

# 华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2011 年 3 月 30 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 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

经中国证监会批准，自 2010 年 4 月 30 日起，基金管理人中文名称由“友邦华泰基金管理有限公司”变更为“华泰柏瑞基金管理有限公司”。经基金托管人同意，并报请中国证监会批准，本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起，由“友邦华泰积极成长混合型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金”，基金简称为“华泰柏瑞积极成长混合”，基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
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.....	16
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	21
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	43
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	50
8.7 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.....	50

8.8 投资组合报告附注.....	50
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
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.....	51
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>51</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	51
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.....	51
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
11.4 基金投资策略的改变.....	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
11.8 其他重大事件.....	54
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>59</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>60</b>
13.1 备查文件目录.....	60
13.2 存放地点.....	60
13.3 查阅方式.....	60

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞积极成长混合
基金主代码	460002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 5 月 29 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
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	3,504,325,551.30 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过严格的投资纪律约束和风险管理手段，投资于具备持续突出增长能力的优秀企业，辅以特定市场状况下的大类资产配置调整，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金以股票类资产为主要投资工具，通过精选个股获取资产的长期增值；通过适度的大类资产配置来降低组合的系统性风险。本基金将“自上而下”的趋势投资和“自下而上”的个股选择相结合。投资决策的重点在于寻找具有巨大发展潜力的趋势，发现并投资于有能力把握趋势并在竞争中处于优势的公司。
业绩比较基准	沪深 300 指数×60%+中信标普国债指数×40%
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		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈晖	唐州徽
	联系电话	021-38601777	010-66594855
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	tgxxpl@bank-of-china.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	北京市复兴门内大街 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	北京市复兴门内大街 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.huatai-pb.com">http://www.huatai-pb.com</a>
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
注册登记机构	华泰柏瑞基金管理有限公司	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大 五道口广场 1 号楼 17 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010 年	2009 年	2008 年
本期已实现收益	161,565,109.65	622,503,487.77	-1,424,535,898.61
本期利润	258,897,539.01	1,721,767,238.10	-3,275,993,711.26
加权平均基金份额本期利润	0.0647	0.3482	-0.5679
本期加权平均净值利润率	6.67%	35.61%	-58.43%
本期基金份额净值增长率	7.03%	43.16%	-43.14%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	160,568,098.05	127,385,184.91	-1,413,928,517.76
期末可供分配基金份额利润	0.0458	0.0301	-0.2639
期末基金资产净值	3,838,279,861.16	4,456,666,313.44	3,944,670,299.81
期末基金份额净值	1.0953	1.0538	0.7361
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	12.79%	5.38%	-26.39%

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

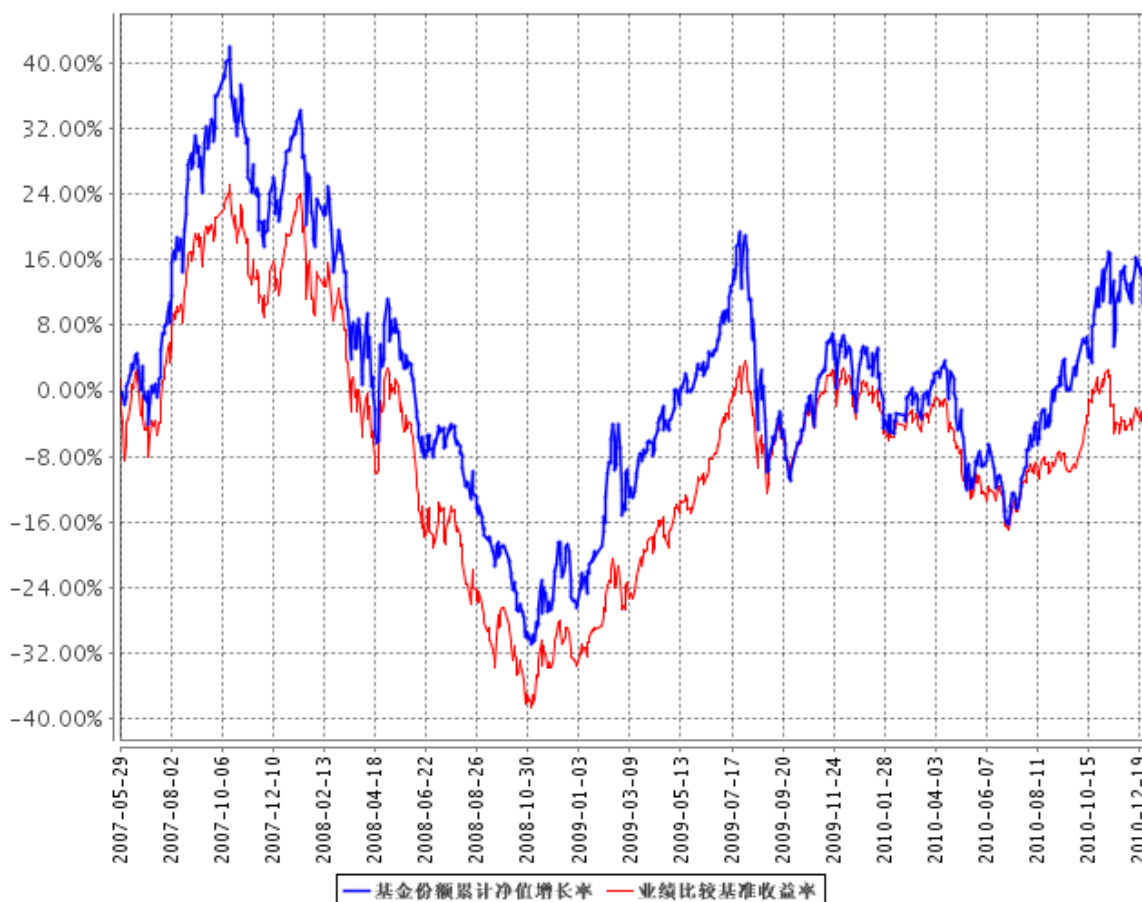
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	8.71%	1.78%	3.79%	1.06%	4.92%	0.72%
过去六个月	31.88%	1.50%	13.12%	0.93%	18.76%	0.57%
过去一年	7.03%	1.40%	-5.99%	0.95%	13.02%	0.45%
过去三年	-12.88%	1.66%	-19.90%	1.39%	7.02%	0.27%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效日起至 今	12.79%	1.63%	-4.80%	1.39%	17.59%	0.24%

注：本基金的业绩基准由沪深 300 指数和中信标普国债指数按照 60%与 40%之比构建，并每日进行再平衡。

#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



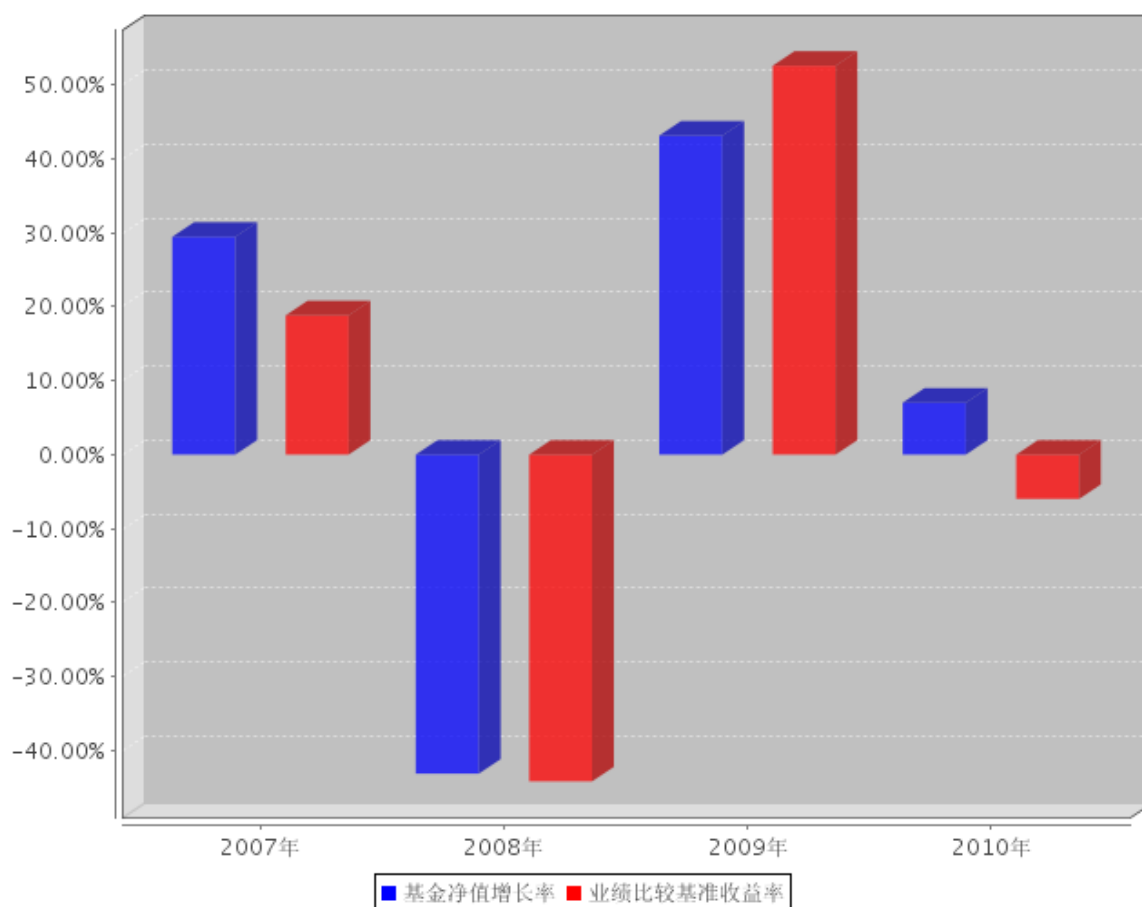
注：图示日期为 2007 年 5 月 29 日至 2010 年 12 月 31 日。

按基金合同规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，截至报告日本基金的各项投资比例已达到基金合同第十四条（二）投资范围、（十）之 2、基金投资组合比例限制中规定的各项比例，投资于股票的比例为基金资产的 30%-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%-70%。

### 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



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对比图



注：基金合同生效日为 2007 年 5 月 29 日，2007 年度的相关数据根据当年的实际存续期计算

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发放 总额	年度利润分配合 计	备注
2010	0.3000	58,127,755.40	67,229,336.44	125,357,091.84	
2009	-	-	-	-	
2008	-	-	-	-	
合计	0.3000	58,127,755.40	67,229,336.44	125,357,091.84	

注：本基金报告期末可供分配利润为 160,568,098.05 元。根据基金合同约定，本基金已于 2011 年 1 月对 2010 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.2 元。

## § 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞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

为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）、和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞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、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金和华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金。截至 2010 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 195.31 亿元。

注：公司外方股东 AIG Global Investment Corp.（“美国国际集团投资有限公司”）已更名为“PineBridge Investments LLC”（“柏瑞投资有限责任公司”），详细内容见我公司 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

#### 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		
秦岭松	本基金的基金经理	2007 年 5 月 29 日	-	8 年	秦岭松先生，注册金融分析师（CFA），美国南加州大学会计学硕士、霍夫斯塔大学 MBA（金融投资专业）。2002 年 9 月至 2005 年 10 月在海通证券公司担任交易员及产品开发工作。2005 年 11 月加入本公司，历任研究部高级研究员、华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金基金经理助理，2007 年 5 月起任华泰柏

					瑞积极成长混合型基金基金经理。
卞亚军	本基金的基金经理助理	2009 年 11 月 2 日	2010 年 5 月 31 日	6 年	卞亚军，金融学硕士，毕业于中国社会科学院研究生院。2004 年 7 月-2006 年 7 月就职于红塔证券资产管理部，任行业研究员、投资经理助理。2006 年 7 月加入本公司，历任宏观及债券研究员、行业研究员、高级研究员，2009 年 11 月起兼任华泰柏瑞积极成长基金的基金经理助理。2010 年 6 月起担任华泰柏瑞量化先行股票基金的基金经理助理，2010 年 10 月起担任华泰柏瑞量化先行股票基金基金经理。
方纬	本基金的基金经理助理	2010 年 5 月 1 日	-	5 年	方纬，英国伦敦政治经济学院经济学硕士，2004 年 4 月至-2005 年 1 月任上海金信研究所研究员，2005 年 1 月至 2007 年 1 月任万家基金管理有限公司高级研究员，2007 年 2 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司

					司，历任研究员、高级研究员，2010 年 5 月起兼任华泰柏瑞积极成长基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

#### 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《友邦华泰积极成长混合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

注：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

10 年上半年，面对快速上涨的房价，政府出台了一系列的地产调控政策，由此也引发了市场对房地产链条收缩和整体经济二次探底的忧虑，加上自一季度开始的流动性开始收紧和股票供应

的持续增加，A 股市场在二季度快速下滑，上证指数跌幅达到 23%。同时，中小市值股票继续超越大市值板块，个股表现分化加剧。进入三季度后，持续的地产调控和对企业盈利见顶的担忧导致市场在 7 月快速探底，但银行、地产、煤炭等周期性股票的低估值也制约了市场下跌的空间。随着美联储继续购买长期国债以释放流动性支持经济复苏的信号出现，美元兑主要货币在 3 季度持续贬值，流动性重新回到大宗商品和新兴市场，A 股市场也相应快速反弹。此后由于对主要周期性行业（银行、地产、煤炭、有色等）业绩的顾虑尚存，投资人在短期更多地将注意力集中在业绩增长明确的中小市值股票上，导致大小盘风格差距进一步拉大。

四季度央行货币政策正式从适度宽松转为稳健。11-12 月，央行三次上调存款准备金，二次上调存贷款利率，货币收缩的速度明显加快，投资者预期在未来的 1-2 个季度市场流动性可能整体都会呈现偏紧的状态，对 A 股的影响可能偏负面，市场因此也做出了快速的反应。从风格看，前期表现较好的中小市值股票在 12 月调整幅度较多，而估值已处于历史底部区域的周期性行业（银行、地产）的卖出动力明显不足，板块估值的结构性差异也制约了市场下跌的空间。基金管理人在四季度将股票投资比例保持在 80-90%的比例，在配置上更多地倾向于业绩增长快速、明确的消费型行业（医药、食品饮料、零售、信息服务等）。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年，基金单位份额净值增长率为 7.03%，同期业绩比较基准的收益率为 -5.99%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011 年，股市的流动性环境受到多个方面因素的相互影响，总体判断可能呈现中性的局面，投资者在现阶段不宜过于悲观。一方面，货币政策紧缩导致流动性减少，对股市产生负面影响，但另一方面，其他投资渠道对资金的吸引力仍在不断下降：房地产市场持续调控，债券市场因为通胀仍处于熊市，储蓄和货币市场的收益率赶不上 CPI，只有股市没有政策压力且回报仍具吸引力，其他资产类别中的资金选择逐步流向股市的可能性较大。在这样一正一负因素的作用下，整体的流动性环境不会像有些市场人士预计的那么紧张。

2010 年中报数据显示，全部 A 股实现净利润 7814 亿（其中 09 年 7 月前上市的公司实现 6959 亿，09 年 7 月后新上市的公司实现 855 亿）。其中金融行业盈利 3320 亿，占 A 股净利润的 47%。考虑到下半年业绩增速放缓的趋势，大致估计 10 年 A 股净利润可以达到 1.35-1.45 万亿（含新上市公司），A 股的净利润总和已经远远超过 07 年 9500 亿的水平。而 2011 年作为十二五计划的开局之年，在保障房建设、区域经济发展和产业结构调整等驱动因素作用下，又可能启动新一轮增长周期，企业业绩有望保持 15-20%的增速，对当前估值有较强的支撑。从市场结构看，银行、地

产、煤炭等强周期性行业由于悲观预期作用的时间较长，已无较大的下跌空间。

展望 2011 年 1 季度，由于短期市场的流动性可能仍然呈现中性偏紧的局面，一些业绩增长较快的中小市值个股获得相对收益的可能性较大。因此基金的配置更多地向符合国家产业政策调整方向（新能源、新材料、生物技术等产业）的领域倾斜。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2010 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司投资研究业务、异常交易和公平交易管理、市场宣传、客户服务、信息技术安全、人员管理、基金核算与注册登记等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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 25%；基金收益分配后每份基金份额的净值不能低于面值。本基金已于 2010 年 1 月对 2009 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.3 元。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

## § 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

报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金

份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2011)第 20387 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 (原名为友邦华泰积极成长混合型证券投资基金)全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金(原名为友邦华泰积极成长混合型证券投资基金,以下简称“华泰柏瑞积极成长基金”)的财务报表,包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是华泰柏瑞积极成长基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(2010 年 4 月 30 日前原名为友邦华泰基金管理有限公司)管理层的责任。这种责任包括:  (1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报; (2) 选择和运用恰当的会计政策; (3) 作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范,计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。  审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括



	<p>对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了华泰柏瑞积极成长基金 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。
注册会计师的姓名	单峰 陈清
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所有限公司
会计师事务所的地址	上海湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2011 年 3 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

报告截止日：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	404,675,193.18	233,267,203.33
结算备付金		9,750,600.56	4,328,431.92
存出保证金		4,396,554.31	4,654,930.07
交易性金融资产	7.4.7.2	3,436,102,209.81	4,216,486,913.66
其中：股票投资		3,436,102,209.81	4,017,146,913.66
基金投资		-	-
债券投资		-	199,340,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	22,411,526.72
应收利息	7.4.7.5	94,051.47	469,743.64
应收股利		-	-

应收申购款		97,318.24	317,010.84
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,855,115,927.57	4,481,935,760.18
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期期末 2010年12月31日</b>	<b>上年度末 2009年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,475,298.10	12,349,506.51
应付管理人报酬		4,943,918.92	5,630,330.45
应付托管费		823,986.51	938,388.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	5,824,581.40	3,947,510.69
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,768,281.48	2,403,710.67
负债合计		16,836,066.41	25,269,446.74
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,504,325,551.30	4,229,280,836.11
未分配利润	7.4.7.10	333,954,309.86	227,385,477.33
所有者权益合计		3,838,279,861.16	4,456,666,313.44
负债和所有者权益总计		3,855,115,927.57	4,481,935,760.18

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0953 元，基金份额总额 3,504,325,551.30 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

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	附注号	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
<b>一、收入</b>		365,417,111.90	1,851,367,706.27
1. 利息收入		8,362,106.15	14,184,090.90
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,629,102.11	6,329,801.14

债券利息收入		4,099,415.16	7,854,289.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		633,588.88	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		259,628,633.29	737,425,674.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	245,555,027.41	732,628,388.12
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-1,186,050.00	-13,329,667.04
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	307,032.70
股利收益	7.4.7.15	15,259,655.88	17,819,920.47
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	97,332,429.36	1,099,263,750.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	93,943.10	494,190.79
<b>减：二、费用</b>		106,519,572.89	129,600,468.17
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	58,248,142.18	72,052,205.02
2. 托管费	7.4.10.2.2	9,708,023.73	12,008,700.85
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	38,095,085.90	45,108,127.56
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	468,321.08	431,434.74
<b>三、利润总额</b>		258,897,539.01	1,721,767,238.10
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		258,897,539.01	1,721,767,238.10

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金

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）	4,229,280,836.11	227,385,477.33	4,456,666,313.44

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	258,897,539.01	258,897,539.01
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）	-724,955,284.81	-26,971,614.64	-751,926,899.45
其中：1. 基金申购款	98,442,211.76	695,678.23	99,137,889.99
2. 基金赎回款	-823,397,496.57	-27,667,292.87	-851,064,789.44
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）	-	-125,357,091.84	-125,357,091.84
五、期末所有者权益（基金净值）	3,504,325,551.30	333,954,309.86	3,838,279,861.16
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）	5,358,598,817.57	-1,413,928,517.76	3,944,670,299.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,721,767,238.10	1,721,767,238.10
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）	-1,129,317,981.46	-80,453,243.01	-1,209,771,224.47
其中：1. 基金申购款	498,552,177.59	-10,629,111.36	487,923,066.23
2. 基金赎回款	-1,627,870,159.05	-69,824,131.65	-1,697,694,290.70
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）	4,229,280,836.11	227,385,477.33	4,456,666,313.44

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：

\_\_\_\_\_  
陈国杰  
基金管理公司负责人

\_\_\_\_\_  
房伟力  
主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
陈培  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金(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”)证监基金字[2007]第 131 号《关于同意友邦华泰积极成长混合型证券投资基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞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《华泰柏瑞积极成长混合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 8,920,448,257.95 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(2007)第 065 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》于 2007 年 5 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 8,921,315,668.58 份基金份额,其中认购资金利息折合 867,410.63 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞积极成长混合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、现金、短期金融工具、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 30%-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%-70%,其中,本基金持有全部股改权证的市值不得超过基金资产净值的 3%,本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%。本基金的业绩基准为:沪深 300 指数 $\times$ 60%+中信标普国债指数 $\times$ 40%。

经中国证监会批准,自 2010 年 4 月 30 日起,基金管理人中文名称由“友邦华泰基金管理有限公司”变更为“华泰柏瑞基金管理有限公司”。经基金托管人同意,并报请中国证监会批准,本基金名称自 2010 年 4 月 30 日起,由“友邦华泰积极成长混合型证券投资基金”更名为“华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金”,基金简称为“华泰柏瑞积极成长混合”,基金代码保持不变。本基金、基金管理人更名等的详细内容见 2010 年 4 月 30 日刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报的《友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告》。

本财务报表由本基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2011 年 3 月 30 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》、《华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2010年度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 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策



每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### (1) 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于特殊事项停牌股票，根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，本基金采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对重大影响基金资产净值的特殊事项停牌股票估值，通过停牌股票所处行业的行业指数变动以大致反映市场因素在停牌期间对于停牌股票公允价值的影响。上述指数收益法的关键假设包括所选取行业指数的变动能在重大方面基本反映停牌股票公允价值的变动，停牌股票的发行者在停牌期间的各项变化未对停牌股票公允价值产生重大影响等。本基金自2009年6月15日起，采用中证协(SAC)基金行业股票估值指数以取代原交易所发布的行业指数。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会基金部通知[2006]37号《关于进一

步加强基金投资非公开发行股票风险控制有关问题的通知》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(c) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

无

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无

#### 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 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	活期存款	404,675,193.18		233,267,203.33
定期存款	-		-	
其他存款	-		-	
合计：	404,675,193.18		233,267,203.33	

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,897,705,541.16	3,436,102,209.81	538,396,668.65
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,897,705,541.16	3,436,102,209.81	538,396,668.65
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,576,082,674.37	4,017,146,913.66	441,064,239.29
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	199,340,000.00	199,340,000.00
	合计	199,340,000.00	199,340,000.00

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,775,422,674.37	4,216,486,913.66	441,064,239.29

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	90,297.50	61,923.29
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	3,753.97	1,666.50
应收债券利息	-	406,153.85
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	94,051.47	469,743.64

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	5,824,581.40	3,946,860.69
银行间市场应付交易费用	-	650.00
合计	5,824,581.40	3,947,510.69

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	2,000,000.00	1,750,000.00
应付赎回费	281.48	3,710.67
预提审计费	108,000.00	110,000.00
预提信息披露费	660,000.00	540,000.00
合计	2,768,281.48	2,403,710.67

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,229,280,836.11	4,229,280,836.11
本期申购	98,442,211.76	98,442,211.76
本期赎回（以“-”号填列）	-823,397,496.57	-823,397,496.57
本期末	3,504,325,551.30	3,504,325,551.30

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	127,385,184.91	100,000,292.42	227,385,477.33
本期利润	161,565,109.65	97,332,429.36	258,897,539.01
本期基金份额交易产生的变动数	-3,025,104.67	-23,946,509.97	-26,971,614.64
其中：基金申购款	653,933.52	41,744.71	695,678.23
基金赎回款	-3,679,038.19	-23,988,254.68	-27,667,292.87
本期已分配利润	-125,357,091.84	-	-125,357,091.84
本期末	160,568,098.05	173,386,211.81	333,954,309.86

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	3,492,139.19	6,196,405.14
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-

结算备付金利息收入	136,962.92	133,396.00
其他	-	-
合计	3,629,102.11	6,329,801.14

#### 7.4.7.12 股票投资收益

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
卖出股票成交总额	12,863,975,626.30	15,270,134,531.83
减：卖出股票成本总额	12,618,420,598.89	14,537,506,143.71
买卖股票差价收入	245,555,027.41	732,628,388.12

#### 7.4.7.13 债券投资收益

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
卖出债券（、债转股及债券 到期兑付）成交总额	1,055,794,992.46	919,057,104.64
减：卖出债券（、债转股及 债券到期兑付）成本总额	1,045,183,700.00	921,039,731.80
减：应收利息总额	11,797,342.46	11,347,039.88
债券投资收益	-1,186,050.00	-13,329,667.04

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

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
卖出权证成交总额	-	1,607,964.34
减：卖出权证成本总额	-	1,300,931.64
买卖权证差价收入	-	307,032.70

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月

	月 31 日	31 日
股票投资产生的股利收益	15,259,655.88	17,819,920.47
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,259,655.88	17,819,920.47

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010 年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年 12月31日
1. 交易性金融资产	97,332,429.36	1,099,198,651.68
——股票投资	97,332,429.36	1,100,580,811.68
——债券投资	-	-1,382,160.00
——资产支持证券投资	-	-
2. 衍生工具	-	65,098.65
——权证投资	-	65,098.65
3. 其他	-	-
合计	97,332,429.36	1,099,263,750.33

#### 7.4.7.17 其他收入

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
基金赎回费收入	60,453.45	466,175.57
其他收入	31,590.52	5,820.08
转换费收入	1,899.13	22,195.14
合计	93,943.10	494,190.79

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金财产。

2、本基金的转换费由基金赎回费用及基金申购补差费用构成，其中赎回费用中的 25% 归入基金财产。

#### 7.4.7.18 交易费用

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
交易所市场交易费用	38,090,710.90	45,100,302.56

银行间市场交易费用	4,375.00	7,825.00
合计	38,095,085.90	45,108,127.56

#### 7.4.7.19 其他费用

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
审计费用	108,000.00	110,000.00
信息披露费	320,000.00	300,000.00
银行间帐户服务费	18,000.00	18,000.00
银行划款手续费	22,321.08	3,434.74
合计	468,321.08	431,434.74

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

无

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 10 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 14 日止在本基金注册登记人华泰柏瑞基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.2 元。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司	基金管理人、基金注册登记人、基金直销机构
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
柏瑞投资有限责任公司	基金管理人的股东
华泰证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司、基金代销机构

注：

关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。



7.4.10 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

7.4.10.1.1.1 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1月1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(%)
华泰证券	1,350,128,872.09	5.45	3,785,919,137.92	13.02
华泰联合证券	1,914,230,673.44	7.73	304,285,452.76	1.05

7.4.10.1.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.2 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 (%)
华泰证券股份 有限公司	1,147,605.87	5.56	-	-
华泰联合证券 有限责任公司	1,555,324.93	7.53	1,037,633.84	17.81
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1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	3,218,014.40	13.19	1,118,637.33	28.34
华泰联合证券 有限责任公司	247,233.99	1.01	160,666.39	4.07

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。权证交易不计佣金。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

3、关联方的佣金比率和计算方式与非关联方一致。

#### 7.4.10.2 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	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
当期发生的基金应支付的管理费	58,248,142.18	72,052,205.02
其中：支付给销售机构的客户维护费	6,867,235.05	8,689,090.03

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率计提，计算方法如下：

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

H 为每日应支付的管理人报酬

E 为前一日的基金资产净值

基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	9,708,023.73	12,008,700.85

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

### 7.4.10.3 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 2010年1月1日至2010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
上年度可比期间 2009年1月1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
中国银行股份有限公司	178,464,680.44	213,498,441.28	-	-	-	-

### 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

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
	基金合同生效日（2007年5月29日）持有的基金份额	-
期初持有的基金份额	4,661,072.26	4,661,072.26
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	4,661,072.26	4,661,072.26
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.13%	0.11%

#### 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

注：本报告期及 2009 年度，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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 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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	404,675,193.18	3,492,139.19	233,267,203.33	6,196,405.14

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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：股/张)	总金额
华泰证券	601377	兴业证券	新股认购	1,259,578	12,595,780.00
华泰证券	601288	农业银行	新股认购	929,000	2,489,720.00
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位：股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-

注：华泰证券股份有限公司为以上证券发行时的分销商成员。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		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	本期利润分配 合计	备注
		场外	场内					
1	2010 年 1 月 18 日	2010 年 1 月 18 日		0.3000	58,127,755.40	67,229,336.44	125,357,091.84	
合计	-	-		0.3000	58,127,755.40	67,229,336.44	125,357,091.84	

注：本基金报告期末可供分配利润为 160,568,098.05 元。根据基金合同约定，本基金已于 2011 年 1 月 17 日对 2010 年度可分配利润实施了分红，每 10 份基金份额派发现金红利 0.2 元。

### 7.4.12 期末（2010 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：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601377	兴业证券	2010 年 9 月 29 日	2011 年 1 月 13 日	新股流通受限	10.00	16.20	1,259,578	12,595,780.00	20,405,163.60	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌 开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	10/12/28	配股停牌	19.71	11/01/06	17.29	2,128,660	37,493,670.88	41,955,888.60	-

注：1、本基金截至 2010 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

无。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于较高风险品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金及货币市场基金，通过主动投资追求适度风险水平下的较高收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。

组织是指由公司总经理领导，以风险控制委员会为核心，由督察长、风险管理部、法律监察部组成的风险管理机构，它是风险管理体系的运作基础；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券（2009 年 12 月 31 日：同）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严

密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余金融资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等，其余大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

##### **7.4.13.4.1.1 利率风险敞口**

单位：人民币元

本期末 2010 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	404,675,193.18	-	-	-	-	-	404,675,193.18
结算备付金	9,750,600.56	-	-	-	-	-	9,750,600.56
存出保证金	-	-	-	-	-	4,396,554.31	4,396,554.31
交易性金融资产	-	-	-	-	-	3,436,102,209.81	3,436,102,209.81
应收利息	-	-	-	-	-	94,051.47	94,051.47
应收申购款	94,615.44	-	-	-	-	2,702.80	97,318.24
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	414,520,409.18	-	-	-	-	3,440,595,518.39	3,855,115,927.57
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,475,298.10	2,475,298.10
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,943,918.92	4,943,918.92
应付托管费	-	-	-	-	-	823,986.51	823,986.51
应付交易费用	-	-	-	-	-	5,824,581.40	5,824,581.40
其他负债	-	-	-	-	-	2,768,281.48	2,768,281.48
负债总计	-	-	-	-	-	16,836,066.41	16,836,066.41
利率敏感度缺口	414,520,409.18	-	-	-	-	3,423,759,451.98	3,838,279,861.16
上年度末 2009 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	233,267,203.33	-	-	-	-	-	233,267,203.33
结算备付金	4,328,431.92	-	-	-	-	-	4,328,431.92
存出保证金	-	-	-	-	-	4,654,930.07	4,654,930.07
交易性金融资产	-	199,340,000.00	-	-	-	4,017,146,913.66	4,216,486,913.66
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,411,526.72	22,411,526.72
应收利息	-	-	-	-	-	469,743.64	469,743.64
应收申购款	107,132.38	-	-	-	-	209,878.46	317,010.84
资产总计	237,702,767.63	199,340,000.00	-	-	-	4,044,892,992.55	4,481,935,760.18
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,349,506.51	12,349,506.51
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,630,330.45	5,630,330.45
应付托管费	-	-	-	-	-	938,388.42	938,388.42
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,947,510.69	3,947,510.69
其他负债	-	-	-	-	-	2,403,710.67	2,403,710.67
负债总计	-	-	-	-	-	25,269,446.74	25,269,446.74
利率敏感度缺口	237,702,767.63	199,340,000.00	-	-	-	4,019,623,545.81	4,456,666,313.44

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早



者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资 (2009 年 12 月 31 日持有交易型债券投资占基金净值比例：4.47%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2009 年 12 月 31 日：同)

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的 30%-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%-70%，此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	3,436,102,209.81	89.52	4,017,146,913.66	90.14
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,436,102,209.81	89.52	4,017,146,913.66	90.14

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币亿元）

		本期末（2010 年 12 月 31 日）	上年度末（2009 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上涨 5%	1.80	1.87
	沪深 300 指数下跌 5%	-1.80	-1.87

#### 7.4.14 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 3,394,146,321.21 元，属于第二层级的余额为 41,955,888.60 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级 3,937,244,129.40 元，第二层级 279,242,784.26 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 年度：同)。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，并于限售期满后从第二层级转入第一层级，本基金于本年度内未发生持有的非公开发行股票限售期满的情况(2009 年度：非公开发行股票的公允价值所属层级于限售期满后从第二层级转入第一层级)。

##### (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	3,436,102,209.81	89.13
	其中：股票	3,436,102,209.81	89.13
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	414,425,793.74	10.75
6	其他各项资产	4,587,924.02	0.12
7	合计	3,855,115,927.57	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	31,880,731.85	0.83
B	采掘业	182,903,406.65	4.77
C	制造业	2,269,422,332.88	59.13
C0	食品、饮料	433,201,046.72	11.29
C1	纺织、服装、皮毛	36,966,166.08	0.96
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	7,870,200.00	0.21
C4	石油、化学、塑胶、塑料	514,241,954.73	13.40
C5	电子	198,438,881.17	5.17
C6	金属、非金属	211,718,184.05	5.52
C7	机械、设备、仪表	361,544,093.36	9.42
C8	医药、生物制品	403,687,610.39	10.52
C99	其他制造业	101,754,196.38	2.65
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	127,061,141.01	3.31
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	288,505,783.34	7.52
H	批发和零售贸易	132,908,218.26	3.46

I	金融、保险业	186,349,164.38	4.86
J	房地产业	49,077,612.72	1.28
K	社会服务业	106,908,031.34	2.79
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	61,085,787.38	1.59
	合计	3,436,102,209.81	89.52

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600458	时代新材	5,783,033	369,073,166.06	9.62
2	600519	贵州茅台	748,759	137,711,755.28	3.59
3	601318	中国平安	2,232,693	125,388,038.88	3.27
4	000969	安泰科技	4,389,741	101,754,196.38	2.65
5	600298	安琪酵母	1,919,687	85,003,740.36	2.21
6	000423	东阿阿胶	1,458,185	74,513,253.50	1.94
7	600366	宁波韵升	2,661,425	69,223,664.25	1.80
8	002236	大华股份	802,993	67,355,052.84	1.75
9	000581	威孚高科	1,728,670	64,220,090.50	1.67
10	000039	中集集团	2,713,417	62,381,456.83	1.63
11	600406	国电南瑞	860,000	61,971,600.00	1.61
12	600585	海螺水泥	1,933,769	57,394,263.92	1.50
13	600809	山西汾酒	834,521	57,189,724.13	1.49
14	601699	潞安环能	914,275	54,527,361.00	1.42
15	600198	大唐电信	2,747,351	53,930,500.13	1.41
16	002390	信邦制药	1,149,701	48,689,837.35	1.27
17	002063	远光软件	1,550,235	48,212,308.50	1.26
18	002375	亚厦股份	523,997	48,197,244.06	1.26
19	002038	双鹭药业	769,927	45,425,693.00	1.18
20	600707	彩虹股份	2,351,544	44,961,521.28	1.17
21	600518	康美药业	2,128,660	41,955,888.60	1.09
22	000538	云南白药	671,815	40,577,626.00	1.06
23	000425	徐工机械	699,977	40,038,684.40	1.04
24	002024	苏宁电器	2,992,039	39,195,710.90	1.02
25	002140	东华科技	907,982	37,318,060.20	0.97
26	600276	恒瑞医药	605,964	36,091,215.84	0.94
27	002099	海翔药业	1,496,972	35,627,933.60	0.93

28	002163	中航三鑫	2,099,892	35,572,170.48	0.93
29	002106	莱宝高科	517,601	34,291,066.25	0.89
30	600100	同方股份	1,280,000	33,932,800.00	0.88
31	000937	冀中能源	845,726	33,871,326.30	0.88
32	601601	中国太保	1,469,911	33,660,961.90	0.88
33	600261	浙江阳光	782,380	33,102,497.80	0.86
34	000401	冀东水泥	1,277,782	30,193,988.66	0.79
35	000009	中国宝安	1,799,994	30,185,899.38	0.79
36	601101	昊华能源	638,167	30,032,139.02	0.78
37	600176	中国玻纤	1,149,997	29,209,923.80	0.76
38	000826	桑德环境	862,022	28,765,674.14	0.75
39	600997	开滦股份	1,400,102	28,184,053.26	0.73
40	600537	海通集团	699,950	28,123,991.00	0.73
41	600739	辽宁成大	880,000	26,505,600.00	0.69
42	000858	五粮液	756,675	26,203,655.25	0.68
43	601607	上海医药	1,188,399	25,954,634.16	0.68
44	002148	北纬通信	577,297	25,845,586.69	0.67
45	000973	佛塑股份	1,627,152	24,748,981.92	0.64
46	000799	酒鬼酒	1,099,608	23,971,454.40	0.62
47	002269	美邦服饰	644,550	22,449,676.50	0.58
48	002051	中工国际	563,951	22,027,926.06	0.57
49	600690	青岛海尔	753,390	21,253,131.90	0.55
50	601377	兴业证券	1,259,578	20,405,163.60	0.53
51	002313	日海通讯	349,854	20,186,575.80	0.53
52	600415	小商品城	572,200	20,049,888.00	0.52
53	600520	三佳科技	1,402,068	19,460,703.84	0.51
54	000617	石油济柴	979,856	19,146,386.24	0.50
55	002118	紫鑫药业	579,985	18,617,518.50	0.49
56	002326	永太科技	308,050	17,558,850.00	0.46
57	002250	联化科技	420,341	17,233,981.00	0.45
58	002310	东方园林	121,589	16,778,066.11	0.44
59	600859	王府井	321,985	16,723,900.90	0.44
60	000869	张裕A	173,567	16,655,489.32	0.43
61	002073	软控股份	599,910	16,011,597.90	0.42
62	600498	烽火通信	377,780	15,624,980.80	0.41
63	600048	保利地产	1,199,938	15,239,212.60	0.40
64	002273	水晶光电	300,000	15,147,000.00	0.39
65	002154	报喜鸟	449,810	14,303,958.00	0.37
66	002042	华孚色纺	462,911	13,813,264.24	0.36

67	002081	金螳螂	199,939	13,751,804.42	0.36
68	000759	武汉中百	1,079,824	13,519,396.48	0.35
69	002211	宏达新材	799,946	13,479,090.10	0.35
70	002019	鑫富药业	799,993	13,431,882.47	0.35
71	600887	伊利股份	349,955	13,389,278.30	0.35
72	002202	金风科技	599,908	13,377,948.40	0.35
73	002013	中航精机	399,910	13,013,071.40	0.34
74	000877	天山股份	407,982	12,879,991.74	0.34
75	600888	新疆众和	532,000	12,794,600.00	0.33
76	600456	宝钛股份	448,308	12,149,146.80	0.32
77	000951	中国重汽	419,968	11,616,314.88	0.30
78	002168	深圳惠程	299,950	11,611,064.50	0.30
79	600971	恒源煤电	220,754	11,470,377.84	0.30
80	600354	敦煌种业	305,622	11,094,078.60	0.29
81	600770	综艺股份	500,000	10,850,000.00	0.28
82	002155	辰州矿业	299,997	10,775,892.24	0.28
83	002482	广田股份	123,600	10,476,336.00	0.27
84	600238	海南椰岛	610,927	10,214,699.44	0.27
85	000895	双汇发展	115,471	10,045,977.00	0.26
86	002311	海大集团	314,992	9,676,554.24	0.25
87	300096	易联众	231,526	9,272,616.30	0.24
88	002293	罗莱家纺	121,418	8,848,943.84	0.23
89	600823	世茂股份	650,000	8,781,500.00	0.23
90	000926	福星股份	638,215	8,603,138.20	0.22
91	002007	华兰生物	177,638	8,595,902.82	0.22
92	000559	万向钱潮	619,334	8,577,775.90	0.22
93	002123	荣信股份	180,015	8,550,712.50	0.22
94	000860	顺鑫农业	372,926	8,484,066.50	0.22
95	000063	中兴通讯	309,472	8,448,585.60	0.22
96	600420	现代制药	437,720	8,391,092.40	0.22
97	600143	金发科技	511,301	8,237,059.11	0.21
98	000963	华东医药	250,000	8,217,500.00	0.21
99	600375	星马汽车	333,193	8,216,539.38	0.21
100	000527	美的电器	467,364	8,132,133.60	0.21
101	600963	岳阳纸业	780,000	7,870,200.00	0.21
102	600123	兰花科创	165,609	7,796,871.72	0.20
103	600993	马应龙	169,185	7,719,911.55	0.20
104	600079	人福医药	299,914	7,641,808.72	0.20
105	002408	齐翔腾达	185,174	7,475,474.38	0.19

106	000598	兴蓉投资	350,000	7,220,500.00	0.19
107	600208	新湖中宝	1,199,981	7,199,886.00	0.19
108	000929	兰州黄河	599,950	7,163,403.00	0.19
109	600111	包钢稀土	100,090	7,150,429.60	0.19
110	600499	科达机电	299,926	7,150,235.84	0.19
111	600467	好当家	493,944	7,137,490.80	0.19
112	600160	巨化股份	300,000	6,804,000.00	0.18
113	600720	祁连山	394,194	6,760,427.10	0.18
114	002152	广电运通	116,205	6,319,227.90	0.16
115	000679	大连友谊	442,476	6,296,433.48	0.16
116	600508	上海能源	220,763	6,245,385.27	0.16
117	002244	滨江集团	499,989	5,639,875.92	0.15
118	002065	东华软件	178,376	5,488,629.52	0.14
119	000012	南玻A	270,700	5,346,325.00	0.14
120	002304	洋河股份	23,500	5,264,000.00	0.14
121	002215	诺普信	149,901	5,230,045.89	0.14
122	002086	东方海洋	279,951	5,165,095.95	0.13
123	000612	焦作万方	214,108	4,667,554.40	0.12
124	002297	博云新材	199,902	4,135,972.38	0.11
125	000888	峨眉山A	238,535	4,114,728.75	0.11
126	600054	黄山旅游	227,506	3,990,455.24	0.10
127	002089	新海宜	155,000	3,986,600.00	0.10
128	600976	武汉健民	149,991	3,427,294.35	0.09
129	000725	京东方A	1,000,000	3,160,000.00	0.08
130	000978	桂林旅游	221,217	2,953,246.95	0.08
131	000876	新希望	123,500	2,587,325.00	0.07
132	600036	招商银行	200,000	2,562,000.00	0.07
133	601299	中国北车	350,000	2,481,500.00	0.06
134	601166	兴业银行	100,000	2,405,000.00	0.06
135	601989	中国重工	200,000	2,358,000.00	0.06
136	000521	美菱电器	200,000	2,292,000.00	0.06
137	000961	中南建设	199,958	2,285,519.94	0.06
138	000002	万科A	250,000	2,055,000.00	0.05
139	600741	华域汽车	200,000	2,042,000.00	0.05
140	600837	海通证券	200,000	1,928,000.00	0.05
141	600352	浙江龙盛	150,000	1,759,500.00	0.05
142	600050	中国联通	300,000	1,605,000.00	0.04
143	002285	世联地产	50,000	1,559,000.00	0.04
144	600388	龙净环保	39,955	1,351,677.65	0.04

145	000625	长安汽车	100,000	951,000.00	0.02
146	601007	金陵饭店	53,900	517,440.00	0.01
147	600161	天坛生物	20,000	458,000.00	0.01
148	002139	拓邦股份	19,950	421,743.00	0.01
149	002531	N 天顺	500	12,660.00	0.00

## 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	601318	中国平安	314,597,287.44	7.06
2	601601	中国太保	243,767,513.34	5.47
3	600458	时代新材	233,407,973.76	5.24
4	600000	浦发银行	194,920,422.69	4.37
5	600519	贵州茅台	186,739,040.69	4.19
6	601111	中国国航	176,670,407.20	3.96
7	002236	大华股份	176,436,932.90	3.96
8	600739	辽宁成大	172,254,380.22	3.87
9	600518	康美药业	134,501,378.36	3.02
10	000969	安泰科技	121,086,361.05	2.72
11	600547	山东黄金	116,330,643.08	2.61
12	000983	西山煤电	116,287,044.82	2.61
13	600298	安琪酵母	114,988,734.68	2.58
14	600707	彩虹股份	109,181,075.86	2.45
15	600489	中金黄金	108,325,463.52	2.43
16	600048	保利地产	99,801,234.40	2.24
17	600366	宁波韵升	96,613,828.60	2.17
18	002007	华兰生物	92,689,579.75	2.08
19	000423	东阿阿胶	91,518,397.25	2.05
20	600036	招商银行	90,785,573.23	2.04
21	601166	兴业银行	90,067,703.46	2.02

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	600000	浦发银行	266,725,445.92	5.98
2	601318	中国平安	256,504,843.01	5.76
3	600036	招商银行	238,825,836.55	5.36
4	601601	中国太保	199,815,290.94	4.48
5	601166	兴业银行	191,187,261.78	4.29
6	601111	中国国航	165,276,407.88	3.71
7	000983	西山煤电	150,239,901.90	3.37
8	002236	大华股份	147,039,131.89	3.30
9	601169	北京银行	134,366,183.42	3.01
10	000001	深发展A	128,626,023.65	2.89
11	600739	辽宁成大	128,198,494.92	2.88
12	600547	山东黄金	125,287,964.04	2.81
13	600015	华夏银行	122,478,000.36	2.75
14	600971	恒源煤电	121,132,583.71	2.72
15	600111	包钢稀土	112,593,363.97	2.53
16	000792	盐湖钾肥	107,223,387.91	2.41
17	600048	保利地产	105,621,214.82	2.37
18	000969	安泰科技	99,804,574.52	2.24
19	600518	康美药业	98,355,040.72	2.21
20	000970	中科三环	97,983,103.68	2.20
21	600694	大商股份	94,877,634.05	2.13
22	600519	贵州茅台	91,978,149.03	2.06
23	600489	中金黄金	91,726,651.61	2.06
24	600016	民生银行	91,279,916.96	2.05
25	000559	万向钱潮	89,250,680.67	2.00

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	11,940,043,465.68
卖出股票收入（成交）总额	12,863,975,626.30

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资组合。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.7 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。

### 8.8 投资组合报告附注

8.8.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

8.8.2 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。

#### 8.8.3 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	4,396,554.31
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	94,051.47
5	应收申购款	97,318.24
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,587,924.02

#### 8.8.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.8.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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
125, 556	27, 910. 46	411, 702, 457. 89	11. 75%	3, 092, 623, 093. 41	88. 25%

### 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, 190, 924. 75	0. 0340%

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 ( 2007 年 5 月 29 日 ) 基金份额总额	8, 921, 315, 668. 58
本报告期期初基金份额总额	4, 229, 280, 836. 11
本报告期基金总申购份额	98, 442, 211. 76
减: 本报告期基金总赎回份额	823, 397, 496. 57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3, 504, 325, 551. 30

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，根据基金管理人公司章程规定，并经基金管理人股东会审议通过，基金管理人的独立董事林征女士、徐耀华先生及王学林先生因任期届满，不再担任公司独立董事，由朱小平先生、陈念良先生及薛加玉先生担任公司第三届董事会独立董事。

另外，由于基金管理人的董事Ravi Mehrotra先生因个人原因辞去董事职务，基金管理人的股东书面一致决定由Soo Kok Beng Peter(苏国明)先生担任公司第三届董事会董事，Ravi Mehrotra先生不再担任基金管理人的董事。上述人员的变更已报中国证券监督管理委员会及上海监管局备案。有关公告刊登在中国证券报、上海证券报、证券时报及基金管理人网站上。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的报酬为108,000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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	3,761,790,842.52	15.19%	3,197,514.21	15.48%	-
东方证券	1	2,502,777,811.03	10.10%	2,127,356.78	10.30%	-
国信证券	1	2,307,120,456.23	9.32%	1,874,548.25	9.07%	-
联合证券	1	1,914,230,673.44	7.73%	1,555,324.93	7.53%	-

中信证券	1	1,813,848,641.63	7.32%	1,541,765.91	7.46%	-
国泰君安	1	1,425,247,148.62	5.75%	1,158,020.59	5.61%	-
华泰证券	1	1,350,128,872.09	5.45%	1,147,605.87	5.56%	-
银河证券	1	1,171,629,142.02	4.73%	995,881.97	4.82%	-
西南证券	1	1,146,919,665.11	4.63%	974,879.18	4.72%	-
山西证券	1	1,113,167,080.25	4.49%	904,456.99	4.38%	-
广发证券	1	886,753,203.25	3.58%	753,736.24	3.65%	-
国金证券	1	863,474,148.04	3.49%	701,578.46	3.40%	-
海通证券	1	830,257,350.84	3.35%	674,588.77	3.27%	-
方正证券	1	690,709,491.23	2.79%	561,206.39	2.72%	-
财通证券	1	683,652,089.56	2.76%	581,103.16	2.81%	-
浙商证券	1	640,087,638.79	2.58%	520,074.53	2.52%	-
招商证券	1	618,719,073.05	2.50%	502,712.91	2.43%	-
德邦证券	1	332,421,656.38	1.34%	282,557.93	1.37%	-
申银万国	1	308,444,705.95	1.25%	262,178.44	1.27%	-
中金公司	1	294,066,902.57	1.19%	249,955.71	1.21%	-
中邮证券	1	112,312,879.57	0.45%	91,254.85	0.44%	-

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		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
长城证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

西南证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	400,000,000.00	100.00%	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司参加交通银行关于网上银行、手机银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年12月31日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司参加	中国证券报、上海证	2010年12月31日

	中国工商银行——“2011 倾心回馈”基金定投优惠活动的公告	券报、证券时报	
3	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加深发展银行关于开展基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 12 月 31 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国邮储银行个人网上申购基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 12 月 31 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司在相关销售机构开始办理相关基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 12 月 6 日
6	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金 2010 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 10 月 28 日
7	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金获配兴业证券股份有限公司首次公开发行 A 股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 9 月 30 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司继续参加中国农业银行网上银行申购基金费率优惠延期活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 9 月 30 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司参加华泰证券股份有限公司开放式基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 9 月 17 日
10	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与认购 2010 年太原市高速铁路投资有限公司发行公司债券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 9 月 9 日
11	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资	中国证券报、上海证	2010 年 8 月 28 日

	资基金 2010 年半年度报告	券报、证券时报	
12	华泰柏瑞积极成长混合型证券投资 资基金 2010 年半年度报告摘要	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 8 月 28 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司参加 齐鲁证券网上费率优惠活动的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 8 月 27 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于 提请投资者及时更新已过期身份 证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 8 月 19 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司参加 国泰君安证券开放式基金网上交 易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 8 月 18 日
16	华泰柏瑞积极成长混合型证券投 资基金 2010 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 7 月 19 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于 变更直销银行账户信息的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 7 月 16 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于 增加中国民族证券有限责任公司 为代销机构的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 7 月 10 日
19	关于华泰柏瑞基金管理有限公司 旗下基金参与申购农业银行股份 有限公司发行 A 股的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 7 月 10 日
20	华泰柏瑞积极成长混合型证券投 资基金更新的招募说明书(摘要) 2010 年第 2 号	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 7 月 10 日
21	华泰柏瑞积极成长混合型证券投 资基金更新的招募说明书 2010 年第 2 号	中国证券报、上海证 券报、证券时报	2010 年 7 月 10 日
22	华泰柏瑞基金管理公司继续参加	中国证券报、上海证	2010 年 6 月 30 日



	交通银行网上银行开放式基金申购费率优惠活动的公告	券报、证券时报	
23	华泰柏瑞基金管理公司继续参加中国邮储银行网上交易系统开放式基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年6月28日
24	华泰柏瑞基金管理公司参加中国建银投资证券网上开放式基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年6月24日
25	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下基金参与交通银行股份有限公司A股配股的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年6月24日
26	华泰柏瑞基金管理公司参加安信证券网上开放式基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年6月23日
27	关于华泰柏瑞基金管理有限公司旗下部分基金申购和配售中国银行股份有限公司A股可转换公司债券的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年6月9日
28	华泰柏瑞基金管理公司参加中信银行个人网银渠道申购开放式基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年6月1日
29	华泰柏瑞基金管理公司参加信达证券对非现场委托方式基金申购业务实行费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年5月31日
30	华泰柏瑞基金管理公司参加华融证券基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年5月28日
31	华泰柏瑞基金管理公司参加南京证券开放式基金申购费率优惠活动	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年5月24日

	动的公告		
32	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加西南证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年5月5日
33	华泰柏瑞基金管理公司继续参加深圳发展银行开放式基金网上、电话银行日常申购费率及定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月30日
34	华泰柏瑞基金管理有限公司参加广州证券网上交易开放式基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月30日
35	华泰柏瑞基金管理有限公司关于增加广州证券为销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月30日
36	友邦华泰基金管理有限公司关于股东更名、公司更名及旗下基金更名的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月30日
37	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2010 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月21日
38	友邦华泰基金公司参加兴业证券股份有限公司开放式基金定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月9日
39	友邦华泰基金管理公司参加东方证券开放式基金网上、电话、手机委托申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月2日
40	友邦华泰基金管理有限公司继续参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年4月1日
41	友邦华泰基金管理有限公司继续参加华夏银行网上银行基金申购	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010年3月31日

	费率及定投申购费率优惠活动的公告		
42	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 3 月 26 日
43	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 3 月 26 日
44	友邦华泰基金管理有限公司关于增加华融证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 3 月 17 日
45	友邦华泰基金管理有限公司关于增加东兴证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 2 月 26 日
46	友邦华泰基金管理有限公司关于对中国民生银行借记卡持有人开通公司网上交易业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 26 日
47	友邦华泰积极成长混合型证券投资基金 2009 年第四季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 22 日
48	友邦华泰基金管理有限公司关于参加在深圳发展银行基金定投及申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 14 日
49	友邦华泰基金管理有限公司关于增加浙商证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 1 月 7 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

### 13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费）021-3878 4638 公司网址：[www.huatai-pb.com](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司  
2011 年 3 月 30 日