期内，基金管理人管理的其他基金没有与本基金的投资风格相似的投资组合。

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金没有发现异常交易行为。

#### 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

2010 年上半年本基金坚持在经济复苏中寻找机会，在政府扩大内需和调整经济结构中寻找投资标的。但是对于年初以来中央政府对于宏观经济的调控，特别是对房地产行业的调控始料未及，尤其是收紧货币供应，使得以房地产，金融，煤炭，有色，钢铁为代表的大市值板块下跌较多，并进一步带动家电，建材等房地产产业链相关行业的公司股价下跌。2 季度后，本基金及时调整组合结构并适度减少仓位，考虑到经济全面复苏后，政府前期刺激计划有逐步退出的可能，同时政府更多的政策会作用在扩大内需，调整经济结构，平衡区域发展等方面，通过精选个股，不断为组合中加入符合上述投资逻辑的投资标的。

三季度坚持在经济复苏中寻找机会，注重对稳定增长行业、内需消费型行业、新兴产业行业的研究，积极地在政府扩大内需和调整经济结构大方向背景下寻找投资标的。从 7 月下旬开始，本基金调整了组合结构，降低了金融类资产的配置，增加了商业、建筑建材、食品饮料、新兴产业等配置比重，考虑到经济全面复苏后，政府前期刺激计划有逐步退出的可能，同时政府更多的政策会作用在扩大内需，调整经济结构，平衡区域发展等方面，通过精选个股，所以不断为组合中加入符合上述投资逻辑的投资标的。

四季度坚持在国民经济调结构、提高社会保障水平扩大内需和城镇化中寻找投资机会，通过对内需消费型行业、七大新兴产业、中西部区域性产业转移的整体研究，积极地寻找占据产业链上游附加值高的优势企业。从 10 月中下旬开始，本基金调整了组合结构，降低了交运设备和有色的比重，增加了市场错杀的医药、信息服务、机械、建材和电子行业的配置比重。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止本报告期末，本基金单位净值为 1.7894 元，全年基金净值涨幅为-3.18%，基金基准增长率为-9.12%，基金表现领先于基准。

#### 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 2011 年，我们认为国内通胀水平、市场流动性预期、经济转型的力度、资产价格的变化等将成为影响国内资本市场新一年表现的主要因素，贯穿全年。明年物价上涨的趋势将因劳动力成本的上升难以改变，未来中国将面临长期性的通胀水平。从全年时间周期考虑，明年上半年 CPI 将可能会出现冲高回落，但下半年很可能在偏紧政策适度放松和海外经济止跌回升引发大宗商品价格的输入性通胀双重作用下再次出现超预期的通胀可能。流动性方面，在 2010 年 12 月份中央经济工作会议提出将恢复稳健的货币政策下，我们认为明年的货币政策会相对收紧，但从时间分布上很可能是前紧后松。2011 年是“十二五”开局之年，“经济转型”仍是明年经济工作重点，经济发展方式转变引发的宏观经济走势变化以及产业结构调整，决定了 2011 年股市基本面的成色。在国内巨大的内需市场增长潜能、国内城市化和工业化加快推进、消费仍处在高速增长阶段等综合因素影响下，2011 年中国经济将继续保持较高增速。

证券市场方面，国内经济复苏趋势确定，未来市场整体格局将是震荡向上，投资策略上价值股估值反弹，成长股震荡整理、消化估值泡沫，等待时机。从行业配置上适度考虑行业的均衡配置。明年一季度之前，调控通胀的政策紧缩风险加剧，二季度之后，随着通胀警报的逐步解除，政策放松的期待会开始萌动，有助于股市企稳回升。行业配置方面，看好“十二五规划”相关重点行业，重点关注高端装备制造、医药、食品饮料、移动互联网等；同时密切关注政策性的变化可能带来周期性蓝筹

股的阶段性投资机会

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

基金管理人在报告期内对旗下基金估值中，各部门参与如下：

（一）基金会计：根据《基金会计核算业务指引》对基金日常交易进行记账核算，并对基金投资品种进行估值。

（二）金融工程部：对特殊品种或由于特殊原因导致投资品种不存在活跃市场的情况下，为估值提供相关模型。

（三）估值委员会：定期评价现行估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后及时修订估值方法。基金在采用新投资策略或投资新品种时，评价现有估值政策和程序的适用性。

（四）必要时基金经理参与估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期亏损，未有应分未分的利润。

### § 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”）在对华宝兴业大盘精选基金（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

安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，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：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款		181,922,564.20	154,716,695.12
结算备付金		10,656,474.31	5,725,753.43
存出保证金		1,437,510.52	780,879.11
交易性金融资产		1,403,133,753.86	1,859,599,507.51
其中：股票投资		1,403,133,753.86	1,799,214,507.51
基金投资		-	-
债券投资		-	60,385,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		54,411,274.01	2,336,961.65
应收利息		51,634.03	1,346,262.88
应收股利		-	-
应收申购款		907,149.56	13,514,803.59
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		1,652,520,360.49	2,038,020,863.29
<b>负债和所有者权益</b>		<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2010年12月31日	2009年12月31日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,611,361.00	706,980.10
应付赎回款		796,294.65	27,728,804.30
应付管理人报酬		2,251,576.56	2,321,714.74
应付托管费		375,262.78	386,952.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		6,077,761.80	3,856,331.17
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		372,657.31	171,527.71
负债合计		13,484,914.10	35,172,310.49
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		915,990,786.85	1,036,865,347.27
未分配利润		723,044,659.54	965,983,205.53
所有者权益合计		1,639,035,446.39	2,002,848,552.80
负债和所有者权益总计		1,652,520,360.49	2,038,020,863.29

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.7894 元，基金份额总额 915,990,786.85 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目		本期	上年度可比期间
		2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
<b>一、收入</b>		<b>-79,608,063.44</b>	<b>574,756,019.50</b>
1. 利息收入		2,251,585.31	1,983,902.29
其中：存款利息收入		1,288,320.78	823,107.41
债券利息收入		963,264.53	1,160,794.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		35,921,445.18	386,023,538.61

其中：股票投资收益		25,463,595.32	375,354,733.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-297,437.05	2,404,960.76
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		10,755,286.91	8,263,844.35
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-119,740,343.82	183,957,177.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,959,249.89	2,791,401.14
<b>减：二、费用</b>		<b>51,102,826.79</b>	<b>30,003,052.07</b>
1. 管理人报酬		23,631,490.36	14,479,126.39
2. 托管费		3,938,581.76	2,413,187.73
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		23,105,647.77	12,678,646.82
5. 利息支出		13,836.64	6,508.74
其中：卖出回购金融资产支出		13,836.64	6,508.74
6. 其他费用		413,270.26	425,582.39
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-130,710,890.23</b>	<b>544,752,967.43</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-130,710,890.23</b>	<b>544,752,967.43</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	1,036,865,347.27	965,983,205.53	2,002,848,552.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-130,710,890.23	-130,710,890.23
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）	-120,874,560.42	-27,181,585.35	-148,056,145.77
其中：1. 基金申购款	825,040,602.14	639,264,001.46	1,464,304,603.60
2. 基金赎回款	-945,915,162.56	-666,445,586.81	-1,612,360,749.37

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)	-	-85,046,070.41	-85,046,070.41
五、期末所有者权益(基金净值)	915,990,786.85	723,044,659.54	1,639,035,446.39
项目	上年度可比期间 2009年1月1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)	411,025,835.66	4,047,860.48	415,073,696.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	544,752,967.43	544,752,967.43
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)	625,839,511.61	417,182,377.62	1,043,021,889.23
其中：1. 基金申购款	2,094,455,767.78	1,193,992,015.69	3,288,447,783.47
2. 基金赎回款	-1,468,616,256.17	-776,809,638.07	-2,245,425,894.24
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,036,865,347.27	965,983,205.53	2,002,848,552.80

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：裴长江，主管会计工作负责人：黄小慧，会计机构负责人：张幸骏

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)，系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 2008 965 号文《关于核准华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金募集的批复》的核准，由华宝兴业基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集，基金合同于 2008 年 10 月 7 日正式生效，首次设立募集规模为 490,050,880.11 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为华宝兴业基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金对股票投资比例为基金资产净值的 60%-95%，其中投资于大盘股市值占非现金资产的比例不低于 80%；权证投资比例为基金资产净值的 0%-3%；债券及现金投资比例为基金资产的 5%-40%；资产支持证券比例为基金资产净值的 0%-20%。本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。整体业绩比较基准为：

沪深 300 指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》、《证券投资基金参与股指期货交易指引》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 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 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

## 2. 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

## 3. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定，对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入，由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴 20% 的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定，自 2005 年 6 月 13 日起，对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得，按照财税[2005]102 号文规定，扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时，减按 50% 计算应纳税所得额；

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

### 7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华宝兴业基金管理有限公司（“华宝兴业”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金代销机构
华宝信托有限责任公司（“华宝信托”）	基金管理人的股东
领先资产管理有限公司 (Lyxor Asset Management S.A.)	基金管理人的股东
法国兴业资产管理有限公司 (Société Générale Asset Management SA)	基金管理人的原股东
上海宝钢集团公司（“宝钢集团”）	基金管理人的最终控制方
华宝证券经纪有限责任公司（“华宝证券”）	受基金管理人的股东控制的公司

注：1. 根据本基金管理人 2010 年 12 月 17 日发布的公告，经中国证监会证监许可[2010]485 号文

核准，本基金管理人原股东法国兴业资产管理有限公司将其持有的本公司 49% 股权全部转让给领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)。此次变更后本基金管理人的股东及持股比例为：华宝信托有限责任公司 51%，领先资产管理有限公司(Lyxor Asset Management S.A.)49%。

2. 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金 2010 年度及 2009 年度均未通过关联方交易单元进行交易。

**7.4.8.2 关联方报酬**

**7.4.8.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	23,631,490.36	14,479,126.39
其中：支付销售机构的客户维护费	2,772,009.51	1,011,462.94

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

**7.4.8.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,938,581.76	2,413,187.73

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

#### 7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金 2010 年度及 2009 年度均未通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 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	上年度可比期间
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	639,193.22	-
期间申购/买入总份额	133,508.31	639,193.22
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	772,701.53	639,193.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.08%	0.06%

注：基金管理人华宝兴业在本年度申购本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理，适用费率为 1.35%。

##### 7.4.8.4.2 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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 7.4.8.5 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		上年度可比期间	
	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		2009 年 1 月 1 日至 2009 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	181,922,564.20	1,200,498.78	154,716,695.12	749,639.77

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。

##### 7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金 2010 年度及 2009 年度均不存在在承销期内直接购入关联方所承销证券的情况。

#### 7.4.9 期末（2010 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

7.4.9.1.1 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
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	网下认购新股尚未解禁	23.98	31.24	24,732	593,073.36	772,627.68	-

**7.4.9.2 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股票。

**7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购，因此在债券正回购交易中作为抵押的债券。

**7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购，因此在债券正回购交易中作为抵押的债券。

**§ 8 投资组合报告**

**8.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,403,133,753.86	84.91
	其中：股票	1,403,133,753.86	84.91
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	192,579,038.51	11.65
6	其他各项资产	56,807,568.12	3.44
7	合计	1,652,520,360.49	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	58,886,183.95	3.59
B	采掘业	32,052,955.50	1.96
C	制造业	861,714,826.41	52.57
C0	食品、饮料	121,485,323.99	7.41
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	39,761,322.32	2.43
C5	电子	219,888,217.99	13.42
C6	金属、非金属	160,321,725.82	9.78
C7	机械、设备、仪表	139,644,997.35	8.52
C8	医药、生物制品	180,613,238.94	11.02
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	41,661,073.92	2.54
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	239,930,347.31	14.64
H	批发和零售贸易	56,339,149.68	3.44
I	金融、保险业	43,530,907.68	2.66
J	房地产业	53,922,051.18	3.29
K	社会服务业	10,065,258.23	0.61
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	5,031,000.00	0.31
	合计	1,403,133,753.86	85.61

## 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	002230	科大讯飞	1,767,725	139,650,275.00	8.52
2	002436	兴森科技	1,793,548	120,365,006.28	7.34
3	600519	贵州茅台	409,882	75,385,497.44	4.60
4	000401	冀东水泥	2,459,273	58,112,620.99	3.55
5	601607	上海医药	2,637,297	57,598,566.48	3.51

6	000028	一致药业	1,683,834	55,566,522.00	3.39
7	000538	云南白药	834,918	50,429,047.20	3.08
8	600050	中国联通	8,700,000	46,545,000.00	2.84
9	601318	中国平安	775,123	43,530,907.68	2.66
10	002106	莱宝高科	558,285	36,986,381.25	2.26

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.fsfund.com](http://www.fsfund.com) 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	002230	科大讯飞	227,443,329.47	11.36
2	600050	中国联通	223,324,774.17	11.15
3	600519	贵州茅台	154,196,847.56	7.70
4	601318	中国平安	143,419,374.15	7.16
5	002436	兴森科技	130,733,543.57	6.53
6	000028	一致药业	105,532,177.21	5.27
7	601607	上海医药	102,841,183.36	5.13
8	000800	一汽轿车	92,594,062.75	4.62
9	600690	青岛海尔	86,543,426.51	4.32
10	601111	中国国航	85,112,996.05	4.25
11	002048	宁波华翔	81,230,103.37	4.06
12	000926	福星股份	79,575,781.11	3.97
13	600104	上海汽车	73,218,904.29	3.66
14	000423	东阿阿胶	72,448,385.55	3.62
15	601166	兴业银行	70,176,333.36	3.50
16	600048	保利地产	66,450,534.04	3.32
17	601628	中国人寿	66,262,814.17	3.31
18	002024	苏宁电器	64,766,279.08	3.23
19	002106	莱宝高科	64,631,512.23	3.23
20	600547	山东黄金	64,473,632.82	3.22
21	600694	大商股份	58,310,748.90	2.91
22	600352	浙江龙盛	57,397,408.40	2.87
23	000538	云南白药	55,276,128.71	2.76
24	600583	海油工程	55,035,718.17	2.75
25	600000	浦发银行	54,029,847.01	2.70

26	600088	中视传媒	53,596,636.68	2.68
27	000039	中集集团	49,596,634.91	2.48
28	600115	东方航空	49,173,724.97	2.46
29	002241	歌尔声学	48,484,307.49	2.42
30	601299	中国北车	48,482,710.06	2.42
31	000568	泸州老窖	47,870,613.68	2.39
32	000718	苏宁环球	46,856,908.06	2.34
33	600266	北京城建	46,072,072.55	2.30
34	000422	湖北宜化	45,178,308.09	2.26
35	600366	宁波韵升	44,649,956.56	2.23
36	000983	西山煤电	43,847,802.07	2.19
37	000807	云铝股份	43,312,389.69	2.16
38	002375	亚厦股份	42,945,830.19	2.14
39	000998	隆平高科	42,262,538.93	2.11
40	601888	中国国旅	41,438,358.19	2.07
41	000401	冀东水泥	41,353,219.30	2.06
42	600031	三一重工	40,918,822.15	2.04
43	600887	伊利股份	40,373,747.65	2.02
44	601369	陕鼓动力	40,087,448.07	2.00

注：买入金额不包括相关交易费用。

#### 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	600050	中国联通	172,705,833.25	8.62
2	601318	中国平安	140,199,883.76	7.00
3	601166	兴业银行	139,396,211.08	6.96
4	002230	科大讯飞	134,984,938.78	6.74
5	600690	青岛海尔	107,086,757.84	5.35
6	000800	一汽轿车	94,585,185.90	4.72
7	601111	中国国航	89,384,437.06	4.46
8	600104	上海汽车	89,038,066.25	4.45
9	600519	贵州茅台	83,110,002.92	4.15
10	600016	民生银行	77,764,032.63	3.88
11	601628	中国人寿	75,245,585.21	3.76
12	002024	苏宁电器	73,602,979.02	3.67
13	000926	福星股份	73,527,411.54	3.67
14	600694	大商股份	72,422,619.20	3.62
15	002048	宁波华翔	72,175,549.22	3.60
16	600547	山东黄金	71,348,711.84	3.56

17	000423	东阿阿胶	70,909,989.58	3.54
18	002001	新 和 成	68,263,463.05	3.41
19	600216	浙江医药	65,372,425.01	3.26
20	000028	一致药业	60,664,492.89	3.03
21	600000	浦发银行	58,809,623.82	2.94
22	600048	保利地产	58,409,939.31	2.92
23	600030	中信证券	58,391,958.26	2.92
24	600153	建发股份	57,993,517.39	2.90
25	000983	西山煤电	55,024,262.41	2.75
26	002436	兴森科技	54,862,412.58	2.74
27	600089	特变电工	54,295,915.54	2.71
28	600088	中视传媒	53,438,426.48	2.67
29	600660	福耀玻璃	52,389,392.36	2.62
30	601006	大秦铁路	51,435,257.01	2.57
31	600366	宁波韵升	50,488,611.54	2.52
32	000422	湖北宜化	50,336,356.10	2.51
33	600178	东安动力	49,759,184.83	2.48
34	002241	歌尔声学	49,721,545.02	2.48
35	002236	大华股份	49,442,091.14	2.47
36	600266	北京城建	48,962,251.09	2.44
37	000718	苏宁环球	48,867,250.52	2.44
38	600309	烟台万华	48,300,020.79	2.41
39	600739	辽宁成大	47,873,033.54	2.39
40	601299	中国北车	47,757,256.39	2.38
41	600887	伊利股份	47,624,369.71	2.38
42	600271	航天信息	46,609,365.82	2.33
43	600115	东方航空	44,748,268.33	2.23
44	601398	工商银行	44,659,384.79	2.23
45	000998	隆平高科	44,542,617.40	2.22
46	601607	上海医药	41,522,043.01	2.07

注：卖出金额不包括相关交易费用。

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	7,408,099,929.26
卖出股票的收入（成交）总额	7,709,750,034.41

注：买入股票成本、卖出股票收入均不包括相关交易费用。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

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**

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。

**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**

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，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚，无证券投资决策程序需特别说明。

**8.9.2** 本基金股票投资的主要对象是大盘股，基金管理人建立有基金股票备选库。本报告期内本基金的前十名股票投资没有超出基金合同规定的股票备选库。

**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	1,437,510.52
2	应收证券清算款	54,411,274.01
3	应收股利	-
4	应收利息	51,634.03
5	应收申购款	907,149.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	56,807,568.12

**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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金 份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
30,108	30,423.50	513,057,008.47	56.01%	402,933,778.38	43.99%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,038,939.93	0.1134%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年10月7日)基金份额总额	490,050,880.11
本报告期期初基金份额总额	1,036,865,347.27
本报告期基金总申购份额	825,040,602.14
减：本报告期基金总赎回份额	945,915,162.56
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	915,990,786.85

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金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

本报告期基金管理人与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、基金资产和基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本基金的投资策略在报告期内未发生变更。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金未变更负责审计的会计师事务所。基金管理人为本基金聘任的会计师事务所在本报告期的审计报酬为 70,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2008 年 10 月 7 日）起至本报告期末。

### 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

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

### 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			的比例			
招商证券	1	3,462,244,270.83	22.94%	2,813,103.60	22.34%	-
中金证券	2	1,807,621,528.81	11.98%	1,483,891.87	11.79%	-
中信金通	1	1,322,903,532.19	8.77%	1,124,460.19	8.93%	-
长江证券	1	1,302,860,843.69	8.63%	1,107,428.45	8.80%	-
申银万国	1	1,207,384,733.46	8.00%	1,026,269.38	8.15%	-
国泰君安	1	1,075,284,193.48	7.13%	913,989.17	7.26%	-
国信证券	1	1,058,538,190.66	7.02%	899,754.08	7.15%	-
齐鲁证券	1	1,042,589,812.68	6.91%	886,196.80	7.04%	-
光大证券	1	1,035,928,202.43	6.87%	841,697.95	6.69%	-
兴业证券	1	1,007,345,793.37	6.68%	856,238.97	6.80%	-
海通证券	1	403,410,988.94	2.67%	327,775.40	2.60%	-
中信建投	1	273,790,327.66	1.81%	232,721.54	1.85%	-
广发证券	1	89,548,217.89	0.59%	76,113.01	0.60%	-
合计	14	15,089,450,636.09	100.00%	12,589,640.41	100.00%	-

注：1、基金管理人选择交易单元的标准和程序如下：

(1) 选择标准：财力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 5 亿元人民币；财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，最近两年未因重大违规行为受到中国证监会和中国人民银行处罚；内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；具备基金运作所需要的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需 要，并能为本基金提供全面的信息服 务；研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告；适当的地域分散化。

(2) 选择程序：(a) 服务评价；(b) 拟定备选交易单元；(c) 签约。

2、本基金本报告期新增齐鲁证券、广发证券和国信证券席位。

### 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	债券交易		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
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金证券	1,010,072.00	100.00%	-	-	-	-
中信金通	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
合计	1,010,072.00	100.00%	-	-	-	-

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

华宝兴业基金管理有限公司

二〇一一年三月二十六日