

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金
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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	华宝兴业中证 100 指数	
基金主代码	240014	
交易代码	240014 (前端)	240015 (后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 9 月 29 日	
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1, 148, 350, 202. 98 份	
基金合同存续期	不定期	

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，实现对中证 100 指数的有效跟踪，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用完全复制法进行指数化投资，按照成份股在中证 100 指数中的基准权重构建指数化投资组合。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，基金管理人会对投资组合进行适当调整，以便实现对跟踪误差的有效控制。
业绩比较基准	中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。
风险收益特征	本基金具有较高风险、较高预期收益的特征。

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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华	尹东
	联系电话	021-38505888	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-700-5588、021-38924558	010—67595096

传真	021-38505777	010-66275853
----	--------------	--------------

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	本基金年报置备地点包括基金管理人办公场所和基金托管人办公场所。

§ 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 9 月 29 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日	2008 年
本期已实现收益	-74,720,450.42	16,827,711.51	-
本期利润	-192,613,455.48	73,813,730.38	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1718	0.0558	-
本期基金份额净值增长率	-19.00%	4.86%	-
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	-0.1506	0.0153	-
期末基金资产净值	975,429,140.11	1,075,972,855.98	-
期末基金份额净值	0.8494	1.0486	-

注：1、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。

2、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、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、本基金生效于 2009 年 9 月 29 日，故 2008 年度无相关数据。

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

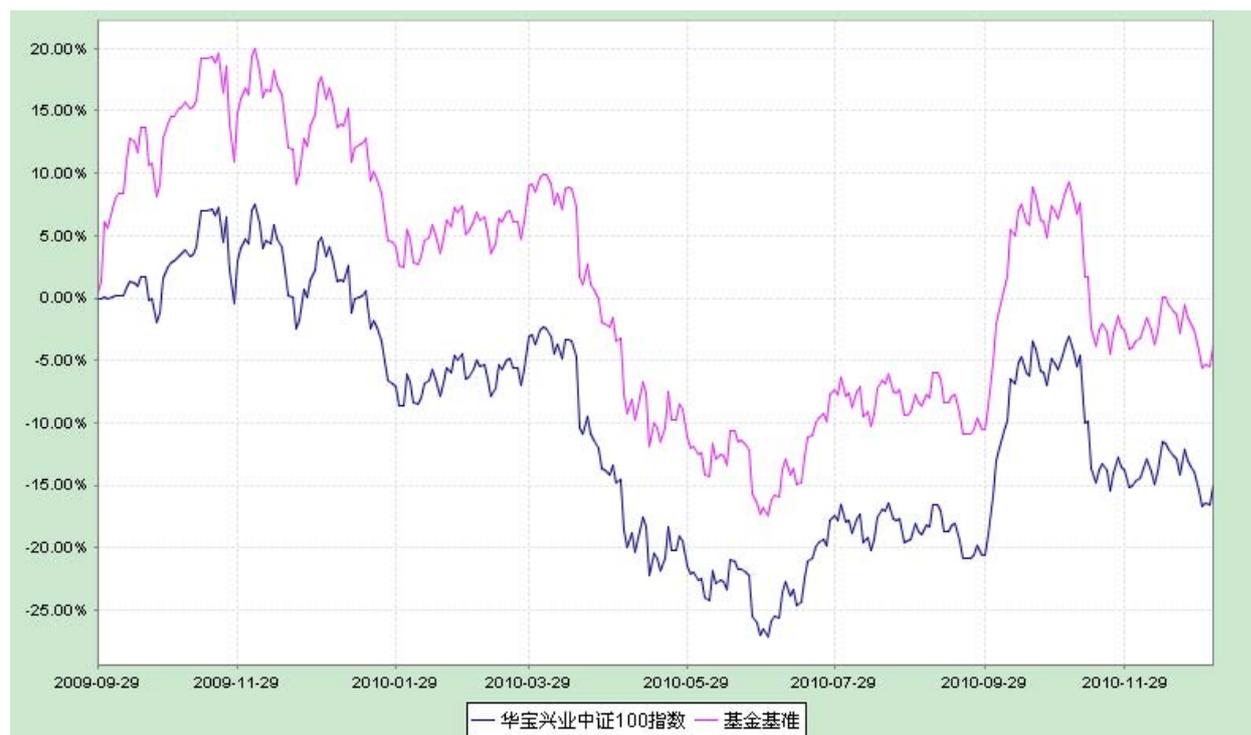
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.80%	1.70%	5.26%	1.69%	-0.46%	0.01%
过去六个月	14.85%	1.49%	15.02%	1.46%	-0.17%	0.03%
过去一年	-19.00%	1.53%	-18.26%	1.50%	-0.74%	0.03%
自基金成立起至今	-15.06%	1.50%	-3.83%	1.53%	-11.23%	-0.03%

注：1、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）。

2、本基金业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

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

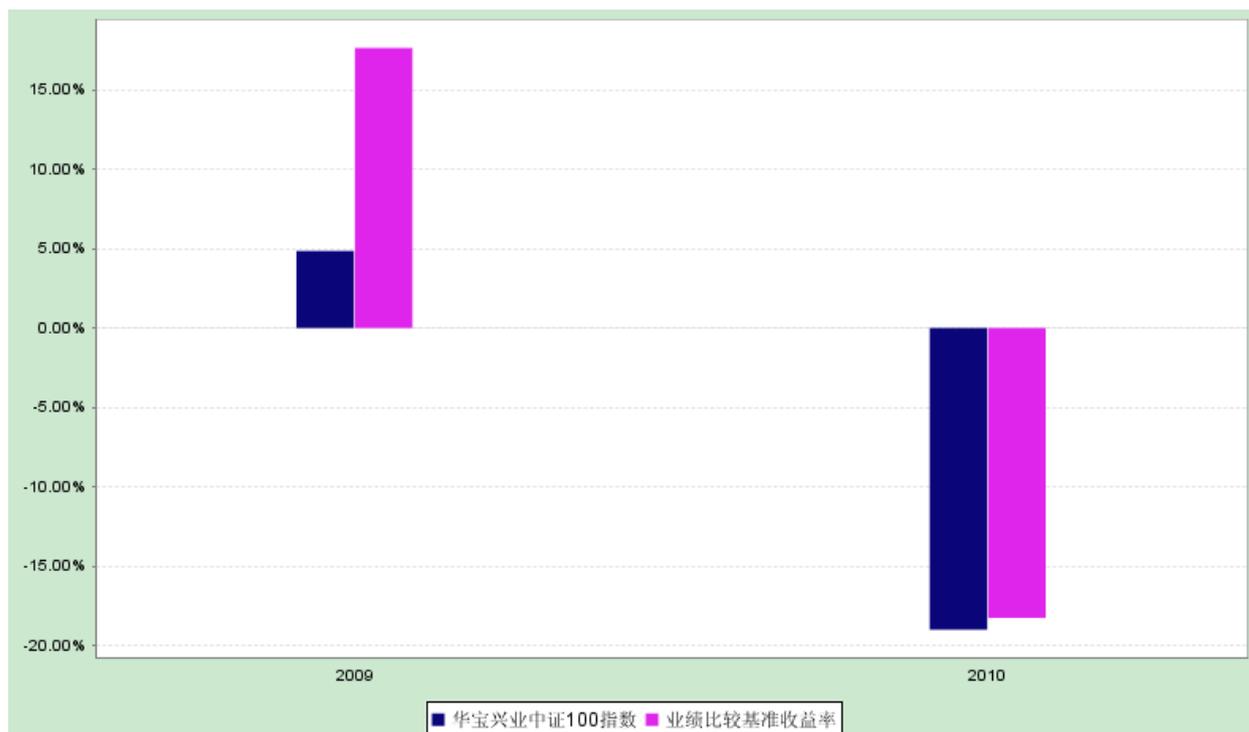
华宝兴业中证 100 指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2009 年 9 月 29 日至 2010 年 12 月 31 日）



注：基金依法应自成立日期起 6 个月内达到基金合同约定的资产组合，截至 2009 年 11 月 6 日，本基金已完成建仓且达到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

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金
 基金净值增长率与业绩比较基准历史收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于 2009 年 9 月 29 日，截至本报告期末，本基金未进行过利润分配。

§ 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 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		
徐林明	本基金基金经理、华宝兴业上证 180 价值 ETF 基金经理、华宝兴业上证 180 价值 ETF 联接基金经理、量化投资部总经理	2009-09-29	-	8 年	复旦大学经济学硕士，FRM，曾在兴业证券、凯龙财经（上海）有限公司、中原证券从事金融工程研究工作。2005 年 8 月加入华宝兴业基金管理有限公司，曾任金融工程部数量分析师、金融工程部副总经理。2009 年 9 月起任华宝兴业中证 100 指数型证券投资基金基金经理，2010 年 2 月起任量化投资部总经理，2010 年 4 月兼任华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理。
余海燕	本基金基金经理	2010-12-10	-	4 年	硕士。曾在汇丰银行从事信用分析工作。2006 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司先后任分析师，华宝兴业宝康债券投资基金基金经理助理，华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金、华宝兴业上证 180 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金经理助理，2010 年 12 月至今任华宝兴业中证 100 指数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、《华宝兴业中证 100 指数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、债市的系统性风险和申购赎回引起的基金资产规模变化，中证 100 证券投资基金在短期内出现过持有的现金与到期日在一年之内的政府债券市值占基金资产净值比低于 5%和持有股票市值占基金净值大于 95%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

纵观 2010 年，A 股几经波折。年初国内存款准备金率上调、大量发行央票回收流动性等紧缩性货币政策，导致市场对经济硬着陆的担忧；二季度欧洲债务危机、地方融资平台的全面清理以及房地产调控措施的密集出台，使得股指从 4 月中旬开始了一轮暴跌，跌势一直持续至二季度末，使得 A 股上证综指整个上半年重挫 26.82%，以最差的走势称熊全球；三季度，在宏观调控力度放缓预期和流动性放松的正面影响下，A 股市场迎来了反弹；四季度初美国量化宽松货币政策的出台，流动性充裕，全球大宗资源品价格高涨。国内通胀水平超预期，央行也相继出台超预期的紧缩货币政策，三次提高存款准备金率、两度加息。2010 年年末资金面趋紧，回购利率大幅飚升。总之，2010 年国内外经济形势风云变幻，让 A 股经历了大幅震荡，上证综指全年累计下跌 14.31%，深成指全年累计下跌 9.06%。虽然大盘蓝筹股指数在 2010 年乏善可陈，但在经济转型的大背景下，消费、新兴产业受到政策的全力扶持而表现突出，电子元器件、医药、机械、有色、农林牧渔等行业全年涨幅超过 20%；而受房地产调控、淘汰落后产能对传统行业全面打压的影响，钢铁、房地产、金融、化工等传统行业表现落后，全

年跌幅超过 20%；以中证 100 指数为代表的大盘股指数全年下跌 19.28%，而以中小板指数为代表的小盘股指数则上涨 21.26%。结构分化、风格分化无疑是 2010 年 A 股市场最生动的写照。

本报告期本基金为正常运作期，在操作中，我们严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.8494 元，本报告期份额净值增长率为-19.00%，同期业绩比较基准增长率为-18.26%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为 0.036%，年化跟踪误差为 1.099%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，经济增长、经济转型、通货膨胀是政策决策关注的主要方面，发展是主旋律，加快转变经济发展方式是主线，通货膨胀是影响货币政策的重要因素。短期来看，通货膨胀是投资者需要关注的方面，以及对于调控政策的预期；同时还需关注银行信贷投放的节奏以及信贷政策松紧的变化，这将影响市场的流动性和走势。

在 2011 年扩大内需、推进城镇化、区域经济均衡发展、加快发展新兴产业、放开受限制的传统行业将是市场投资布局的重要方向。行业分化、局部行情演绎仍将是未来行情的主旋律。2011 年是十二五规划的第一年，新一轮周期启动方面仍然存在不确定性，但我们看好未来 A 股市场影响因素的边际性改善，及引发的反弹行情，低估值、高弹性且机构配置较少的周期股、价值股的估值修复概率大。上市公司 2010 年年报正在陆续披露中，从目前的信息判断，大盘蓝筹股的业绩超预期和中小盘概念股的业绩低预期的概率比较高，这正带来大盘蓝筹股的重估机会。

从投资风格来看，目前正在进行的风格纠偏仍将持续，风格纠偏的本质是价值回归。大盘蓝筹股被过度压低的估值水平具有一定的估值提升要求，而被高估的小盘股有风险释放要求，估值纠偏有利于后期投资机会的均衡化，2011 年再现 2010 年那样小盘股一统天下的概率较小。总体而言我们认为以金融、资源为代表的大盘蓝筹股表现会相对强势，在 2011 年获得超额收益的概率较大，这种趋势在 2011 年年初表现得尤为突出，我们对中证 100 指数在 2011 年的表现保持一个相对乐观的态度。

作为指数基金的管理人，我们将继续严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，积极应对成分股调整和基金申购赎回，严格控制基金相对目标指数的跟踪误差，实现对中证 100 指数的有效跟踪。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人，基金管理人在合理期限内进行了调整，对基金份额持有人利益未造成损害。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

普华永道中天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：华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

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
资 产：			
银行存款		51,924,735.99	37,749,241.60
结算备付金		85,109.25	1,073,527.69
存出保证金		44,966.00	-
交易性金融资产		924,399,000.51	1,046,128,946.63
其中：股票投资		924,399,000.51	1,020,890,642.63
基金投资		-	-
债券投资		-	25,238,304.00
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		1,364,138.69	7,660,423.37
应收利息		12,268.82	447,110.42
应收股利		-	-
应收申购款		190,721.37	488,701.96
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		978,020,940.63	1,093,547,951.67

负债和所有者权益		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009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		-	-
应付赎回款		512,013.67	15,471,723.50
应付管理人报酬		385,879.69	447,341.65
应付托管费		115,763.91	134,202.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,180,445.20	1,324,807.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		397,698.05	197,020.23
负债合计		2,591,800.52	17,575,095.69
所有者权益:			
实收基金		1,148,350,202.98	1,026,102,862.55
未分配利润		-172,921,062.87	49,869,993.43
所有者权益合计		975,429,140.11	1,075,972,855.98
负债和所有者权益总计		978,020,940.63	1,093,547,951.67

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8494 元，基金份额总额 1,148,350,202.98 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

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	上年度可比期间 2009年9月29日（基金合同 生效日）至2009年12月31日
一、收入		-181,722,098.24	78,334,925.69
1. 利息收入		675,056.56	1,500,048.12
其中：存款利息收入		392,624.02	1,405,230.68
债券利息收入		282,432.54	63,398.82
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	31,418.62
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”填列）		-66,320,995.13	18,387,323.69
其中：股票投资收益		-76,881,524.05	18,387,323.69
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,786.34	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		10,557,742.58	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-117,893,005.06	56,986,018.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		1,816,845.39	1,461,535.01
减：二、费用		10,891,357.24	4,521,195.31
1. 管理人报酬		4,869,785.04	1,776,417.09
2. 托管费		1,460,935.53	532,925.13
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		3,992,534.20	1,935,446.73
5. 利息支出		737.77	635.42
其中：卖出回购金融资产支出		737.77	635.42
6. 其他费用		567,364.70	275,770.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-192,613,455.48	73,813,730.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-192,613,455.48	73,813,730.38

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业中证 100 指数证券投资基金

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）	1,026,102,862.55	49,869,993.43	1,075,972,855.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-192,613,455.48	-192,613,455.48
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）	122,247,340.43	-30,177,600.82	92,069,739.61
其中：1. 基金申购款	1,738,925,314.81	-191,536,106.46	1,547,389,208.35

2. 基金赎回款	-1,616,677,974.38	161,358,505.64	-1,455,319,468.74
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)	1,148,350,202.98	-172,921,062.87	975,429,140.11
项目	上年度可比期间		
	2009年9月29日(基金合同生效日)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)	2,008,751,627.96	-	2,008,751,627.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	73,813,730.38	73,813,730.38
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)	-982,648,765.41	-23,943,736.95	-1,006,592,502.36
其中: 1. 基金申购款	158,036,612.24	4,763,249.20	162,799,861.44
2. 基金赎回款	-1,140,685,377.65	-28,706,986.15	-1,169,392,363.80
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)	1,026,102,862.55	49,869,993.43	1,075,972,855.98

报表附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从 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

华宝兴业中证 100 指数证券投资基金(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[2009]第 754 号《关于核准华宝兴业中证 100 指数证券投资基金募集的批复》核准, 由华宝兴业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《华宝兴业中证 100 指数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 2,008,465,719.05 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(2009)第 184 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 《华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同》于 2009 年 9 月 29 日正式生效, 基金合同生效日的基金份额总额为 2,008,751,627.96 份基金份额, 其中认购资金利息折合 285,908.91 份基金份额。本基金的基金管理人为华宝兴业基金管理有限公司, 基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业中证 100 指数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,包括中证 100 指数的成份股及其备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券，以及经中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具。本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证 100 指数，投资于股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%-10%(其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值 5%)。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%、年跟踪误差不超过 4%，本基金的业绩比较基准为：中证 100 指数收益率×95%+银行同业存款收益率×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人华宝兴业基金管理有限公司于 2011 年 3 月 18 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》、《华宝兴业中证 100 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 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 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

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。

7.4.7 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月29日（基金合同生效日）至2009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
华宝证券	261,863,004.73	9.99%	205,029,448.47	13.03%

7.4.8.1.2 权证交易

本基金本期及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010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
华宝证券	222,585.19	10.08%	78,729.20	6.67%
关联方名称	上年度可比期间 2009年9月29日（基金合同生效日）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
华宝证券	174,273.48	13.15%	174,273.48	13.15%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费后的净额列示。

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。

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9月29日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,869,785.04	1,776,417.09
其中：支付给销售机构的客户维护费	993,679.53	279,533.31

注：支付基金管理人华宝兴业的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.5% / 当年天数。

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9月29日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,460,935.53	532,925.13

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.15% / 当年天数。

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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年9月29日（基金合同生效日）至2009年12月31日
基金合同生效日（2009年9月29日）持有的基金份额	-	160,089.60
期初持有的基金份额	160,089.60	-
期间申购/买入总份额	266,883.26	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	426,972.86	160,089.60
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.04%	0.02%

注：基金管理人华宝兴业在本年度以后端收费方式申购本基金的交易委托国泰君安证券股份有限公司办理，适用费率将按持有期递减。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009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
宝钢集团	114,850,120.59	10.00%	-	-
华宝信托	-	-	30,007,400.00	2.92%

注：除基金管理人之外的其它关联方投资本基金采用市场公开的费率。

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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 9 月 29 日（基金合同生效日） 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
中国建设银行	51,924,735.99	376,216.09	37,749,241.60	756,005.54

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

本基金本期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报

价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 924,399,000.51 元，无属于第二层级和第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 1,036,817,649.63 元，第二层级 9,311,297.00 元，无第三层级)。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级(2009 年会计期间：同)。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	924,399,000.51	94.52
	其中：股票	924,399,000.51	94.52
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	52,009,845.24	5.32
6	其他各项资产	1,612,094.88	0.16
7	合计	978,020,940.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资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	139,887,082.69	14.34
C	制造业	219,189,681.37	22.47
C0	食品、饮料	46,346,657.43	4.75
C1	纺织、服装、皮毛	3,224,403.00	0.33
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,535,684.08	1.29
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	55,298,930.59	5.67
C7	机械、设备、仪表	101,784,006.27	10.43
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,264,135.74	1.67
E	建筑业	28,324,009.01	2.90
F	交通运输、仓储业	38,996,398.69	4.00
G	信息技术业	22,321,470.00	2.29
H	批发和零售贸易	15,030,481.50	1.54
I	金融、保险业	381,457,011.39	39.11
J	房地产业	37,203,853.12	3.81
K	社会服务业	4,998,692.25	0.51
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,931,322.15	0.40
	合计	907,604,137.91	93.05

8.2.2 积极投资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	8,800,299.60	0.90
C0	食品、饮料	-	-
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	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	7,698,390.00	0.79
C8	医药、生物制品	1,101,909.60	0.11

C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,073,289.00	0.21
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	3,526,222.00	0.36
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	2,395,052.00	0.25
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	16,794,862.60	1.72

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	601318	中国平安	903,756	50,754,936.96	5.20
2	600036	招商银行	3,805,622	48,750,017.82	5.00
3	600016	民生银行	7,220,296	36,245,885.92	3.72
4	601328	交通银行	5,657,670	31,004,031.60	3.18
5	601166	兴业银行	1,141,004	27,441,146.20	2.81
6	600000	浦发银行	2,211,939	27,405,924.21	2.81
7	600030	中信证券	1,908,158	24,023,709.22	2.46
8	601088	中国神华	890,927	22,014,806.17	2.26
9	000002	万科 A	2,662,636	21,886,867.92	2.24
10	601601	中国太保	865,259	19,814,431.10	2.03

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	000338	潍柴动力	147,000	7,698,390.00	0.79
2	600115	东方航空	535,900	3,526,222.00	0.36
3	601158	重庆水务	250,700	2,073,289.00	0.21
4	601818	光大银行	457,200	1,810,512.00	0.19
5	002399	海普瑞	7,920	1,101,909.60	0.11

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 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	600036	招商银行	76,825,169.78	7.14
2	601318	中国平安	67,262,978.55	6.25
3	600016	民生银行	52,914,519.39	4.92
4	601328	交通银行	49,693,802.37	4.62
5	601601	中国太保	44,652,936.24	4.15
6	601166	兴业银行	41,575,273.96	3.86
7	600000	浦发银行	40,814,116.08	3.79
8	600030	中信证券	34,685,750.99	3.22
9	601088	中国神华	30,488,667.96	2.83
10	000002	万科 A	29,699,196.91	2.76
11	601398	工商银行	25,720,332.73	2.39
12	601988	中国银行	24,088,991.73	2.24
13	600837	海通证券	21,927,902.06	2.04
14	601169	北京银行	20,772,708.33	1.93
15	600519	贵州茅台	20,695,089.47	1.92
16	000858	五粮液	20,518,492.56	1.91
17	002024	苏宁电器	20,144,202.75	1.87
18	000898	鞍钢股份	19,337,781.69	1.80
19	000825	太钢不锈	18,586,295.37	1.73
20	600900	长江电力	18,356,396.36	1.71

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	601318	中国平安	69,976,614.15	6.50
2	600036	招商银行	64,690,762.56	6.01
3	600016	民生银行	51,150,386.66	4.75
4	601328	交通银行	44,225,981.71	4.11
5	600000	浦发银行	41,310,220.58	3.84

6	601166	兴业银行	36,657,797.69	3.41
7	600030	中信证券	33,190,420.60	3.08
8	601088	中国神华	29,901,650.47	2.78
9	000002	万科 A	28,069,671.07	2.61
10	601628	中国人寿	26,340,752.50	2.45
11	601398	工商银行	24,952,467.24	2.32
12	601988	中国银行	22,482,305.07	2.09
13	600900	长江电力	21,441,413.65	1.99
14	000858	五粮液	21,131,023.77	1.96
15	601601	中国太保	20,787,293.23	1.93
16	600519	贵州茅台	20,727,043.42	1.93
17	600837	海通证券	20,406,443.66	1.90
18	601169	北京银行	20,147,491.24	1.87
19	002024	苏宁电器	18,958,731.62	1.76
20	000001	深发展 A	18,410,028.61	1.71

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	1,369,721,490.36
卖出股票的收入（成交）总额	1,271,404,534.97

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 基金管理人没有发现本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内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 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	44,966.00
2	应收证券清算款	1,364,138.69
3	应收股利	-
4	应收利息	12,268.82
5	应收申购款	190,721.37
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,612,094.88

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。

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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
21,706	52,904.74	461,991,241.48	40.23%	686,358,961.50	59.77%

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	1,108,617.20	0.0965%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年9月29日)基金份额总额	2,008,751,627.96
本报告期期初基金份额总额	1,026,102,862.55
本报告期基金总申购份额	1,738,925,314.81
减：本报告期基金总赎回份额	1,616,677,974.38
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,148,350,202.98

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

1、本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可〔2011〕115 号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

2、本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

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

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 80,000 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（2009 年 9 月 29 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的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	1	594,741,387.71	22.69%	505,530.21	22.89%	-
兴业证券	1	444,196,884.71	16.95%	377,566.75	17.10%	-
齐鲁证券	1	280,850,681.78	10.71%	238,722.76	10.81%	-
华宝证券	1	261,863,004.73	9.99%	222,585.19	10.08%	-
中信证券	1	261,835,120.07	9.99%	212,742.96	9.63%	-
中银国际	1	139,919,266.87	5.34%	113,685.32	5.15%	-
国泰君安	1	124,994,908.80	4.77%	106,245.59	4.81%	-
光大证券	1	94,801,901.79	3.62%	80,581.48	3.65%	-
江海证券	1	91,908,728.51	3.51%	74,676.62	3.38%	-
中金公司	1	91,191,642.57	3.48%	77,512.79	3.51%	-
瑞银证券	1	85,828,318.45	3.27%	72,953.43	3.30%	-
高华证券	1	66,734,723.99	2.55%	56,724.43	2.57%	-
安信证券	1	32,949,954.26	1.26%	28,007.52	1.27%	-
长城证券	1	28,318,106.21	1.08%	23,008.45	1.04%	-
华泰联合	1	10,615,289.43	0.40%	8,624.94	0.39%	-
华安证券	1	6,105,743.54	0.23%	5,189.84	0.24%	-

中投证券	1	3,191,200.00	0.12%	2,712.47	0.12%	-
西南证券	1	1,254,880.00	0.05%	1,066.68	0.05%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

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、本期新增交易单元为：中投证券、江海证券、华泰联合、华安证券、招商证券。本期撤销的交易单元为：西南证券。

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
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	2,369,763.00	16.19%	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	20,000,000.00	100.00%	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	10,001,000.00	68.31%	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
华泰联合	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	2,269,267.00	15.50%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

1、2010 年 1 月 29 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2、2010 年 5 月 13 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

3、2010 年 6 月 21 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

4、2010 年 7 月 1 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2009 年度 A 股分红派息实施公告，每 10 股派发现金股息人民币 2.02 元(含税)。

5、2010 年 9 月 15 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

6、2010 年 11 月 2 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布 2010 年度 A 股配股发行公告。

华宝兴业基金管理有限公司

二〇一一年三月二十六日