

华宝兴业大盘精选股票型证券投资基金

「2009」第四季度报告

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

4.1 基金经理 姚基经

姓名	职务	任本基金的基金经理期限	证券从业年限	说明
姚基经	基金经理	2008-10-8	9年	硕士,曾在联合证券有限公司、华宝基金管理有限公司、长城证券从事投资、研究、投资银行等工作。2004年3月加入本公司,任高级研究员、多策略增长基金基金经理助理。2006年6月兼任华宝兴业大盘精选基金基金经理,2008年10月兼任华宝兴业大盘精选基金基金经理。

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

4.3 公平交易制度执行情况
报告期内,本基金管理人通过交易决策与交易执行相分离、交易所相对投资部门独立、每日交易日报报告等机制,确保所管理的不同投资组合中被公平对待。报告期内,基金管理人严格落实公平交易制度,加强了对所管理的不同投资组合间交易价差的分析,分析结果没有发现交易价差异常。

4.4 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.5 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.6 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.7 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.8 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.9 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.10 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.11 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.12 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.13 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.14 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.15 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.16 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.17 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.18 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.19 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.20 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.21 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.22 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.23 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.24 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.25 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.26 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.27 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.28 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.29 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.30 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.31 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.32 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.33 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.34 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.35 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

4.36 本报告期本基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
截至2009年12月31日,本基金净值增长率为25.03%,业绩比较基准收益率为15.23%,本基金净值增长率超过业绩比较基准收益率为9.80%。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,799,214,507.51	88.28
2	其中:股票	1,799,214,507.51	88.28
3	固定收益投资	60,385,000.00	2.96
4	其中:债券	60,385,000.00	2.96
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其他资产	160,442,448.55	7.87
10	合计	2,038,020,863.29	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔	3,267,000.00	0.16
B	采掘业	139,090,138.80	6.94
C	制造业	921,848,230.25	46.03
D	建筑业	19,145,570.00	0.96
E	电力、煤气及水的生产和供应业	17,158,470.13	0.86
F	交通运输、仓储业	98,402,124.71	4.91
G	信息技术业	34,471,079.96	1.72
H	金融业	343,566,605.93	17.31
I	房地产业	267,903,163.74	13.38
J	商业、贸易业	126,424,215.78	6.15
K	医药、生物制品	14,777,000.00	0.74
L	其他制造业	11,126,903.70	0.56
M	其他服务业	22,473,405.55	1.12
N	其他综合类	70,963,100.00	3.54
O	其他综合类	29,236,788.08	1.46
P	其他综合类	91,950,396.53	4.59
Q	其他综合类	452,058,253.53	22.57
R	其他综合类	48,199,241.66	2.41
S	其他综合类	4,120,800.00	0.21
T	其他综合类	1,420,570.00	0.07
U	其他综合类	4,890,600.00	0.24
V	其他综合类	1,799,214,507.51	88.28

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	2,574,893	103,793,936.83	5.18
2	600030	中信证券	2,250,000	71,482,500.00	3.57
3	600016	民生银行	2,954,000	62,196,140.00	3.14
4	600660	福耀玻璃	4,050,000	60,507,000.00	3.02
5	601006	大秦铁路	5,280,000	54,384,000.00	2.72
6	600909	青岛海尔	2,142,800	53,120,012.00	2.65
7	601398	工商银行	9,580,000	52,115,200.00	2.60
8	600216	浙江医药	1,420,570	50,529,674.90	2.52
9	601318	中国平安	900,000	49,581,000.00	2.48
10	002001	新和成	835,665	40,864,018.50	2.04

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601166	兴业银行	2,574,893	103,793,936.83	5.18
2	600030	中信证券	2,250,000	71,482,500.00	3.57
3	600016	民生银行	2,954,000	62,196,140.00	3.14
4	600660	福耀玻璃	4,050,000	60,507,000.00	3.02
5	601006	大秦铁路	5,280,000	54,384,000.00	2.72
6	600909	青岛海尔	2,142,800	53,120,012.00	2.65
7	601398	工商银行	9,580,000	52,115,200.00	2.60
8	600216	浙江医药	1,420,570	50,529,674.90	2.52
9	601318	中国平安	900,000	49,581,000.00	2.48
10	002001	新和成	835,665	40,864,018.50	2.04

5.1 报告期内基金资产组合情况
截至2009年12月31日,本基金资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	594,452,465.99	87.27
2	其中:股票	594,452,465.99	87.27
3	固定收益投资	33,532,100.00	4.92
4	其中:债券	33,532,100.00	4.92
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	44,064,125.55	6.47
9	合计	681,116,806.88	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔	6,261,000.00	0.97
B	采掘业	15,131,600.00	2.33
C	制造业	315,025,224.22	48.56
D	建筑业	48,001,000.00	7.40
E	电力、煤气及水的生产和供应业	6,324,480.00	0.97
F	交通运输、仓储业	84,880,349.79	12.59
G	信息技术业	16,421,829.66	2.33
H	金融业	70,393,416.47	10.82
I	房地产业	88,994,147.99	13.75
J	商业、贸易业	24,184,911.20	3.75
K	医药、生物制品	5,266,200.00	0.81
L	其他制造业	2,202,000.00	0.34
M	其他服务业	83,058,941.37	12.80
N	其他综合类	34,975,000.00	5.30
O	其他综合类	46,724,000.00	7.29
P	其他综合类	18,320,000.00	2.82
Q	其他综合类	12,336,000.00	1.90
R	其他综合类	30,967,588.80	4.77
S	其他综合类	594,452,465.99	91.63

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600487	亨通光电	1,120,796	39,016,640.16	6.01
2	600215	诺普信	1,250,000	35,639,150.79	5.49
3	600993	华冠科技	791,917	30,362,097.78	4.68
4	600532	中恒集团	866,440	22,977,988.80	3.54
5	600703	三安光电	42,000	22,155,000.00	3.42
6	600511	国药股份	720,000	18,432,000.00	2.84
7	600288	新黄浦	1,171,138	18,386,552.60	2.83
8	600256	鲁商置业	800,000	18,320,000.00	2.82
9	601169	北京银行	900,000	17,406,000.00	2.68
10	600426	富龙热电	1,101,232	16,903,911.20	2.61

5.2 报告期内基金资产组合情况
截至2009年12月31日,本基金资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,659,776,797.48	86.10
2	其中:股票	1,659,776,797.48	86.10
3	固定收益投资	20,030,000.00	1.04
4	其中:债券	20,030,000.00	1.04
5	资产支持证券	-	-
6	金融衍生品投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他资产	241,205,054.20	12.51
9	合计	1,927,721,717.25	100.00

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔	38,253,185.77	2.00
B	采掘业	190,336,000.00	9.95
C	制造业	701,265,432.08	36.64
D	建筑业	140,053,272.66	7.32
E	电力、煤气及水的生产和供应业	881,219,898.00	46.06
F	交通运输、仓储业	135,702,264.76	7.20
G	信息技术业	115,927,208.96	6.06
H	金融业	9,178,206.94	0.48
I	房地产业	219,455,168.87	11.46
J	商业、贸易业	239,810,484.29	12.53
K	医药、生物制品	81,972,884.03	4.28
L	其他制造业	149,189,624.72	7.69
M	其他服务业	8,400,000.00	0.44
N	其他综合类	34,045,000.00	1.78
O	其他综合类	69,626,373.70	3.64
P	其他综合类	42,515,341.47	2.22
Q	其他综合类	106,313,800.32	5.56
R	其他综合类	1,659,776,797.48	86.10

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600252	中恒集团	4,008,816	106,313,800.32	5.56
2	600487	亨通光电	3,255,611	104,049,327.56	5.44
3	600547	山东黄金	970,000	77,891,000.00	4.09
4	600348	山东墨龙	1,500,000	72,555,000.00	3.79
5	600256	鲁商置业	3,040,453	69,626,373.70	3.64
6	600907	华冠科技	2,977,721	66,790,262.03	3.49
7	000898	华冠股份	3,909,920	62,558,720.00	3.27
8	600323	南方航空	4,959,272	60,155,969.36	3.14
9	000531	顺发恒业	3,400,818	59,378,282.38	3.10
10	600649	城投控股	4,555,350	57,534,070.00	3.01

5.3 报告期内基金资产组合情况
截至2009年12月31日,本基金资产组合情况如下:

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,659,776,797.48	86.10
2	其中:股票	1,659,776,797.48	86.10
3	固定收益投资	20,030,000.00	1.04
4	其中:债券	20,030,000.00	1.04
5	资产支持证券	-	-