

---

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

2009 年年度报告

2009 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：二〇一〇年三月二十九日

---

## §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 2010 年 3 月 28 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。

本报告财务资料已经审计。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止。

---

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	7
§4 管理人报告.....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6 审计报告.....	13
6.1 管理层对财务报表的责任.....	14
6.2 注册会计师的责任.....	14
6.3 审计意见.....	14
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告.....	37
8.1 期末基金资产组合情况.....	37
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	37
8.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	37
8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	38
8.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	42
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债券投资明细.....	42
8.8 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.....	42
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	42

---

8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细 .....	42
8.11 投资组合报告附注 .....	42
§9 基金份额持有人信息 .....	43
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	43
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 .....	43
§10 开放式基金份额变动 .....	43
§11 重大事件揭示 .....	43
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
11.4 基金投资策略的改变 .....	43
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
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 .....	44
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
§13 备查文件目录 .....	48

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金
基金简称	华宝兴业海外中国股票（QDII）
基金主代码	241001
交易代码	241001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年5月7日
基金管理人	华宝兴业基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	124,063,573.06份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	主要投资于海外上市的中国公司的股票，在全球资本市场分享中国经济增长，追求资本长期增值。
投资策略	本基金将结合宏观经济环境、政策形势、证券市场走势的综合分析，主动判断市场时机，进行积极的资产配置，合理确定基金在股票、债券等各类资产类别上的投资比例，以最大限度地降低投资组合的风险、提高收益。本基金各类资产配置的比例范围为：股票占基金资产总值的60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的5%-40%。
业绩比较基准	MSCI china free 指数(以人民币计算)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，在证券投资基金中属于风险和收益水平都较高的品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华宝兴业基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	刘月华
	联系电话	021-38505888
	电子邮箱	xxpl@fsfund.com
客户服务电话	400-700-5588、021-38924558	010—67595096
传真	021-38505777	010—66275853
注册地址	上海浦东世纪大道88号金茂大厦48F	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海浦东世纪大道88号金茂大厦48F	北京市西城区闹市口大街一号院一号楼
邮政编码	200121	100033
法定代表人	郑安国	郭树清

### 2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人

名称	英文	Société Générale Asset Management (Japan) Co., Ltd.	The Bank of New York Mellon Corporation
	中文	法国兴业银行资产管理（日本）有限公司	纽约梅隆银行股份有限公司
注册地址		5-1, Nihonbashi, Kabuto-cho, Chuo-ku, Tokyo	One Wall Street New York, NY10286
办公地址		5-1, Nihonbashi, Kabuto-cho, Chuo-ku, Tokyo	One Wall Street New York, NY10286
邮政编码		103-0026	NY10286

注:基金管理人自 2010 年 3 月 1 日起解除与法兴资产管理（日本）有限公司（Societe Generale Asset Management (Japan) Co., Ltd）签署的投资顾问协议，自该日起法兴资产管理（日本）有限公司不再担任本基金的投资顾问。

## 2.5 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。

## 2.6 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责任公司	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	基金管理人	上海市世纪大道88号金茂大厦48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	2009 年	2008 年 5 月 7 日至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	14,629,404.38	-71,617,685.90
本期利润	69,875,472.63	-97,288,201.92
加权平均基金份额本期利润	0.412	-0.290
本期加权平均净值利润率	45.23%	-33.37%
本期基金份额净值增长率	54.08%	-26.40%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年末	2008 年 5 月 7 日
期末可供分配利润	-22,581,902.60	-52,675,147.20
期末可供分配基金份额利润	-0.182	-0.284
期末基金资产净值	140,740,445.93	136,370,359.31
期末基金份额净值	1.134	0.736

3.1.3 累计期末指标	2009 年末	2008 年 5 月 7 日
基金份额累计净值增长率	13.40%	-26.40%

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、本基金成立于 2008 年 5 月 7 日，T-1 年度比较期间不完整，没有 T-2 年度比较期间，特此说明。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

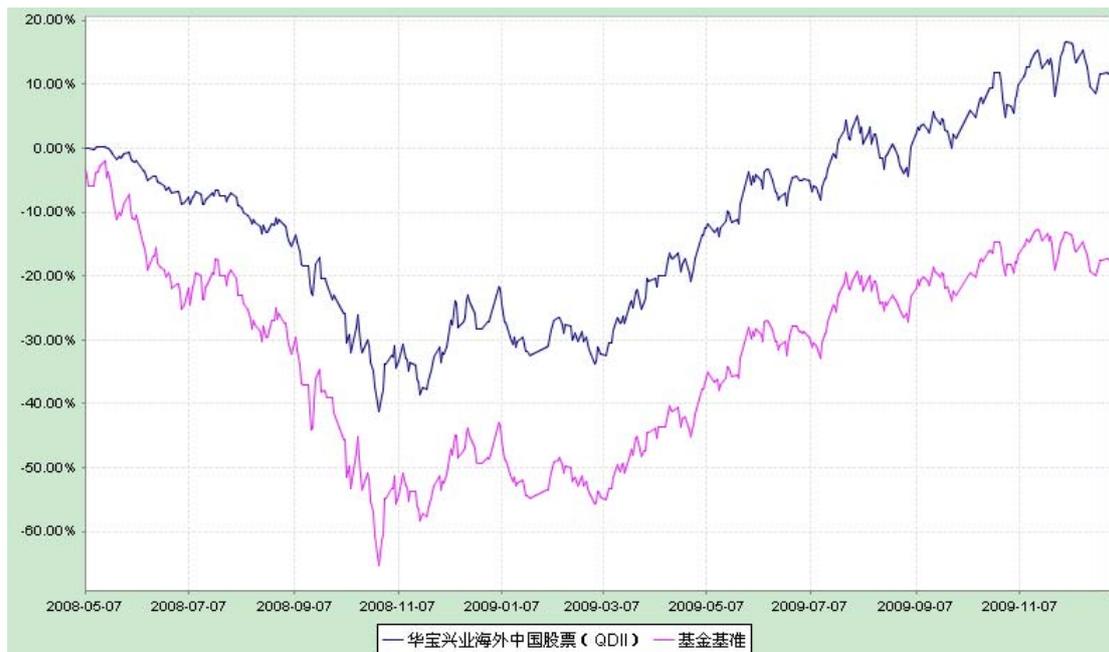
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	11.72%	1.43%	9.36%	1.54%	2.36%	-0.11%
过去六个月	19.37%	1.43%	17.92%	1.65%	1.45%	-0.22%
过去一年	54.08%	1.67%	61.57%	2.20%	-7.49%	-0.53%
自基金成立起至今	13.40%	1.84%	-15.89%	2.98%	29.29%	-1.14%

#### 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

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2008 年 5 月 7 日至 2009 年 12 月 31 日）

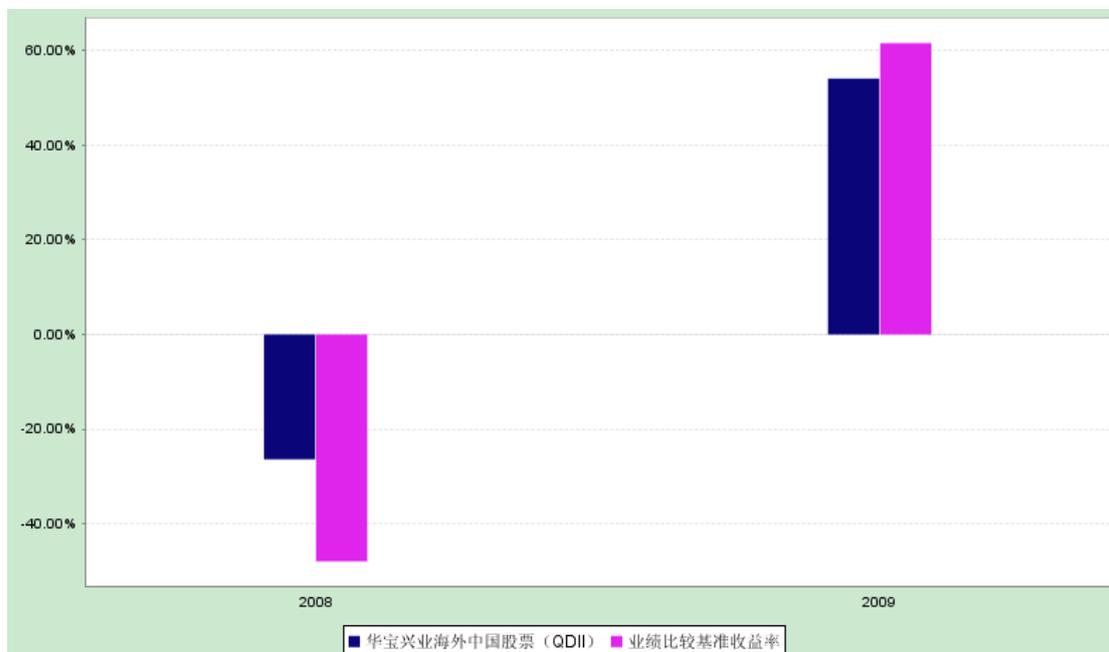


注：按照基金合同的约定，自基金合同生效之日起不超过 6 个月内完成建仓，截至 2008 年 11 月 6 日，本基金已经达到基金合同规定的资产配置比例。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

本基金本报告期末可供分配基金份额利润为人民币-0.182 元，本报告期末进行利润分配。

## §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（2009 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、增强收益基金以及中证 100 基金，所管理的开放式证券投资基金资产净值合计 61,954,458,087.07 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
周欣	本基金基金经理，海外投资管理部总经理	2009-12-31	-	10 年	北京大学经济学硕士、耶鲁大学商学院工商管理硕士，证券从业经历 10 年，曾在德意志银行亚洲证券、法国巴黎银行亚洲证券、东方证券资产管理部从事证券研究投资工作。2009 年 12 月加入华宝兴业基金管理有限公司，任海外投资管理部总经理。2009 年 12 月至今兼任华宝兴业海外中国股票（QDII）基金基金经理。
Gabriel GONDARD	本基金基金经理，公司投资副总监	2008-05-07	2009-12-31	8 年	法国国籍。毕业于巴黎高等商学院，获资产管理学硕士学位。曾在法国兴业资产管理公司从事投资管理工作，2006 年 1 月加入本公司，担任公司投资副总监。2008 年 5 月至 2009 年 12 月兼任华宝兴业海外中国股票（QDII）基金基金经理。
雷勇	本基金基金经理，公司海外投资管理部总经理	2008-05-07	2009-08-15	12 年	美国国籍。毕业于芝加哥大学，获工商管理硕士学位。曾在美林亚特兰大、美林芝加哥、美国 APE 咨询交易服务公司从事理财规划、股票分析、资产组合分析等工作。2005 年 4 月加入本公司，2005 年 7 月至 2007 年 9 月任公司研究部总经理和金融工程部总经理，2007 年 9

					月至 2009 年 8 月任海外投资管理部总经理。2008 年 5 月至 2009 年 8 月兼任华宝兴业海外中国股票 (QDII) 基金基金经理。
尤柏年	本基金基金经理助理	2009-03-20	-	6 年	博士, 曾在澳大利亚 BConnect 公司 Apex 投资咨询团队从事投资、金融工程模型开发、资产配置、行业研究等工作。2007 年 6 月加入本公司任金融工程部高级数量分析师, 2008 年 8 月起任海外投资部高级分析师, 2009 年 3 月至今任华宝兴业海外中国股票 (QDII) 基金基金经理助理兼任高级分析师。

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 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Marco Wong	亚太区策略主管	22 年	1986 年加入法兴资产。之前在东京担任分析师和日本股票及可转债组合经理。1989 年拓展到亚太区。1996 年至 2004 年担任亚洲 (除日本) 策略投资总监。2005 年至 2006 年在东京担任太平洋地区总监。2007 年至新加坡担任亚太区策略主管。Wong 拥有香港大学荣誉社会科学学士学位, 并是 CFA 注册会员。
Winson Fong	大中华区策略主管	22 年	1986 年加入法兴资产, 随后成为日本股票组合基金经理, 为海外机构客户提供服务。1990 年, 覆盖区域拓展到太平洋地区。在法兴日本和法兴香港时, 派往新加坡担任大中华区专业人员。2004 年至 2006 年, 提任为亚洲 (除日本) 主管, 2007 年初, 任命为大中华区股票主管, 并派往香港工作。Mr Fong 拥有香港大学工商管理学士学位, 并是 CFA 注册会员。

---

### 4.3 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》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》及其各项实施细则、《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋取最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

由于换汇导致华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金在短期内出现过现金及一年内到期债券比例略低于 5% 的情况。发生此类情况后，基金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。

### 4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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。

#### 4.4.3 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。

### 4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

中国政府积极宽松的货币政策和 4 万亿人民币的财政刺激方案使海外中国股票市场在 2009 年上半年强劲反弹。由于美国及欧洲的金融体系持续脆弱和宏观经济数据低迷，在 1 月和 2 月时市场投资信心疲弱。可是，美国政府的救市方案 PPIF（公共与私人投资基金）和运用联邦储备的“超常规措施”（即发行货币）逐步恢复了投资者的信心。在第一季度，中国公布了更多令人鼓舞的数据，如采购经理人指数和消费物价指数。更重要的因素是以 2-3 倍速度增长的新增贷款为急需流动资金的中小型企业提供了协助。在此背景下，信用风险明显下降，股市终于在 6 月底提交了卓越的成绩表，摩根士丹利中国指数大幅上扬了 37.6%。在下半年，更多的数据证明经济处于全面复苏阶段。汽车和房屋销售强劲增长，成为拉动其他行业需求的原动力。摩根士丹利中国指数在第三和第四季度分别上升 7.3% 和 9.3%

---

%。

总之，在 2009 年固定资产投资和消费持续成为 GDP 增长的主要动力。信贷强劲增长，导致 12 月的货币供应增速极高，其中 M1 和 M2 分别上涨了 32% 和 27%。出口也出现反弹，12 月同比增长了 17.7%，时间比经济学家预测的 2010 年第一季度提早了。消费物价指数和采购经理人指数的数据随着经济复苏而略微上升，但现阶段的通货膨胀压力依然微弱。政府还延长了各项购买汽车和家电的优惠政策。

回顾市场各行业板块的表现，信息技术获得最好的表现，上升了 233%。可选性消费品排第二，上涨了 149%。日常消费品和原材料分别获得 84% 和 114% 涨幅。能源和金融也有 72-76% 的回报。与此同时，医疗保健和工业上涨幅度落后于大市，而电信和公用事业持平。房地产在上半年表现非常出色，但在下半年却表现落后。

本基金在 2009 年年初时采取非积极的资产配置策略，以 80-10-10 的比例投资于股票、债券和现金。我们在第三季卖出 2 年期美国国债，规避美元贬值风险。把债券投资转移至股票投资，使股票配置的比例增至 90%。在第三季度，我们的组合超配消费品、互联网、低估值香港金融与地产股，低配 H 股银行、保险、交通运输与电信行业。在第四季度，我们继续超配可选消费品和低配电信业。这些行业配置策略和个股的选择成效良好，提高了组合的收益。

#### **4.5.2 报告期内基金的业绩表现**

截至本报告期末，本基金单位净值为 1.134 元，累积净值增长率为 54.08%，而同期比较基准的累积收益率为 61.57%。本基金出于控制风险的角度，在上半年配置了 10% 的债券品种及 10% 的港币和人民币现金，造成了全年收益率与基准相比有 7.49% 的差异。

#### **4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望**

经历了 9-10 个月的牛市，我们预计在今后几个月股市将有健康的盘整。中国经济在 2009 年成功保持了 8% 的 GDP 增长，可是贷款增长和房地产市场却出现了过热的现象。我们预计一系列行政调控措施和上调准备金率有助于冷却信贷过快增长和房地产市场过热。中国人民银行已宣布 2010 年新增贷款目标为人民币 7.5 万亿，这意味着 19% 的贷款增长率。这清楚地显示了整体货币政策和信贷环境仍然宽松。对外贸易继续改善，12 月出口强劲增长出乎市场意料之外。我们对 2010 年中国经济前景持谨慎乐观的态度。

上市公司 2010 年的盈利前景良好，预期还有上升空间。然而，目前 13-14 倍的 2010 年预期市盈率估值也处在比较合理的水平。从历史经验来看，投资者在年初时投资比较谨慎，我们预计市场在第一季度会获利回吐和消化一些负面因素，如上调准备金率和欧元区不稳定

---

的经济形势。因此，我们目前计划保持一定比例的现金水平和灵活的股票资产配置，应对可能的市场波动。2009 年我们偏重的信息技术和消费板块获得丰厚的回报，我们在新的一年里将关注此类股票高估值的风险，并积极寻找其他低估值的投资机会。对于工业板块，我们维持选择性的投资。我们认为机械类的股票目前已在合理的估值水平，而交通运输行业可能提供的投资机会更多。在美元走强的情况下，原材料类股在第四季度表现不佳。然而在当前的市盈率水平下某些金属类股开始具有吸引力。我们将关注受惠于出口持续改善的周期性股票，如交通运输和原材料。与此同时，我们也看好受益于通胀预期上升的农产品类股。总之，我们将在下一个季度适当地调整组合的结构，监控市场下行风险，追求新的超额收益。

#### **4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

公司自 2003 年 3 月成立以来始终注重合规性和业务风险控制。加强对基金运作的内部操作风险控制、保障基金份额持有人的利益始终是公司制定各项内部制度、流程的指导思想。公司监察稽核部门对公司遵守各项法规和管理制度及公司所管理的各基金履行合同义务的情况进行核查，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向监管部门、公司管理层及上级公司出具相关报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

（一）规范员工行为操守，加强职业道德教育和风险教育。公司通过对新员工集中组织岗前培训、签署《个人声明书》等形式，明确员工的行为准则，防范道德风险。

（二）完善公司制度体系。公司一方面坚持制度的刚性，不轻易改变、简化已确立的流程。要求从一般员工、部门经理到业务总监，每个人都必须清楚自己的权力和职责，承担相应责任。另一方面，伴随市场变革和产品创新，公司的业务和管理方式也发生着变化。在长期的业务实践中，公司借鉴和吸收海外股东、国内同行经验，在符合公司基本制度的前提下，根据业务的发展不时调整。允许各级员工在职责范围内设计和调整自己的业务流程，涉及其它部门或领域的，由相应级别的负责人在符合公司已有制度的基础上协调和批准。公司根据业务情况调整和细化了市场、营运、投资研究各方面的分工和业务规则，并根据内部控制委员会和监察稽核部门提出的意见、建议调整或改善了前、中、后台的业务流程。

（三）全面开展内部审计工作。2009 年，监察稽核部门按计划对公司营运、投资、市场部门进行了业务审计，并与相关部门进行沟通，形成后续跟踪和业务上相互促进的良性循环，不断提高工作质量。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，完善内控制度，提高工作水平，努力防范和控制各种风险，保障基金份额持有人的合法权益。

---

#### 4.8 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制定估值政策制定、估值模型及估值方法的确定工作。

#### 4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

### §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

普华永道中天审字(2010)第 20316 号

---

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金(以下简称“华宝兴业海外中国成长基金”)的财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表、2009 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是华宝兴业海外中国成长基金的基金管理人华宝兴业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。

### 6.2 注册会计师的责任

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。

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。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会允许的如财务报表附注所列示的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了华宝兴业海外中国成长基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限责任公司

注册会计师 马颖 施张鸿

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

报告截止日：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	12,700,130.48	24,837,619.30
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	129,092,369.44	117,456,386.82
其中：股票投资		129,092,369.44	99,827,642.77
基金投资		-	-
债券投资		-	17,628,744.05
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	43,932.57
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		121,369.51	-
应收利息	7.4.7.5	517.27	940.66
应收股利		48,607.17	44,975.29
应收申购款		79,768.98	43,199.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	41,423.98
资产总计		142,042,762.85	142,468,478.04
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2009年12月31日</b>	<b>上年度末 2008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		-	5,614,313.95
应付赎回款		937,120.40	179,185.68
应付管理人报酬		218,792.63	204,232.07
应付托管费		42,543.02	39,711.77

应付销售服务费		-	-
应付交易费用		-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	103,860.87	60,675.26
负债合计		1,302,316.92	6,098,118.73
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.8	124,063,573.06	185,308,217.36
未分配利润	7.4.7.9	16,676,872.87	-48,937,858.05
所有者权益合计		140,740,445.93	136,370,359.31
负债和所有者权益总计		142,042,762.85	142,468,478.04

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.134 元，基金份额总额 124,063,573.06

份。

## 7.2 利润表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 1 月 1 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日至2009年1 2月31日	上年度可比期间 2008年5月7日至2008年12 月31日
<b>一、收入</b>		<b>74,757,626.85</b>	<b>-91,712,840.21</b>
1. 利息收入	7.4.7.10	199,750.09	1,101,462.65
其中：存款利息收入		36,726.44	496,157.79
债券利息收入		163,023.65	605,304.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,245,399.02	-65,138,727.00
其中：股票投资收益	7.4.7.11	16,131,857.57	-64,677,215.34
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.12	-31,286.80	-3,022,123.82
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	44,245.20	74,314.60
股利收益	7.4.7.15	3,100,583.05	2,486,297.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	55,246,068.25	-25,670,516.02
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-108,383.09	-2,293,886.76

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	174,792.58	288,826.92
<b>减：二、费用</b>		<b>4,882,154.22</b>	<b>5,575,361.71</b>
1. 管理人报酬		2,771,393.12	3,381,063.79
2. 托管费		538,882.01	657,429.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	1,229,749.49	1,237,927.90
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	342,129.60	298,941.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>69,875,472.63</b>	<b>-97,288,201.92</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>69,875,472.63</b>	<b>-97,288,201.92</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金

本报告期：2009年1月1日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）	185,308,217.36	-48,937,858.05	136,370,359.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	69,875,472.63	69,875,472.63
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）	-61,244,644.30	-4,260,741.71	-65,505,386.01
其中：1. 基金申购款	91,108,200.75	-16,957,503.05	74,150,697.70
2. 基金赎回款	-152,352,845.05	12,696,761.34	-139,656,083.71
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）	124,063,573.06	16,676,872.87	140,740,445.93
项目	上年度可比期间 2008年5月7日至2008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）	462,709,489.02	-	462,709,489.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-97,288,201.92	-97,288,201.92
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）	-277,401,271.66	48,350,343.87	-229,050,927.79

其中：1. 基金申购款	2,734,161.48	-728,216.16	2,005,945.32
2. 基金赎回款	-280,135,433.14	49,078,560.03	-231,056,873.11
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)	185,308,217.36	-48,937,858.05	136,370,359.31

报告附注为财务报表的组成部分

本报告附注从 7.1 至 7.4 的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：向辉

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]第 333 号《关于同意华宝兴业海外中国成长股票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《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 462,646,980.69 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 052 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 5 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 462,709,489.02 份基金份额，其中认购资金利息折合 62,508.33 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，境外资产托管人为纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)，境外投资顾问为法国兴业银行资产管理(日本)有限公司(Société Générale Asset Management (Japan) Co., Ltd.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为股票、固定收益证券、银行存款和法律法规允许的其他投资工具，其中股票投资范围包括香港证交所上市的所有股票和在新加坡、美国上市的中国公司，中国公司指收入的 50%以上来源于中国大陆的公司；固定收益证券投资范围为具有标准普尔评级为“A”以上或同等评级的发行人在中国证监会认可的中国大陆以外市场(包括香港、新加坡、美国)发行的固定收益证券，在流动性充足的情况下，主要投资香港债券市场。在正常市场情况下，本

---

基金各类资产配置的比例范围是：股票占基金资产总值的 60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的 5%-40%。本基金的业绩比较基准为：MSCI China Free 指数(以人民币计算)。

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 2010 年 3 月 24 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》、《华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 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 2009 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 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 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。比较财务报表的实际编制期间为 2008 年 5 月 7 日(基金合同生效日)至 2008 年 12 月 31 日。

##### **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。本基金目前暂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；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，应当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。

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，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。

#### **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**

股票投资和债券投资在持有期间应取得的现金股利和利息扣除适用的境外及境内代扣代缴所得税后，确认为投资收益。

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 外币交易**

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币, 所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目, 于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币, 与所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### **7.4.4.13 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。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### **7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

计量属性

本基金除特别说明对金融资产和金融负债采用公允价值等作为计量属性之外, 一般采用历史成本计量。

### **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**

分部报告

于 2009 年 1 月 1 日以前, 本基金区分业务分部和地区分部披露分部信息, 以业务分部为主要报告形式, 以地区分部为次要报告形式。

根据财政部于 2009 年 6 月 11 日颁布的《企业会计准则解释第 3 号》中有关企业改进报告分部信息的规定, 自 2009 年 1 月 1 日起, 本基金不再以区分地区分部和业务分部作为主

要报告形式、次要报告形式披露分部信息，而是改按内部组织结构、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。

2008 年度分部信息已经按照上述规定进行重新列报。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关境内外税务法规和实务操作，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) 目前基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。

(3) 目前基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

#### 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 2009 年 12 月 31 日	上年度末 2008 年 12 月 31 日
活期存款	12,700,130.48	24,837,619.30
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	12,700,130.48	24,837,619.30

注：于 2009 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 846,443.93 元，港元活期存款 13,459,892.45 元(折合人民币 11,852,305.75 元)和美元活期存款 202.22 元(折合人民币 1,380.80 元)。

于 2008 年 12 月 31 日，活期存款包括人民币活期存款 3,860,490.87 元，港元活期存款 23,785,573.31 元(折合人民币 20,975,746.34 元)和美元活期存款 202.22 元(折合人民币 1,382.09 元)。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	99,516,817.21	129,092,369.44	29,575,552.23
债券交易所市场	-	-	-
债券银行间市场	-	-	-
债券合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	99,516,817.21	129,092,369.44	29,575,552.23
项目	上年度末 2008年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	125,533,077.97	99,827,642.77	-25,705,435.20
债券交易所市场	-	-	-
债券银行间市场	17,637,757.44	17,628,744.05	-9,013.39
债券合计	17,637,757.44	17,628,744.05	-9,013.39
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	143,170,835.41	117,456,386.82	-25,714,448.59

注：银行间市场指香港场外交易市场。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2008年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	43,932.57	-	-
权证	-	43,932.57	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	43,932.57	-	-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应收活期存款利息	517.27	940.66
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	-	-
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	-	-
合计	517.27	940.66

##### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	41,423.98
合计	-	41,423.98

##### 7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,531.75	675.26
预提费用	100,329.12	60,000.00
合计	103,860.87	60,675.26

##### 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	185,308,217.36	185,308,217.36
本期申购	91,108,200.75	91,108,200.75
本期赎回（以“-”号填列）	-152,352,845.05	-152,352,845.05
本期末	124,063,573.06	124,063,573.06

#### 7.4.7.9 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	-52,675,147.20	3,737,289.15	-48,937,858.05
本期利润	14,629,404.38	55,246,068.25	69,875,472.63
本期基金份额交易产生的变动数	15,463,840.22	-19,724,581.93	-4,260,741.71
其中：基金申购款	-27,945,888.67	10,988,385.62	-16,957,503.05
基金赎回款	43,409,728.89	-30,712,967.55	12,696,761.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,581,902.60	39,258,775.47	16,676,872.87

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
活期存款利息收入	36,205.03	496,142.39
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	-	-
其他	521.41	15.40
合计	36,726.44	496,157.79

#### 7.4.7.11 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	210,683,346.73	101,144,922.80
减：卖出股票成本总额	194,551,489.16	165,822,138.14
买卖股票差价收入	16,131,857.57	-64,677,215.34

#### 7.4.7.12 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,741,165.10	286,529,112.44
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	31,629,718.18	287,765,194.20
减：应收利息总额	142,733.72	1,786,042.06
债券投资收益	-31,286.80	-3,022,123.82

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内及上报告期均未产生基金投资收益。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
卖出权证成交总额	44,245.20	74,314.60
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	44,245.20	74,314.60

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,100,583.05	2,486,297.56
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,100,583.05	2,486,297.56

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
1. 交易性金融资产	55,290,000.82	-25,714,448.59
——股票投资	55,280,987.43	-25,705,435.20
——债券投资	9,013.39	-9,013.39
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-43,932.57	43,932.57
——权证投资	-43,932.57	43,932.57
3. 其他	-	-
合计	55,246,068.25	-25,670,516.02

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日

基金赎回费收入	174,579.37	288,826.92
其他	213.21	-
合计	174,792.58	288,826.92

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年5月7日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	1,229,749.49	1,237,927.90
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,229,749.49	1,237,927.90

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年5月7日至2008年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	281,753.10	238,576.02
账户维护费	240.00	240.00
银行划款手续费	136.50	125.00
合计	342,129.60	298,941.02

#### 7.4.7.20 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。

本基金目前以一个经营分部运作。

#### 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

本基金本报告期内无特别或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金本报告期内无资产负债表日后事项的说明。

#### 7.4.9 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
纽约梅隆银行股份有限公司(The Bank of New York Mellon Corporation)	境外资产托管人
华宝信托有限责任公司(“华宝信托”)	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

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。

#### 7.4.10 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

本基金本报告期内及上年度均未通过关联交易单位进行交易。

##### 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
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,771,393.12	3,381,063.79
其中：应支付给销售机构的客户维护费	308,263.36	219,596.29

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 1.8% 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 1.8% / 当年天数。

###### 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
	2009年1月1日至2009年12月31日	2008年5月7日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	538,882.01	657,429.00

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.35% 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 0.35% / 当年天数。

##### 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

本基金本报告期内及上年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2009年1月1日至2009年 12月31日		上年度可比期间 2008年5月7日至2008年1 2月31日	
	基金合同生效日（2008年5月7日）持有的基金份额	-		4,900,135.42
期初持有的基金份额	4,900,135.42		-	
期间申购/买入总份额	98,569.41		-	
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	4,998,704.83		4,900,135.42	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.03%		2.64%	

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

##### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末以及上年度末除基金管理人外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 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年5月7日至2008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	851,617.73	36,205.03	3,865,637.12	494,761.76
纽约梅隆银行股份有限公司	11,848,512.75	-	20,971,982.18	1,380.63

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人纽约梅隆银行股份有限公司保管，按适用利率或约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内与上报告期均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2009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**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### **7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的证券。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 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，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### **7.4.12.3.2 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，因此没有在债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### **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海外证券的股票型证券投资基金，属于具有较高风险、较高收益的基金品种。本基金投资的金融工具主要包括股票、债券及权证等。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“风险和收益相匹配”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，公司内部监督和反馈系统包括督察长、内部控制委员会、副总经理、内控审计风险管理部、各部门负责人和风险控制联络人、各业务岗位。副总经理总管公司的内控事务。督察长向董事会负责，独立地就内控制度的执行情况履行检查、评价、报告和建议职能。内控审计风险管理部在副总经理指导下对公司内部控制运行情况进行监控，主要针对公司内部控制制度的总体构架和内部控制的目标进行评估并提出改进意见；对各部门和岗位的内部控制执行情况进行监督和核查，同时对内控的失控点进行查漏并责令改正。

本基金的基金管理人根据自身经营特点设立顺序递进、权责统一、严密有效的四层监控防线。第一层监控防线为一线岗位自控与互控；第二层防线为大业务板块内部各部门和部门之间的自控和互控；第三层监控防线为内部内控审计风险管理部对各岗位、各部门、各项业务全面实施的监督反馈；最后是以副总经理领导的内部控制委员会为主体的第四层防线，实施对公司各类业务和风险的总体监督、控制，并对内控审计风险管理部的工作予以直接指导。

---

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法是通过结合定性分析和定量分析方法，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的特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定相应置信程度和风险损失的限度，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，将风险控制可在承受的范围之内。

#### **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。

为了规避信用风险，本公司在交易前对交易对手的资信状况进行充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行以及境外次托管行纽约梅隆银行股份有限公司，与该等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通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险发生的可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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，通过对投资品种的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 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2008 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、组合在短期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。本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净

值的 10%，且本基金的基金管理人管理的全部基金不得持有同一机构 10% 以上具有投票权的证券发行总量。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在场外交易市场交易，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合同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，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2009年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,700,130.48	-	-	-	12,700,130.48
交易性金融资产	-	-	-	129,092,369.44	129,092,369.44
应收证券清算款	-	-	-	121,369.51	121,369.51
应收利息	-	-	-	517.27	517.27
应收股利	-	-	-	48,607.17	48,607.17
应收申购款	13,833.99	-	-	65,934.99	79,768.98
资产总计	12,713,964.47	-	-	129,328,798.38	142,042,762.85
负债					

应付赎回款	-	-	-	937,120.40	937,120.40
应付管理人报酬	-	-	-	218,792.63	218,792.63
应付托管费	-	-	-	42,543.02	42,543.02
其他负债	-	-	-	103,860.87	103,860.87
负债总计	-	-	-	1,302,316.92	1,302,316.92
利率敏感度缺口	12,713,964.47	-	-	128,026,481.46	140,740,445.93
<b>上年度末 2008年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产					
银行存款	24,837,619.30	-	-	-	24,837,619.30
交易性金融资产	17,628,744.05	-	-	99,827,642.77	117,456,386.82
衍生金融资产	-	-	-	43,932.57	43,932.57
应收利息	-	-	-	940.66	940.66
应收股利	-	-	-	44,975.29	44,975.29
应收申购款	298.21	-	-	42,901.21	43,199.42
其他资产	-	-	-	41,423.98	41,423.98
资产总计	42,466,661.56	-	-	100,001,816.48	142,468,478.04
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,614,313.95	5,614,313.95
应付赎回款	-	-	-	179,185.68	179,185.68
应付管理人报酬	-	-	-	204,232.07	204,232.07
应付托管费	-	-	-	39,711.77	39,711.77
其他负债	-	-	-	60,675.26	60,675.26
负债总计	-	-	-	6,098,118.73	6,098,118.73
利率敏感度缺口	42,466,661.56	-	-	93,903,697.75	136,370,359.31

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予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2009 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2008 年 12 月 31 日：持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 12.93%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2008 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇风险敞口进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2009年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
银行存款	1,380.80	11,852,305.75	-	11,853,686.55
交易性金融资产	1,222,787.63	127,869,581.81	-	129,092,369.44
应收证券清算款	-	121,369.51	-	121,369.51
应收股利	-	48,607.17	-	48,607.17
资产合计	1,224,168.43	139,891,864.24	-	141,116,032.67
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	1,224,168.43	139,891,864.24	-	141,116,032.67
项目	上年度末 2008年12月31日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
银行存款	1,382.09	20,975,746.34	-	20,977,128.43
交易性金融资产	1,358,909.85	116,097,476.97	-	117,456,386.82
衍生金融资产	-	43,932.57	-	43,932.57
应收股利	-	44,975.29	-	44,975.29
资产合计	1,360,291.94	137,162,131.17	-	138,522,423.11
应付证券清算款	-	5,614,313.95	-	5,614,313.95
负债合计	-	5,614,313.95	-	5,614,313.95
资产负债表外汇风险敞口净额	1,360,291.94	131,547,817.22	-	132,908,109.16

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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：人民币万元）	
		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
	1. 所有外币相对人民币升值5%	增加约706万元	增加约665万元
2. 所有外币相对人民币贬值5%	减少约706万元	减少约665万元	

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过

对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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占基金资产总值的 60%-95%，债券和其他资产占基金资产总值的 5%-40%。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，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2009年12月31日		上年度末 2008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	129,092,369.44	91.72	99,827,642.77	73.20
衍生金融资产-权证投资	-	-	43,932.57	0.03
其他	-	-	-	-
合计	129,092,369.44	91.72	99,871,575.34	73.23

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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：人民币万元）	
		本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	增加约 493 万元	-
	2. 业绩比较基准下降5%	减少约 493 万元	-

注：于 2008 年 12 月 31 日，若本基金业绩比较基准上升(下降)且其他市场变量保持不变，本基金资产净值将相应增加(减少)。但由于本基金运行期间不足一年，尚不存在足够的经验数据，因此无法对本基金资产净值对于市场价格风险的敏感性作定量分析。

## §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	129,092,369.44	90.88
	其中：普通股	127,869,581.81	90.02
	存托凭证	1,222,787.63	0.86
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	0.00	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	12,700,130.48	8.94
8	其他各项资产	250,262.93	0.18
9	合计	142,042,762.85	100.00

### 8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	1,222,787.63	0.87
香港	127,869,581.81	90.85
合计	129,092,369.44	91.72

### 8.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
10 能源	22,986,788.47	16.33
15 材料	6,009,395.97	4.27
20 工业	10,243,859.77	7.28
25 非必需消费品	16,307,089.07	11.59
30 必需消费品	6,692,819.83	4.76
35 保健	1,003,491.50	0.71
40 金融	45,040,828.27	32.00
45 信息技术	12,371,049.83	8.79
50 电信服务	6,602,126.07	4.69

55 公用事业	1,834,920.66	1.30
合计	129,092,369.44	91.72

注：本基金对以上行业分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	CNOOC LTD	中国海洋石油	883 HK	香港	中国	647,000	6,950,649.16	4.94
2	CHINA PETROLEUM & CH	中国石化	386 HK	香港	中国	1,140,000	6,936,560.13	4.93
3	IND & COMM BK OF CHI	工商银行	1398 HK	香港	中国	1,222,000	6,929,762.17	4.92
4	BANK OF CHINA LTD-H	中国银行	3988 HK	香港	中国	1,857,000	6,867,876.09	4.88
5	CHINA LIFE INSURANCE	中国人寿	2628 HK	香港	中国	198,000	6,686,391.71	4.75
6	CHINA CITIC BANK - H	中信银行	998 HK	香港	中国	1,130,000	6,597,102.45	4.69
7	TENCENT HOLDINGS	腾讯	700 HK	香港	中国	39,400	5,845,980.79	4.15
8	CHINA SHENHUA ENERGY	中国神华	1088 HK	香港	中国	139,500	4,667,873.31	3.32
9	PETROCHINA CL.H	中国石油	857 HK	香港	中国	540,000	4,431,705.87	3.15
10	COMBA TELECOM SYSTEM	京信通信系统	2342 HK	香港	中国	535,700	4,283,203.92	3.04
11	PING AN INSURANCE GP	中国平安	2318 HK	香港	中国	59,500	3,562,764.65	2.53
12	MINTH GROUP LTD	敏实集团	425 HK	香港	中国	322,000	3,243,718.46	2.30
13	CHINA MOBILE LTD	中国移动	941 HK	香港	中国	46,500	2,982,934.83	2.12
14	CHINA YURUN FOOD GRO	中国雨润食品	1068 HK	香港	中国	143,000	2,896,177.20	2.06
15	BANK OF EAST ASIA	东亚银行	23 HK	香港	中国	105,400	2,863,235.27	2.03
16	CHINA RESOURCES LAND	华润置地	1109 HK	香港	中国	180,000	2,795,968.94	1.99
17	Poly Hong Kong	保利香港	119 HK	香港	中国	326,000	2,790,262.88	1.98

	Investment Ltd							
18	Shenzhou International	申洲国际集团	2313 HK	香港	中国	308,000	2,760,957.69	1.96
19	HENGAN INTL	恒安国际	1044 HK	香港	中国	54,000	2,738,908.35	1.95
20	CATHAY PACIFIC A/WAY	国泰航空	293 HK	香港	中国	207,000	2,639,369.32	1.88
21	JIANGXI COPPER IND	江西铜业	358 HK	香港	中国	145,000	2,344,239.26	1.67
22	GEELY AUTOMOBILE	吉利汽车	175 HK	香港	中国	580,000	2,180,806.46	1.55
23	CHINA SHANSHUI CEMENT	中国山水水泥集团有限公司	691 HK	香港	中国	426,000	2,123,182.31	1.51
24	CHINA COMMS SERVI-H	中国通信服务股份	552 HK	香港	中国	594,000	1,998,071.68	1.42
25	HK EXCHANGE & CLEAR	香港交易所	388 HK	香港	中国	15,900	1,951,736.37	1.39
26	GOLDEN EAGLE RETAIL	金鹰商贸集团	3308 HK	香港	中国	134,000	1,869,051.35	1.33
27	GUANGDONG INVEST	粤海投资	270 HK	香港	中国	460,000	1,834,920.66	1.30
28	BEIJING ENTERPRISES	北京控股	392 HK	香港	中国	36,500	1,807,909.34	1.28
29	Citic 1616 Holdings Ltd	中信 1616 集团	1883 HK	香港	中国	700,000	1,621,119.56	1.15
30	DONGFANG ELECTRIC CO	东方电气	1072 HK	香港	中国	43,000	1,575,154.08	1.12
31	IND & COMM BANK	工银亚洲	349 HK	香港	中国	105,000	1,562,562.01	1.11
32	ZIJIN MINING GROUP	紫金矿业	2899 HK	香港	中国	236,000	1,541,974.40	1.10
33	KERRY PROPERTIES LTD	嘉里建设	683 HK	香港	中国	43,000	1,495,639.09	1.06
34	SKYWORTH DIGITAL HDG	创维数码	751 HK	香港	中国	206,000	1,447,542.65	1.03
35	GOME ELECTRICAL APPL	国美电器	493 HK	香港	中国	573,000	1,422,869.23	1.01
36	WEICHAJ POWER CO LTD	潍柴动力	2338 HK	香港	中国	25,000	1,380,285.12	0.98
37	SHUN TAK HOLDINGS	信德集团	242 HK	香港	中国	306,000	1,314,929.61	0.93
38	DENWAY	骏威汽车	203 HK	香港	中国	300,000	1,304,996.84	0.93

	MOTORS							
39	SHANDA GAMES LTD	盛大游戏	GAME US	美国	中国	17,574	1,222,787.63	0.87
40	SINOTRANS SHIPPING LTD	中外运航运	368 HK	香港	中国	367,000	1,163,402.04	0.83
41	TEXWINCA HOLDINGS	德永佳集团	321 HK	香港	中国	176,000	1,123,600.52	0.80
42	XIWANG SUGAR HLDGS	西王糖业	2088 HK	香港	中国	440,000	1,057,734.28	0.75
43	MOBI DEVELOPMENT CO LTD	摩比发展	947 HK	香港	中国	355,000	1,019,077.49	0.72
44	SHANDONG WEIGAO GRP	山东威高	8199 HK	香港	中国	44,000	1,003,491.50	0.71
45	ANTA SPORTS PRODUCTS	安踏体育用品	2020 HK	香港	中国	94,000	953,545.87	0.68
46	CHINA OVERSEAS LAND	中国海外发展	688 HK	香港	中国	64,920	937,526.64	0.67
47	SANY Heavy Equipment	三一重装国际控股	631 HK	香港	中国	42,000	362,810.26	0.26

## 8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHINA EVERBRIGHT LTD	165 HK	4,926,197.77	3.61
2	PETROCHINA CL.H	857 HK	4,818,259.22	3.53
3	DENWAY MOTORS	203 HK	4,687,160.42	3.44
4	BANK OF CHINA LTD-H	3988 HK	4,574,802.90	3.35
5	IND & COMM BK OF CHI	1398 HK	4,445,775.40	3.26
6	CHINA YURUN FOOD GRO	1068 HK	4,318,999.48	3.17
7	GUANGDONG INVEST	270 HK	3,727,261.17	2.73
8	WEICHAI POWER CO LTD	2338 HK	3,686,938.52	2.70
9	HK EXCHANGE & CLEAR	388 HK	3,660,717.80	2.68
10	JIANGXI COPPER IND	358 HK	3,450,816.08	2.53
11	COMBA TELECOM SYSTEM	2342 HK	3,381,204.31	2.48
12	BANK OF COMM - H	3328 HK	3,341,744.53	2.45
13	BANK OF EAST ASIA	023 HK	3,316,684.36	2.43
14	MAANSHAN IRON&STEEL	323 HK	3,306,605.81	2.42
15	Standard Chartered PLC	2888 HK	3,294,501.33	2.42

16	PING AN INSURANCE GP	2318 HK	3,250,185.98	2.38
17	KERRY PROPERTIES LTD	683 HK	3,146,717.37	2.31
18	CHINA MOBILE LTD	941 HK	3,072,499.96	2.25
19	GUANGZHOU R&F PROP-H	2777 HK	2,981,322.46	2.19
20	CHINA RESOURCES LAND	1109 HK	2,903,001.48	2.13
21	TEXWINCA HOLDINGS	321 HK	2,818,908.30	2.07
22	YANZHOU COAL MIN CO	1171 HK	2,757,005.77	2.02
23	Poly Hong Kong Investment Ltd	119 HK	2,747,859.40	2.01

### 8.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CHINA MOBILE LTD	941 HK	8,626,639.89	6.33
2	CHINA TELECOM CORP	728 HK	8,357,439.94	6.13
3	CHINA OVERSEAS LAND	688 HK	7,729,733.86	5.67
4	CHINA OILFIELD SER	2883 HK	7,130,762.56	5.23
5	IND & COMM BK OF CHI	1398 HK	6,862,297.21	5.03
6	PING AN INSURANCE GP	2318 HK	6,741,343.83	4.94
7	CHINA EVERBRIGHT LTD	165 HK	6,618,370.92	4.85
8	MAANSHAN IRON&STEEL	323 HK	6,410,193.32	4.70
9	CHINA MERCHANTS BANK	3968 HK	6,266,258.21	4.60
10	DENWAY MOTORS	203 HK	5,553,594.12	4.07
11	COMBA TELECOM SYSTEM	2342 HK	5,326,486.35	3.91
12	TENCENT HOLDINGS	700 HK	4,168,921.77	3.06
13	GUANGZHOU R&F PROP-H	2777 HK	3,775,076.00	2.77
14	CHINA LIFE INSURANCE	2628 HK	3,694,105.52	2.71
15	Standard Chartered PLC	2888 HK	3,667,997.44	2.69
16	CHINA COMMS SERVI-H	552 HK	3,604,977.40	2.64
17	CAFE DE CORAL HOLDINGS LTD	341 HK	3,439,703.57	2.52
18	CNOOC LTD	883 HK	3,425,058.58	2.51
19	WEICHAI POWER CO LTD	2338 HK	3,333,980.46	2.44
20	ANTA SPORTS PRODUCTS	2020 HK	3,249,214.85	2.38
21	BANK OF COMM - H	3328 HK	3,203,122.32	2.35
22	HK ELECTRIC HLDGS	006 HK	3,159,431.26	2.32
23	SKYWORTH DIGITAL HDG	751 HK	2,973,065.60	2.18
24	CHINA YURUN FOOD GRO	1068 HK	2,861,688.53	2.10
25	YANZHOU COAL MIN CO	1171 HK	2,853,566.86	2.09
26	CHINA RESOURCES LAND	1109 HK	2,816,007.63	2.06
27	GOLDEN EAGLE RETAIL	3308 HK	2,732,553.44	2.00

### 8.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

金额单位：人民币元

买入成本（成交）总额	168,535,228.40
卖出收入（成交）总额	210,683,346.73

#### 8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 8.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 8.11 投资组合报告附注

**8.11.1** 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。

**8.11.2** 本基金股票投资范围包括香港证交所上市的所有股票和在新加坡、美国上市的中国公司，中国公司指收入的 50%以上来源于中国大陆的公司，基金管理人建立有股票池。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。

#### 8.11.3 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	-
2	应收证券清算款	121,369.51
3	应收股利	48,607.17
4	应收利息	517.27
5	应收申购款	79,768.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	250,262.93

#### 8.11.4 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。

#### 8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## §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
6,853	18,154.63	9,191,275.02	7.39%	115,222,421.15	92.61%

### 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	8,320,111.49	6.6875%

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年5月7日)基金份额总额	462,709,489.02
本报告期期初基金份额总额	185,308,217.36
本报告期期间基金总申购份额	91,108,200.75
减：本报告期期间基金总赎回份额	152,352,845.05
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	124,063,573.06

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、2009年6月30日，经中国证券监督管理委员会核准，华宝兴业基金管理公司聘任任志强先生、HUANG XIAOYI HELEN（黄小慧）女士为公司副总经理。

### 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 60,000.00 元人民币。目前该会计师事务所向本基金提供的审计服务持续期限为：本基金合同生效之日（2008 年 5 月 7 日）起至本报告期末。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人和托管人及其高级管理人员未有受到稽查或处罚的情况。

#### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

##### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
DEUBKLDN	1	7,171,332.47	1.90%	15,182.42	1.85%	-
BNP Paribas Securities (Asia) Ltd	1	51,650,021.49	13.68%	129,125.08	15.70%	-
BOCI Securities Ltd	1	18,862,979.49	5.00%	44,679.81	5.43%	-
China International Capital Corporation HK Securities Ltd	1	51,307,184.93	13.59%	128,267.98	15.60%	-
CLSA Ltd	1	48,852,557.76	12.94%	122,131.41	14.85%	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd	1	8,589,140.14	2.27%	21,472.84	2.61%	-
Deutsche Sec Ltd (Asia)	1	6,915,512.07	1.83%	17,288.77	2.10%	-
Macquarie Securities Ltd	1	8,982,387.76	2.38%	22,455.97	2.73%	-
J.P. Morgan Securities (Asia Pacific) Limited	1	67,738,680.12	17.94%	61,634.27	7.49%	-
Nomura International (HK) Ltd	1	33,703,103.72	8.93%	84,257.77	10.25%	-
UBS Securities Asia Ltd	1	38,782,144.63	10.27%	79,169.73	9.63%	-
Piper Jaffray	1	1,056,952.77	0.28%	10,569.53	1.29%	-
HSBC HK	1	177,597.39	0.05%	1,775.97	0.22%	-
Goldman Sachs NY LLC	1	33,757,880.70	8.94%	84,394.68	10.26%	-
Citigroup Global Markets Inc	1	-	-	-	-	-

注：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。

### 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		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
Citigroup Global Markets Inc	27,961,797.44	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 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	关于华宝兴业基金公司部分基金参加工商银行“2009 倾心回馈”基金定期定额业务申购费优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-01-01
2	关于华宝兴业基金公司部分基金参加建设银行定期定额业务申购费率优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-01-01
3	华宝兴业基金公司关于网上直销建设银行卡交易费率调整的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-01-20
4	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加深圳发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-03-23
5	关于华宝兴业基金管理有限公司增加中国国际金融有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-03-25
6	华宝兴业基金管理有限公司关于更正华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金业绩比较基准查询代码的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-04-15
7	关于华宝兴业基金管理有限公司增加齐鲁	《中国证券报》、《证	2009-04-29

	证券为代销机构的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
8	关于华宝兴业基金管理有限公司在光大证券开办基金定期定额投资计划业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-05-08
9	华宝兴业基金管理有限公司关于开通建设银行网上直销定期定额业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-07-14
10	关于华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-08-15
11	华宝兴业基金管理有限公司关于开通民生银行借记卡基金网上交易业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-08-18
12	华宝兴业基金管理有限公司关于运用公司自有资金投资旗下基金的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-08-21
13	关于华宝兴业基金管理有限公司在国信证券开办基金定期定额投资计划业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-08-27
14	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下基金参与中国农业银行网上银行申购费率优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-09-04
15	华宝兴业基金公司关于调整开放式基金业务规则的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-09-12
16	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加上海浦东发展银行股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-09-15
17	关于华宝兴业旗下基金在深圳发展银行开通基金定期定额投资业务的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-01
18	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金	《中国证券报》、《证	2009-12-02

	增加广发华福证券有限责任公司为代销机构的公告	券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	
19	华宝兴业基金管理有限公司关于旗下基金定期定额投资业务开通情况的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-08
20	关于华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金暂停接受五十万元以上申购及转换转入申请的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-15
21	关于华宝兴业基金管理有限公司全部基金增加信达证券股份有限公司为代销机构的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-22
22	关于华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金 2010 年工作日的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-22
23	华宝兴业基金管理有限公司关于调整基金网上直销定期定额申购限额的公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-25
24	关于华宝兴业基金管理有限公司旗下部分基金参与中国农业银行定期定额申购费率优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-30
25	华宝兴业基金管理有限公司关于华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金经理变更公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-31
26	关于华宝兴业基金公司部分基金参加工商银行“2010 倾心回馈”基金定期定额业务申购费优惠活动的提示性公告	《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》以及基金管理人网站	2009-12-31

### §12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009 年 1 月 16 日，本基金托管人公告中国建设银行聘请胡哲一先生担任中国建设银行副行长；
- 2、2009 年 5 月 14 日，美国银行公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；
- 3、2009 年 5 月 26 日，中国建银投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司

---

司股权变动报告书；

4、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于中国建设银行股份有限公司股权变动报告书；

5、2009年8月2日，本基金托管人公告，自2009年7月24日起陈佐夫先生就任中国建设银行执行董事。

6、2009年9月27日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告。

7、2009年10月11日，本基金托管人发布关于控股股东增持中国建设银行股份有限公司的公告。

### **§13 备查文件目录**

#### **13.1 备查文件目录**

中国证监会批准基金设立的文件；

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金基金合同；

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金招募说明书；

华宝兴业海外中国成长股票型证券投资基金托管协议；

基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

基金管理人报告期内在指定报刊上披露的各种公告；

基金托管人业务资格批件和营业执照。

#### **13.2 存放地点**

以上文件存于基金管理人及基金托管人办公场所备投资者查阅。

#### **13.3 查阅方式**

投资者可以通过基金管理人网站，查阅或下载基金合同、招募说明书、托管协议及基金的各种定期和临时公告。

华宝兴业基金管理有限公司

二〇一〇年三月二十九日