

华宝兴业收益增长混合型证券投资基金 2011 年年度报告（摘要）

2011 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

送出日期：2012 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

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 2012 年 3 月 26 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 2011 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业收益增长混合型证券投资基金
基金简称	华宝兴业收益增长混合
基金主代码	240008
交易代码	240008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006 年 6 月 15 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	1,151,331,591.71 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	投资稳定分红和有分红潜力的价值被低估上市公司，以分享该类上市公司的长期稳定的股息收入及资本增值。
投资策略	本基金采取积极的资产配置策略，通过公司自行开发的数量化辅助模型，结合宏观策略研究，对相关资产类别的预期收益进行动态跟踪，决定大类资产配置比例。股票投资部分采用定量与定性分析相结合，行业配置与定期调整策略；债券投资部分通过大资产配置、分类资产配置和个券选择三个层次自上而下进行债券投资管理。
业绩比较基准	65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金，风险高于债券基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

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.com
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

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	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	2011 年	2010 年	2009 年
本期已实现收益	-526,467,532.95	130,409,989.40	939,456,312.07
本期利润	-842,859,481.90	-655,558,519.98	3,759,356,691.30
加权平均基金份额本期利润	-0.6926	-0.3158	1.6732
本期加权平均净值利润率	-24.18%	-10.16%	60.09%
本期基金份额净值增长率	-21.40%	-6.40%	91.39%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
期末可供分配利润	1,282,646,561.12	2,240,897,913.20	3,791,021,927.54
期末可供分配基金份额利润	1.1141	1.5411	1.4721
期末基金资产净值	2,936,925,378.75	4,719,319,440.86	8,929,487,751.71
期末基金份额净值	2.5509	3.2455	3.4674
3.1.3 累计期末指标	2011 年末	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	155.09%	224.55%	246.74%

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、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、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。

4、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	-1.76%	0.91%	-3.53%	0.74%	1.77%	0.17%

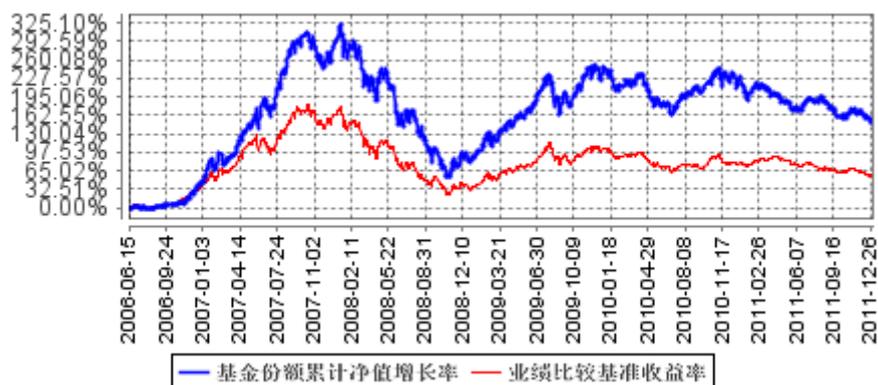
过去六个月	-9.75%	0.88%	-11.04%	0.78%	1.29%	0.10%
过去一年	-21.40%	0.98%	-10.86%	0.76%	-10.54%	0.22%
过去三年	40.80%	1.39%	20.40%	1.08%	20.40%	0.31%
过去五年	74.52%	1.84%	13.69%	1.48%	60.83%	0.36%
自基金合同生效日起至今	155.09%	1.77%	57.79%	1.44%	97.30%	0.33%

注：1、本基金比较基准为：65%上证红利指数收益率+35%上证国债指数收益率

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

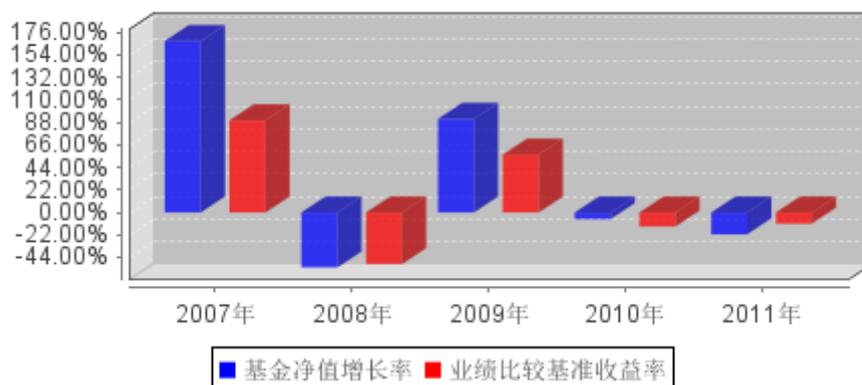
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：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2006年12月15日，本基金已达到合同规定的资产配置比例。

3.2.3 过去五年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

过去五年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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年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（2011 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、新兴产业基金、成熟市场动量优选基金、可转债基金、上证 180 成长 ETF、上证 180 成长 ETF 联接基金、华宝油气基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 37,012,970,285.05 元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵喆阳	本基金基金经理	2010 年 6 月 26 日	-	5 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先后任行业分析师、华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理

					助理、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月至今任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理。
季鹏	本基金基金经理助理、华宝兴业宝康配置混合基金经理助理	2011年7月8日	2011年11月3日	4年	金融学硕士，FRM。曾任香港大福证券担任行业研究员，光大保德信基金管理公司高级行业研究员、首席策略分析师、基金经理助理。2011年4月加盟华宝兴业基金管理公司，担任高级策略分析师，2011年7月至2011年11月任华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金经理助理，2011年11月兼任华

					宝兴业宝康灵活配置证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	------------------------

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、《华宝兴业收益增长混合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。

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

本基金在 2011 年全年的业绩表现前高后低，全年看我们始终对不断上升通胀和由此带来的宏观紧缩心存担忧，但是在上半年尤其在一季度经济的小反弹让我们一度对自己的判断有一些怀疑，导致没有及时降低了仓位，这也是本基金在上半年业绩较差的主要原因。2011 年下半年，我们对组合进行了较大幅度的调整，首先是降低仓位，其次加大配置了政府在 2011 年下半年提出重点发展的文化产业相关的公司股票，以及过去几年跌幅较大且基本面相对稳定的银行，地产等板块，同时继续超配以食品

饮料行业为主的消费品行业，取得了较好的效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止至本报告期末，报告期内基金份额净值增长率为-21.40%，基金业绩比较基准收益率为-10.86%，基金落后业绩基准 10.54%。

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 2012 年 1 季度，我们对宏观经济的看法没有大的改变，虽然市场普遍预期的通胀高位回落在 2011 年四季度实现了，但是我们认为通胀依然会是宏观经济最大的不确定性，通胀并未走远！这是因为本轮通胀的成因相较以往要复杂得多，中国政府由于担心经济增速下滑所以在过去两年内对于过量货币的回收始终比较犹豫且幅度较小。政府面临压通胀和保增长的两难境地，政策腾挪的空间逐步收窄。这既考验政府的管理能力亦是对投资人的投资能力的考验。

但是我们也认为经过将近一年的宏观紧缩，政策进入观察期的可能性很大，所以我们认为有保有压将是政策的首选，并且存在一定的可能在某个阶段，由于经济的快速下滑从而逼迫政府放松货币刺激经济。那时我们预计股市会有所正面反应，但必须谨记在通胀威胁没有彻底消除前，任何放松都会引致更严重的通胀和更严厉的紧缩，所以我们必须留一份清醒。我们始终认为鉴于目前中国的宏观经济环境，隐忍和耐心都是政府与民众所最必需的，我们必须付出一段时间经济增速放缓的代价来实现经济体内各个生产要素的价格出清以承担 2008 年至 2009 年的过度刺激的恶果。

但同时，我们始终相信中国经济的潜力还巨大，在新经济出现之前，其实经济不平衡是发展的最大瓶颈，如果不平衡的状况得到缓解：外贸依赖下降，东西部更加平衡，社会保障制度更加充分，各种要素价格、资源配置更加合理，那么，从人均福利的角度看，传统经济在内需方面，无论投资和消费结构性升级仍有很大空间。这既可以保持经济增长的持续性也是对当前通胀压力的有效疏通。

我们的投资策略将充分考虑上述因素对市场的影响，重点关注业绩明显改善的行业和个股，注重消费升级、劳动力成本上升等重要因素对行业中长期发展的影响。行业中的领先公司或者具有较高管理水平的公司，有可能在经济震荡中进一步增强竞争力，这类公司是我们重点关注的对象。

本基金将在 2012 年 1 季度以及后面的时间内加强在部分盈利增长稳定，估值合理的行业和个股中把握机会，加大配置。本基金将在考虑流动性的基础上提高持股集中度，以进一步发挥本基金在选股能力上的优势，我们相信未来的一段时间 A 股市场尚难走出大规模的上涨行情，震荡市和结构市已经是相对比较乐观的判断，所以本基金争取在 2011 年下半年尤其是四季度良好业绩基础上继续稳扎稳打，以回报持有人对我们长期的宽容和信任。

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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产		本期末 2011 年 12 月 31 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		523,552,352.77	277,720,802.33
结算备付金		4,472,132.27	54,609,562.24
存出保证金		3,332,388.64	9,019,916.65
交易性金融资产		2,269,693,238.54	4,529,991,330.33
其中：股票投资		2,172,963,238.54	4,181,206,330.33
基金投资		-	-
债券投资		96,730,000.00	348,785,000.00
资产支持证券 投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		201,500,502.25	-
应收证券清算款		-	-
应收利息		2,548,789.75	9,391,531.72
应收股利		-	-
应收申购款		408,909.41	2,573,478.47
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		3,005,508,313.63	4,883,306,621.74
负债和所有者权益		本期末	上年度末
		2011 年 12 月 31 日	2010 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		48,436,665.49	115,276,968.79
应付赎回款		636,447.00	1,932,146.13

应付管理人报酬		3,836,032.13	6,217,544.53
应付托管费		639,338.70	1,036,257.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		14,106,775.09	38,585,430.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		927,676.47	938,833.27
负债合计		68,582,934.88	163,987,180.88
所有者权益：			
实收基金		1,151,331,591.71	1,454,097,261.63
未分配利润		1,785,593,787.04	3,265,222,179.23
所有者权益合计		2,936,925,378.75	4,719,319,440.86
负债和所有者权益总计		3,005,508,313.63	4,883,306,621.74

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 2.5509 元，基金份额总额 1,151,331,591.71 份。

7.2 利润表

会计主体：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目		本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
一、收入		-742,881,620.97	-444,457,494.55
1. 利息收入		13,670,497.32	14,555,933.70
其中：存款利息收入		4,591,246.85	6,357,723.16
债券利息收入		7,011,479.50	8,044,675.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,067,770.97	153,534.78
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-441,166,985.34	322,812,387.33
其中：股票投资收益		-459,944,322.00	275,117,483.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,971,961.71	454,697.84
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-

股利收益		22,749,298.37	47,240,206.08
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-316,391,948.95	-785,968,509.38
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)		1,006,816.00	4,142,693.80
减：二、费用		99,977,860.93	211,101,025.43
1. 管理人报酬		52,532,816.03	97,137,243.10
2. 托管费		8,755,469.42	16,189,540.42
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		38,230,130.10	97,293,632.73
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		459,445.38	480,609.18
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-842,859,481.90	-655,558,519.98
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-842,859,481.90	-655,558,519.98

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：华宝兴业收益增长混合型证券投资基金

本报告期：2011年1月1日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011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)	1,454,097,261.63	3,265,222,179.23	4,719,319,440.86
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-842,859,481.90	-842,859,481.90
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)	-302,765,669.92	-636,768,910.29	-939,534,580.21
其中：1. 基金申购款	100,256,497.59	185,846,594.30	286,103,091.89
2. 基金赎回款	-403,022,167.51	-822,615,504.59	-1,225,637,672.10
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）	1,151,331,591.71	1,785,593,787.04	2,936,925,378.75
项目	上年度可比期间 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）	2,575,297,714.74	6,354,190,036.97	8,929,487,751.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-655,558,519.98	-655,558,519.98
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）	-1,121,200,453.11	-2,433,409,337.76	-3,554,609,790.87
其中：1. 基金申购款	216,428,479.60	469,181,111.53	685,609,591.13
2. 基金赎回款	-1,337,628,932.71	-2,902,590,449.29	-4,240,219,382.00
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）	1,454,097,261.63	3,265,222,179.23	4,719,319,440.86

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：

<u> 裴长江 </u>	<u> 黄小慧 </u>	<u> 张幸骏 </u>
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华宝兴业收益增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[2006]第 86 号《关于同意华宝兴业收益增长混合型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《华宝兴业收益增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 2,339,342,609.46 元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2006)第 70 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金基金合同》于 2006 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总

额为 2,339,809,854.34 份基金份额，其中认购资金利息折合 467,244.88 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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华宝兴业收益增长混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为国内依法公开发行、上市的股票、债券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。在正常的市场情况下，本基金的投资比例范围为：股票占基金资产净值的 30%-95%，权证占 0%-3%，债券占 0%-70%，现金或者到期日在一年内的政府债券比例在 5%以上；投资于稳定分红股票的比例不低于股票资产的 80%（稳定分红指过去三年内至少两次实施现金红利分配）。本基金的业绩比较基准为：上证红利指数收益率×65%+上证国债指数收益率×35%。

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 2012 年 3 月 26 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《华宝兴业收益增长混合型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 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 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
宝钢集团有限公司（“宝钢集团”）	基金管理人的最终控制方
华宝证券有限责任公司（“华宝证券”）	受基金管理人的股东控制的公司

注：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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010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	798,605,012.58	3.22%	851,529,798.67	1.35%

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 2011年1月1日至2011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	678,805.08	3.29%	281,620.62	2.00%
关联方名称	上年度可比期间 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	723,797.21	1.37%	-	-

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和经手费的净额列示。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。

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	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	52,532,816.03	97,137,243.10
其中：支付销售机构的客户维护费	7,786,521.40	10,847,308.88

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 1.5% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,755,469.42	16,189,540.42

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 0.25%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数。}$$

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

单位：人民币元

本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 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
中国建设银行	-	-	194,000,000.00	249,237.77	-	-
上年度可比期间 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
中国建设银行	98,353,304.11	-	-	-	-	-

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
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	403,290.93	403,290.93
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	403,290.93	403,290.93
期末持有的基金份额	0.04%	0.03%

占基金总份额比例		
----------	--	--

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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2010 年 1 月 1 日至 2010 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	523,552,352.77	4,388,335.02	277,720,802.33	6,053,675.81

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无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

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（2011 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

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
002051	中工国际	2011 年 12 月 8 日	重大资产重组	25.17	2012 年 3 月 19 日	30.00	7,590,763	187,732,159.66	191,059,504.71	-
002214	大立科技	2011 年 11 月 10 日	重大资产重组	37.90	2012 年 2 月 29 日	34.11	419,840	19,288,145.33	15,911,936.00	-

注：本基金截至 2011 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。

7.4.9.3 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，因此没有在银行间市场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，因此没有在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

(i) 金融工具公允价值计量的方法

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)。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 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 1,965,991,797.83 元，属于第二层级的余额为 303,701,440.71 元，无属于第三层级的余额(2010 年 12 月 31 日：第一层级 4,169,031,892.93 元，第二层级 360,959,437.40 元，无第三层级)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公

允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层级或第三层级。

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金未持有公允价值归属于第三层级的金融工具(2010年12月31日：同)。本基金本期净转入/(转出)第三层级零元，计入损益的第三层级金融工具公允价值变动零元(2010年度：无)，涉及河南双汇投资发展股份有限公司(“双汇发展”)发行的股票。

(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	2,172,963,238.54	72.30
	其中：股票	2,172,963,238.54	72.30
2	固定收益投资	96,730,000.00	3.22
	其中：债券	96,730,000.00	3.22
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	201,500,502.25	6.70
	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	528,024,485.04	17.57
6	其他各项资产	6,290,087.80	0.21
7	合计	3,005,508,313.63	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	110,718,329.28	3.77
C	制造业	790,783,088.60	26.93
C0	食品、饮料	559,781,094.34	19.06
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	49,377,858.44	1.68
C6	金属、非金属	60,557,375.39	2.06
C7	机械、设备、仪表	103,262,898.09	3.52
C8	医药、生物制品	17,803,862.34	0.61
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	69,782,891.25	2.38
F	交通运输、仓储业	15,756,781.12	0.54
G	信息技术业	57,765,591.00	1.97
H	批发和零售贸易	128,834,554.02	4.39
I	金融、保险业	254,256,320.30	8.66
J	房地产业	237,376,653.32	8.08
K	社会服务业	360,645,815.85	12.28
L	传播与文化产业	147,043,213.80	5.01
M	综合类	-	-
	合计	2,172,963,238.54	73.99

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	002051	中工国际	7,590,763	191,059,504.71	6.51
2	000895	双汇发展	2,618,442	183,160,017.90	6.24
3	600036	招商银行	10,999,690	130,566,320.30	4.45
4	600809	山西汾酒	2,000,221	126,293,953.94	4.30
5	600016	民生银行	21,000,000	123,690,000.00	4.21
6	300058	蓝色光标	3,955,446	119,850,013.80	4.08
7	600519	贵州茅台	550,611	106,433,106.30	3.62
8	000069	华侨城 A	12,500,256	89,251,827.84	3.04
9	600048	保利地产	8,000,000	80,000,000.00	2.72
10	300144	宋城股份	2,999,861	75,896,483.30	2.58

注：1、中工国际于 2011 年 12 月 8 日开始停牌，本公司与托管银行协商一致，决定于 2011 年 12 月 16 日起对本基金所持有的“中工国际”（股票代码 002051）采用“指数收益法”进行估值，并采用中证协 SAC 行业指数作为计算依据。该股票于 2012 年 3 月 19 日复牌，按收盘价估值。

2、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	600123	兰花科创	292,802,165.39	6.20
2	600048	保利地产	283,848,168.19	6.01
3	600585	海螺水泥	270,828,164.73	5.74
4	601699	潞安环能	266,298,784.70	5.64
5	600016	民生银行	238,661,472.67	5.06
6	600031	三一重工	218,382,077.32	4.63
7	000858	五粮液	194,674,869.33	4.13
8	000937	冀中能源	179,299,651.95	3.80
9	600036	招商银行	175,217,784.38	3.71
10	600208	新湖中宝	172,846,485.82	3.66
11	601088	中国神华	165,022,077.84	3.50
12	000895	双汇发展	160,733,070.80	3.41
13	600518	康美药业	159,064,413.63	3.37
14	002013	中航精机	158,262,703.31	3.35
15	600000	浦发银行	154,723,597.91	3.28
16	600354	敦煌种业	153,126,070.85	3.24
17	000656	金科股份	148,642,747.11	3.15
18	000028	一致药业	145,666,274.11	3.09
19	600547	山东黄金	136,307,770.05	2.89
20	600809	山西汾酒	132,818,226.30	2.81
21	600489	中金黄金	129,911,030.70	2.75
22	600188	兖州煤业	129,032,257.23	2.73
23	000157	中联重科	126,174,998.37	2.67
24	002081	金螳螂	125,491,923.37	2.66
25	000002	万科A	121,242,647.44	2.57
26	000024	招商地产	117,708,211.63	2.49
27	000998	隆平高科	115,549,250.70	2.45
28	000983	西山煤电	113,846,978.01	2.41
29	000423	东阿阿胶	109,264,289.52	2.32
30	000069	华侨城A	107,501,547.17	2.28
31	600383	金地集团	105,683,101.50	2.24

32	000568	泸州老窖	101,469,575.48	2.15
33	600582	天地科技	100,365,781.16	2.13
34	002375	亚厦股份	99,364,113.29	2.11
35	000630	铜陵有色	98,719,130.44	2.09
36	300058	蓝色光标	97,061,949.07	2.06
37	000880	潍柴重机	96,968,570.82	2.05
38	600362	江西铜业	94,409,467.89	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	600585	海螺水泥	346,138,763.98	7.33
2	601699	潞安环能	341,260,321.50	7.23
3	600690	青岛海尔	287,077,691.96	6.08
4	600048	保利地产	280,943,070.03	5.95
5	000937	冀中能源	264,579,321.53	5.61
6	600123	兰花科创	246,636,540.57	5.23
7	600208	新湖中宝	220,922,789.63	4.68
8	000650	仁和药业	199,700,153.06	4.23
9	600031	三一重工	193,544,150.85	4.10
10	601318	中国平安	184,151,322.57	3.90
11	002304	洋河股份	168,509,175.68	3.57
12	600383	金地集团	163,178,412.74	3.46
13	000002	万科A	159,270,221.89	3.37
14	600354	敦煌种业	157,301,114.71	3.33
15	000887	中鼎股份	149,511,275.79	3.17
16	002161	远望谷	148,713,490.27	3.15
17	600276	恒瑞医药	148,429,676.17	3.15
18	000423	东阿阿胶	143,751,148.97	3.05
19	002081	金螳螂	143,549,193.10	3.04
20	000656	金科股份	143,155,749.70	3.03
21	000630	铜陵有色	141,978,505.02	3.01
22	600362	江西铜业	140,247,562.27	2.97
23	600000	浦发银行	137,315,999.45	2.91
24	600518	康美药业	131,862,265.51	2.79
25	600489	中金黄金	131,605,464.08	2.79

26	600547	山东黄金	130,572,236.87	2.77
27	000858	五粮液	127,669,764.67	2.71
28	000157	中联重科	125,982,727.40	2.67
29	601088	中国神华	125,426,675.11	2.66
30	600188	兖州煤业	123,336,270.81	2.61
31	600519	贵州茅台	121,820,277.60	2.58
32	002375	亚厦股份	118,120,065.17	2.50
33	600016	民生银行	115,521,548.66	2.45
34	002146	荣盛发展	115,122,920.65	2.44
35	000998	隆平高科	113,974,956.94	2.42
36	000983	西山煤电	111,278,641.80	2.36
37	002230	科大讯飞	110,723,593.94	2.35
38	600079	人福医药	110,658,485.12	2.34
39	000568	泸州老窖	110,157,234.15	2.33
40	601299	中国北车	109,674,074.37	2.32
41	000028	一致药业	108,396,261.14	2.30
42	002436	兴森科技	105,648,255.84	2.24
43	600537	亿晶光电	103,772,710.98	2.20
44	600068	葛洲坝	102,237,114.25	2.17
45	000880	潍柴重机	101,957,656.52	2.16
46	601989	中国重工	101,081,993.60	2.14
47	000401	冀东水泥	99,787,558.01	2.11
48	600050	中国联通	94,312,284.83	2.00

注：1. 卖出金额不包括相关交易费用。

2. 自 2012 年 1 月 4 日起,000028 证券名称发生变更, A 股简称由“一致药业”变更为“国药一致”。

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	11,789,267,273.32
卖出股票收入（成交）总额	13,017,423,644.16

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	96,730,000.00	3.29
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	96,730,000.00	3.29

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	1101028	11 央行票据 28	1,000,000	96,730,000.00	3.29

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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稳定分红的股票，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	3,332,388.64

2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,548,789.75
5	应收申购款	408,909.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,290,087.80

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002051	中工国际	191,059,504.71	6.51	重大资产重组

§ 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
81,806	14,073.93	177,864,419.88	15.45%	973,467,171.83	84.55%

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	311,221.94	0.0270%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年6月15日)基金份额总额	2,339,809,854.34
本报告期期初基金份额总额	1,454,097,261.63
本报告期基金总申购份额	100,256,497.59
减:本报告期基金总赎回份额	403,022,167.51
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,151,331,591.71

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、本基金管理人于 2011 年 4 月 9 日发布公告，聘任谢文杰先生为公司副总经理，其任职资格已经过中国证监会审核批准。

2、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。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。本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知，聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

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 106,000.00 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（2006 年 6 月 15 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	
上海证券	1	4,365,087,092.72	17.61%	3,710,315.80	17.99%	-
国金证券	1	3,728,446,823.76	15.04%	3,029,390.75	14.69%	-
红塔证券	1	2,916,840,921.81	11.77%	2,479,304.66	12.02%	-
安信证券	2	2,748,145,475.86	11.09%	2,233,927.47	10.83%	-
银河证券	1	2,336,836,033.83	9.43%	1,898,692.32	9.21%	-
光大证券	1	2,233,511,999.81	9.01%	1,814,744.39	8.80%	-
国信证券	1	1,684,069,157.99	6.79%	1,431,456.77	6.94%	-
申银万国	1	1,440,403,611.25	5.81%	1,224,335.68	5.94%	-
国都证券	1	856,466,769.18	3.46%	727,999.01	3.53%	-
华宝证券	1	798,605,012.58	3.22%	678,805.08	3.29%	-
瑞银证券	1	701,676,492.23	2.83%	570,115.49	2.76%	-
东方证券	1	411,204,413.20	1.66%	349,523.23	1.69%	-
广发证券	1	218,410,892.62	0.88%	185,647.48	0.90%	-
中信建投	1	143,441,143.59	0.58%	116,546.39	0.57%	-
中信证券	1	109,883,915.24	0.44%	93,400.79	0.45%	-
中投证券	1	91,161,161.81	0.37%	77,485.93	0.38%	-
华泰证券	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必要，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、本基金本报告期券商交易单元新增：瑞银证券。

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		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
上海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	2,308,930.00	100.00%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2011 年 10 月 28 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。 2、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

华宝兴业基金管理有限公司
2012 年 3 月 29 日