兴业社会责任股票型证券投资基金 2009年半年度报告摘要

2009年6月30日

基金管理人:兴业全球基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇〇九年八月二十六日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

本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责任。本半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。

本基金的托管人建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

本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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2009年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业社会责任股票型证券投资基金
基金简称	兴业社会责任股票
交易代码	340007
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年4月30日
报告期末基金份额总额	3,083,916,146.28份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。
投资策略	本基金采用"自上而下"与"自下而上"相结合的投资策略,将定性与定量研究相结合,在宏观与微观层面对各类资产的价值增长能力展开综合评估,动态优化资产配置。在根据行业所处生命周期、景气周期、行业盈利与发展趋势等因素选取盈利能力较好、持续发展潜力强的行业的基础上,采用"兴业双层行业筛选法"进行优化调整。采用"兴业社会责任四维选股模型"精选股票。
业绩比较基准	80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数
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		兴业全球基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜建新	尹东
	联系电话	021-58368998	010-67595003
	电子邮箱	dujx@xyfunds.com.cn	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		4006780099,021-38824536	010-67595096
传真		021-58368858	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.xyfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
本期已实现收益	630,306,327.45
本期利润	1,088,829,140.97
加权平均基金份额本期利润	0.4571
本期基金份额净值增长率	63.11%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2009年1月1日-2009年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0140
期末基金资产净值	3,914,460,768.86
期末基金份额净值	1.269

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
过去一个月	7.54%	0.90%	11.17%	0.95%	-3.63%	-0.05%
过去三个月	19.60%	1.28%	19.83%	1.22%	-0.23%	0.06%
过去六个月	63.11%	1.49%	54.57%	1.55%	8.54%	-0.06%
过去一年	41.79%	1.63%	13.13%	2.02%	28.66%	-0.39%
自基金合同生效起至今	26.90%	1.55%	-10.53%	2.08%	37.43%	-0.53%

注:本基金业绩比较基准为80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数,在业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑:中信标普300指数和中信标普国债指数具有较强的代表性。中信标普300指数选择中国A股市场中市值规模最大、流动性强和基本面良好的300家上市公司作为样本股,充分反映了A股市场的行业代表性,描述了沪深A股市场的总体趋势,是目前市场上较有影响力的股票投资业绩比较基准。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势,是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金的业绩基准指数按照构建公式每交易日进行计算,按下列公式计算:

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

兴业社会责任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4月30日至2009年6月30日)

注:1、净值表现所取数据截至到2009年6月30日。

2、按照《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》的规定,本基金建仓期为2008年4月30日至2008年10月29日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

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

兴业全球基金管理有限公司是经中国证监会(证监基字[2003]100号文)批准,于2003年9月30日成立。2008年1月2日,中国证监会批准(证监许可[2008]6号)了公司股权变更申请,全球人寿保险国际公司(AEGON International N.V)受让本公司股权并成为公司股东。股权转让完成后,兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%,全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。同时公司名称由"兴业基金管理有限公司"更名为"兴业全球人寿基金管理有限公司"。2008年7月7日,经中国证监会批准(证监许可[2008]888号文),公司名称由"兴业全球人寿基金管理有限公司"变更为"兴业全球基金管理有限公司",同时,公司注册资本由人民币1.2亿元变更为人民币1.5亿元。

截止2009年6月30日,公司旗下管理着六只基金,分别为兴业可转债混合型证券投资基金、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票型证券投资基金、兴业社会责任股票型证券投资基金、兴业有机增长灵活配置混合型证券投资基金。

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		
傅鹏博	兴业全球基金管理有限公司基金管理部副总监、本基金基金经理	2009-1-16	-	7年	傅鹏博先生,1962年生,经济学硕士。历任上海财经大学经济管理系讲师,申银万国证券股份有限公司企业融资部经理,东方证券股份有限公司资产管理部负责人、研究所首席策略师;汇添富基金管理有限公司首席策略师。
刘兆洋	本基金基金经理	2008-4-30	-	9年	刘兆洋先生,1972年生,经济学博士。历任光大证券有限责任公司投资银行部经理、资产经营部高级经理、银华基金管理有限公司基金经理部基金经理助理,兴业全球基金管理有限公司兴业可转债混合型基金基金经理助理、研究策划部总监助理、兴业货币市场基金基金经理。

注:1、任职日期指基金合同生效之日(基金成立时即担任基金经理)或公司作出聘任决定之日(基金成立后担任基金经理);离任日期指公司作出解聘决定之日。

2、"证券从业年限"按照中国证券业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴业社会责任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,本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,本基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定,无违法违规、未履行基金合同承诺或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,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定,从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关,确保各投资组合之间得到公平对待,保护投资者的合法权益。

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

基金名称	基金净值增长率	业绩比较基准增长率
兴业社会责任股票	63.11	54.57
兴业全球视野股票	49.32	54.59

本报告期内,兴业社会责任股票和兴业全球视野股票净值增长率相差13.79%,主要原因在于:

(1)规模因素。

规模比较表

基金名称	2009-01-01	2009-03-31	2009-06-30
兴业社会责任股票	8.85亿	25.66亿	39.14亿
兴业全球视野股票	55.82亿	66.89亿	69.01亿

由上表可以看出,兴业社会责任股票和兴业全球视野股票的规模相差比较大。尤其在09年一季度两基金规模相差悬殊,这导致两基金在操作上有较大的差异。小规模的基金可以根据市场情况在仓位和行业上进行更加灵活的配置,从而获得相对较高的收益。实际上,两基金在规模相差较大的一季度,收益相差最大。一季度兴业全球视野股票收益率22.03%,兴业社会责任股票36.38%,相差14.35%。而在两基金规模差异相对较小的二季度,其收益差异也就比较小,在5%以内。

(2)投资风格上的差异。虽然两基金同为股票型基金,但是两基金在具体的投资风格上还是存在差异的,如兴业社会责任股票追求当期投资收益实现与长期资本增值,同时强调上市公司在持续发展、法律、道德责任等方面的履行。而兴业全球视野股票以全球视野的角度,主要投资于富有成长性、竞争力以及价值被低估的公司。投资风格上的差异也导致两基金在配置策略和选股上存在一定的差异。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

出乎证券市场大部分投资者的预料,2009年上半年,除了2月中下旬有个稍微大点的调整外,市场基本上是一路上行,上证指数报收2959点,上涨62.35%。股票是普涨格局,煤炭、有色、房地产等行业涨幅较大。上半年指数表现强劲的主要原因是:我国政府面对金融风暴应对及时,措施得力;在四万亿经济刺激计划、产业振兴规划、区域振兴规划等的带动下,我国经济复苏明显,M2、M1、信贷增速、固定资产投资、工业增加值等信贷和工业指标明显反弹,用电量逐月回升;房地产价格上涨;周边股市持续反弹;上半年新增信贷高达7.37万亿元,超过历史上任何一年的投放总量;流动性非常充裕;对通胀的预期增加了投资者对股票资产的兴趣。

上半年,我们对经济的复苏和市场的强势有一个逐步认识的过程,在大部分时间里保持了较高的仓位,为本基金在上半年良好的表现奠定了基础。在行业配置上,我们围绕着经济复苏和通胀预期主题,在医药、金融、煤炭、有色、房地产等行业中选择优秀的上市公司配置。我们认为未来的经济将是一个"低碳经济",新能源在经济和社会生活中的重要性将日益突出,新能源股票将成为持续的市场热点,我们在去年年底和今年一季度就开始布局新能源股票,给基金带来了较大的收益。我们认为,在经济复苏和市场整体估值上升的背景下,医药板块估值的相对吸引力显得更加突出,在二季度本基金加大了对医药板块的配置力度。我们还坚持了灵活操作的策略,对部分涨幅较大的股票进行了变现。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对下半年的市场,我们保持着谨慎乐观的心态。经济的复苏、通胀预期和充裕的流动性将推动大量资金继续流入A股;中国的经济在全球经济中率先复苏,经济增长率也是最高的国家之一,全球资金对中国股票资产的兴趣在增加。另一方面,估值的高企、主板、中小板IPO的重新开闸、创业板的推出、大小非的减持、对政策转向的预期使得市场面临一定的调整压力。

投资策略上我们将密切关注流动性的变化和国家宏观政策特别是货币政策和房地产政策的变化情况,保持操作的灵活性,争取尽可能的把已取得的收益保住;继续挖掘市场的投资机会,关注上市公司履行社会责任的情况,投资有核心竞争力、在社会责任方面表现较好的上市公司。关注在"低碳经济"和"新能源经济"中能持续受益的上市公司。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金投资品种进行估值。具体估值流程为:1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程,选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议,并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后,由IT人员或IT人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级,以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略,并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误;4、投资人员(包括基金经理)积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对估值造成影响的因素,并就可能带来的影响提出建议和意见;5、监察稽核人员参与估值方案的制定,确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定,定期对估值流程、系统估值模型及估值结果进行检查,确保估值委员会决议的有效执行,负责基金估值业务的定期和临时信息披露。

上述参与估值流程人员均具有3年以上相关工作经历,具备估值业务所需的专业胜任能力。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴业社会责任股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金未实施利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

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 托管人对本半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:兴业社会责任股票型证券投资基金

报告截止日:2009年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008年12月31日
资产:			
银行存款		41,622,579.56	154,049,529.25
结算备付金		16,127,510.50	1,132,744.62
存出保证金		2,052,242.80	398,503.54
交易性金融资产		3,745,405,040.47	732,696,872.96
其中:股票投资		3,455,490,040.47	580,476,341.96
债券投资		289,915,000.00	152,220,531.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		251,498,808.59	2,878,351.84
应收利息		9,552,954.77	1,800,412.28
应收股利		278,040.60	-
应收申购款		21,828,987.80	104,776.92
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		4,088,366,165.09	893,061,191.41
负债和所有者权益	附注号	本期末 2009年6月30日	上年度末 2008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		97,999,733.00	-
应付证券清算款		-	4,606,472.77
应付赎回款		62,496,136.98	1,109,891.68
应付管理人报酬		4,705,895.74	940,006.75
应付托管费		784,315.95	156,667.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		7,247,221.55	946,987.08
应交税费		-	-
应付利息		16,300.30	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		655,792.71	344,182.99
负债合计		173,905,396.23	8,104,209.07
所有者权益:			
实收基金		3,083,916,146.28	1,137,731,245.85
未分配利润		830,544,622.58	-252,774,263.51
所有者权益合计		3,914,460,768.86	884,956,982.34
负债和所有者权益总计		4,088,366,165.09	893,061,191.41

注:报告截止日2009年6月30日,基金份额净值1.269元,基金份额总额3,083,916,146.28份。

6.2 利润表

会计主体:兴业社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2009年1月1日-2009年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日
一、收入		1,129,198,932.20	-144,091,125.33
1.利息收入		4,243,499.15	2,768,564.09
其中:存款利息收入		1,131,550.80	972,327.29
债券利息收入		3,111,948.35	1,767,486.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	28,750.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		664,777,910.06	-5,123,715.57
其中:股票投资收益		627,356,189.80	-6,804,716.30
债券投资收益		16,733,138.75	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		20,688,581.51	1,681,000.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		458,522,813.52	-141,735,973.85
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		1,654,709.47	-
二、费用(以"-"号填列)		-40,369,791.23	-5,652,472.78
1.管理人报酬		-18,986,719.54	-3,367,214.73
2.托管费		-3,164,453.22	-561,202.43
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-17,961,856.42	-1,625,837.99
5.利息支出		-50,844.22	-
其中:卖出回购金融资产支出		-50,844.22	-
6.其他费用		-205,917.83	-98,217.63
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		1,088,829,140.97	-149,743,598.11
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		1,088,829,140.97	-149,743,598.11

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴业社会责任股票型证券投资基金

本报告期:2009年1月1日-2009年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30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)	1,137,731,245.85	-252,774,263.51	884,956,982.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,088,829,140.97	1,088,829,140.97
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)	1,946,184,900.43	-5,510,254.88	1,940,674,645.55
其中:1.基金申购款	3,206,655,300.69	109,143,583.72	3,315,798,884.41
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,260,470,400.26	-114,653,838.60	-1,375,124,238.86
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)	3,083,916,146.28	830,544,622.58	3,914,460,768.86
项目	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30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)	1,388,696,479.84	-	1,388,696,479.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-149,743,598.11	-149,743,598.11
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)	52,052,026.54	-2,206,348.55	49,845,677.99
其中:1.基金申购款	52,052,026.54	-2,206,348.55	49,845,677.99
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-	-	-
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)	1,440,748,506.38	-151,949,946.66	1,288,798,559.72

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业社会责任股票型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]356号文《关于核准兴业社会责任股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由兴业全球基金管理有限公司(原名"兴业基金管理有限公司")作为发起人于2008年3月28日至2008年4月25日向社会公开募集,募集期结束经安永大华会计师事务所验证并出具安永大华业字(2008)第588号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2008年4月30日生效。本基金为契约型开放式,存续期限不定。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币1,388,444,274.71元,在募集期间产生的活期存款利息为人民币252,205.13元,以上实收基金(本息)合计为人民币1,388,696,479.84元,折合1,388,696,479.84份基金份额。本基金的基金管理人为兴业全球基金管理有限公司,注册登记机构为兴业全球基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括依法公开发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证、资产支持证券以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

业绩比较基准为:80%×中信标普300指数+20%×中信标普国债指数。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《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》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》及其他中国证监会颁布的相关规定而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于2009年6月30日的财务状况以及2009年上半年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 税项

A.印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定,自2007年5月30日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的1‰调整为3‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

B.营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

C.个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入,由上市公司、债券发行企业及金融机构在向基金派发股息、红利收入、债券的利息收入及储蓄利息收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》的规定,自2005年6月13日起,对证券投资基金从上市公司分配取得的股息红利所得,按照财税[2005]102号文规定,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

6.4.6 关联方关系

6.4.6.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金管理人存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴业全球基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(以下简称"建设银行")	基金托管人、基金代销机构
兴业证券股份有限公司(以下简称"兴业证券")	基金管理人的股东、基金代销机构

注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.7.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30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
兴业证券	6,594,361,885.67	53.28%	792,502,254.69	98.70%

6.4.7.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.7.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日	
	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
兴业证券	73,057,718.77	66.34%	2,250,476.00	69.31%

6.4.7.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
兴业证券	-	-	2,250,476.00	69.31%

6.4.7.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30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
兴业证券	5,432,308.56	52.50%	3,227,339.43	44.55%
关联方名称	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30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
兴业证券	668,686.89	98.69%	668,686.89	98.69%

注:上述佣金按市场佣金率计算,扣除证券公司需承担的费用(包括但不限于买(卖)经手费、证券结算风险基金和证券交易所买(卖)证管费等)。管理人因此从关联方获取的其他服务主要包括:为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.7.2 关联方报酬

6.4.7.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日
当期应支付的管理费	18,986,719.54	3,367,214.73
其中:当期已支付	14,280,823.80	1,740,624.01
期末未支付	4,705,895.74	1,626,590.72

注:1、基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金管理费=前一日的基金资产净值×1.5%/当年天数。

2、上述表格中"当年已支付"不包含当期已支付的上期应付管理费。

6.4.7.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日
当期应支付的托管费	3,164,453.22	561,202.43
其中:当期已支付	2,380,137.27	290,103.98
期末未支付	784,315.95	271,098.45

注:1、基金托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:每日应支付的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%/当年天数。2、上述表格中"当年已支付"不包含当期已支付的上期应付托管费。

6.4.7.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2009年1月1日-2009年6月30日					
	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
建设银行	-	-	-	-	185,300,000.00	24,623.13
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日					
	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
-	-	-	-	-	-	-

6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.7.4.1 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 2009年1月1日-2009年6月30日	上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日
期初持有的基金份额	37,304,664.21	-
期间认购总份额	-	37,304,664.21
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分增加的份额	-	-
期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	37,304,664.21	37,304,664.21
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.21%	2.59%

注:1、期间申购/买入总份额含红利再投资、转换转入份额,期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

2、关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定,符合公允性要求。

6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

关联方名称	本期末 2009年6月30日		上年度末 2008年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
兴业证券	-	-	30,051,250.00	2.64%

注:关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定,符合公允性要求。

6.4.7.5 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-2009年6月30日		上年度可比期间 2008年4月30日(基金合同生效日)-2008年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	41,622,579.56	1,003,692.86	589,967,136.64	963,844.66

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金2009年上半年度及2008年上半年度均未存在在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.8 期末(2009年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌股票

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
000792	盐湖钾肥	2009-6-26	重大事项	55.14	2009-7-27	60.65	981,951	53,488,239.15	54,144,778.14

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

7 投资组合报告

7.1 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	3,455,490,040.47	84.52
	其中:股票	3,455,490,040.47	84.52
2	固定收益投资	289,915,000.00	7.09
	其中:债券	289,915,000.00	7.09
	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	57,750,090.06	1.41
6	其他资产	285,211,034.56	6.98
7	合计	4,088,366,165.09	100.00

7.2 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	576,118,275.89	14.72
C	制造业	1,449,768,788.21	37.04
C0	食品、饮料	163,945,369.40	4.19
C1	纺织、服装、皮毛	83,542,496.50	2.13
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	240,863,953.49	6.15
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	69,971,182.33	1.79
C7	机械、设备、仪表	190,385,294.73	4.86
C8	医药、生物制品	701,060,491.76	17.91
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	36,595,416.84	0.93
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	276,651,931.46	7.07
H	批发和零售贸易	173,250,550.74	4.43
I	金融、保险业	459,939,836.16	11.75
J	房地产业	119,531,753.68	3.05
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	53,304,313.79	1.36
M	综合类	310,329,173.70	7.93
	合计	3,455,490,040.47	88.27

7.3 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	600276	恒瑞医药	7,223,202	252,161,981.82	6.44
2	002038	双鹭药业	4,731,032	153,048,885.20	3.91
3	000933	神火股份	7,649,833	152,996,660.00	3.91
4	600770	综艺股份	10,299,965	143,169,513.50	3.66
5	600036	招商银行	6,238,994	139,815,855.54	3.57
6	601328	交通银行	14,285,960	128,716,499.60	3.29
7	601088	中国神华	3,699,870	110,663,111.70	2.83
8	000839	中信国安	6,999,987	103,179,808.38	2.64
9	000009	中国宝安	8,199,870	97,250,458.20	2.48
10	002065	东华软件	6,847,299	97,231,645.80	2.48

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站www.xyfund.com.cn的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600276	恒瑞医药	241,556,612.89	27.30
2	601088	中国神华	193,745,619.94	21.89
3	002038	双鹭药业	161,730,934.04	18.28
4	000630	铜陵有色	158,575,543.38	17.92
5	000009	中国宝安	157,210,475.13	17.76
6	600770	综艺股份	152,363,724.85	17.22
7	601168	西部矿业	146,744,758.91	16.58
8	000933	神火股份	135,910,893.85	15.36
9	600030	中信证券	127,297,483.44	14.38
10	000839	中信国安	122,436,333.10	13.84
11	600036	招商银行	118,897,319.56	13.44
12	601328	交通银行	109,613,420.86	12.39
13	002065	东华软件	105,282,497.56	11.90
14	600016	民生银行	99,041,030.02	11.19
15	002001	新和成	88,918,259.05	10.05
16	600267	海正药业	88,604,442.32	10.01
17	601318	中国平安	87,395,479.78	9.88
18	000726	鲁泰A	86,928,882.94	9.82
19	600550	天威保变	86,338,360.32	9.76
20	600315	上海家化	84,434,999.08	9.54
21	000762	西藏矿业	83,700,546.72	9.46
22	600426	华鲁恒升	83,201,537.04	9.40
23	600547	山东黄金	80,660,050.02	9.11
24	000629	攀钢钢钒	78,245,395.00	8.84
25	600475	华光股份	77,585,167.64	8.77
26	002024	苏宁电器	76,037,151.91	8.59
27	600570	恒生电子	75,780,244.33	8.56
28	000895	双汇发展	74,245,321.98	8.39
29	601166	兴业银行	74,145,343.11	8.38
30	000157	中联重科	73,604,649.93	8.32
31	600331	宏达股份	72,109,255.70	8.15
32	000002	万科A	71,077,342.08	8.03
33	600196	复星医药	68,469,925.53	7.74
34	000792	盐湖钾肥	67,984,524.77	7.68
35	000963	华东医药	67,645,946.54	7.64
36	600880	博瑞传播	66,369,243.55	7.50
37	600415	小商品城	65,851,398.91	7.44
38	002007	华兰生物	65,773,213.54	7.43
39	600216	浙江医药	65,139,769.02	7.36
40	000012	南玻A	62,972,360.21	7.12
41	600052	浙江广厦	62,657,078.34	7.08
42	600348	国阳新能	62,027,709.92	7.01
43	601899	紫金矿业	59,834,424.80	6.76
44	600518	康美药业	59,554,006.16	6.73
45	600406	国电南瑞	57,830,950.94	6.53
46	600141	兴发集团	56,292,564.38	6.36
47	601398	工商银行	55,460,900.00	6.27
48	000983	西山煤电	54,585,455.16	6.17
49	600497	驰宏锌锗	50,627,642.11	5.72
50	000501	鄂武商A	50,088,778.35	5.66
51	000667	名流置业	49,968,729.68	5.65
52	002109	兴化股份	49,188,303.64	5.56
53	000718	苏宁环球	48,327,499.97	5.46
54	600031	三一重工	47,887,279.82	5.41
55	600511	国药股份	47,219,770.18	5.34
56	601666	平煤股份	45,910,568.86	5.19
57	600266	北京城建	45,419,461.30	5.13
58	601628	中国人寿	45,122,007.39	5.10
59	601186	中国铁建	43,922,049.68	4.96
60	601898	中煤能源	42,303,098.28	4.78
61	600005	武钢股份	42,302,532.07	4.78
62	600089	特变电工	41,633,922.74	4.70
63	600881	亚泰集团	41,105,002.87	4.64
64	600586	金晶科技	38,696,579.13	4.37
65	000060	中金岭南	38,053,482.48	4.30
66	002202	金风科技	37,654,497.38	4.25
67	601699	潞安环能	35,834,088.94	4.05
68	000997	新大陆	35,659,937.45	4.03
69	600309	烟台万华	34,951,224.05	3.95
70	600549	厦门钨业	34,253,524.32	3.87
71	600717	天津港	33,090,444.79	3.74
72	600660	福耀玻璃	30,767,152.91	3.48
73	600983	合肥三洋	30,311,580.07	3.43
74	600123	兰花科创	29,750,233.80	3.36
75	000522	白云山A	29,393,856.42	3.32
76	000425	徐工科技	29,264,870.68	3.31
77	000527	美的电器	29,003,603.83	3.28
78	601001	大同煤业	28,526,634.77	3.22
79	600787	中储股份	28,456,012.47	3.22
80	000046	泛海建设	27,871,814.69	3.15
81	000601	韶能股份	27,240,268.26	3.08
82	600895	张江高科	26,598,565.21	3.01
83	000006	深振业A	26,417,678.14	2.99
84	601857	中国石油	26,116,782.22	2.95
85	000422	湖北宜化	24,760,402.85	2.80
86	600641	万业企业	24,529,264.32	2.77
87	600973	宝胜股份	23,758,440.07	2.68
88	000960	锡业股份	23,535,522.86	2.66
89	601169	北京银行	23,496,305.30	2.66
90	600893	航空动力	22,879,117.48	2.59
91	600581	八一钢铁	22,287,439.45	2.52
92	600271	航天信息	22,064,907.54	2.49
93	600875	东方电气	22,025,602.02	2.49
94	000878	云南铜业	21,763,065.14	2.46
95	600432	吉恩镍业	21,595,834.55	2.44
96	600316	洪都航空	21,251,203.09	2.40
97	600000	浦发银行	20,931,130.75	2.37
98	000777	中核科技	20,507,938.71	2.32
99	600048	保利地产	20,411,874.00	2.31
100	000932	华菱钢铁	20,188,525.05	2.28
101	600496	精工钢构	19,925,177.55	2.25
102	600724	宁波富达	19,330,867.51	2.18
103	000530	大冷股份	19,214,560.50	2.17
104	600739	辽宁成大	19,166,640.45	2.17
105	000402	金融街	18,871,676.91	2.13
106	000708	大冶特钢	18,234,131.38	2.06
107	000876	新希望	18,082,040.14	2.04

7.4.2 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	000629	攀钢钢钒	173,136,898.37	19.56
2	000630	铜陵有色	162,597,084.92	18.37
3	601168	西部矿业	145,465,572.26	16.44
4	600030	中信证券	133,295,855.99	15.06
5	600036	招商银行	108,596,867.98	12.27
6	601318	中国平安	98,692,826.02	11.15
7	600550	天威保变	98,331,537.39	11.11
8	600426	华鲁恒升	97,828,409.06	11.05
9	002007	华兰生物	91,395,497.09	10.33
10	600547	山东黄金	91,241,930.29	10.31
11	601088	中国神华	87,836,330.81	9.93
12	600016	民生银行	84,053,956.12	9.50
13	600309	烟台万华	82,914,115.76	9.37
14	002024	苏宁电器	79,698,848.87	9.01
15	600406	国电南瑞	78,295,259.81	8.85
16	600331	宏达股份	76,289,433.98	8.62
17	600586	金晶科技	73,135,567.79	8.26
18	000002	万科A	72,994,872.91	8.25
19	000009	中国宝安	63,865,395.53	7.22
20	600000	浦发银行	63,543,745.72	7.18
21	000718	苏宁环球	62,459,853.71	7.06
22	000012	南玻A	60,844,464.23	6.88
23	601666	平煤股份	59,662,650.61	6.74
24	600518	康美药业	57,651,315.05	6.51
25	601001	大同煤业	56,824,905.13	6.42
26	600141	兴发集团	55,160,279.06	6.23
27	002109	兴化股份	55,063,828.16	6.22
28	000983	西山煤电	52,511,787.25	5.93
29	600497	驰宏锌锗	51,363,963.17	5.80
30	601699	潞安环能	49,270,751.00	5.57
31	600005	武钢股份	49,267,343.50	5.57
32	601628	中国人寿	48,481,090.05	5.48
33	601166	兴业银行	47,044,336.64	5.32
34	601898	中煤能源	46,297,309.60	5.23
35	002202	金风科技	46,265,500.78	5.23
36	600881	亚泰集团	46,094,448.40	5.21
37	601186	中国铁建	43,037,252.20	4.86
38	000919	金陵药业	42,551,089.61	4.81
39	000157	中联重科	42,284,376.51	4.78
40	600089	特变电工	41,712,325.80	4.71
41	000997	新大陆	41,176,158.12	4.65
42	600641	万业企业	39,797,858.83	4.50
43	600196	复星医药	39,559,504.05	4.47
44	600717	天津港	38,196,621.76	4.32
45	000839	中信国安	37,990,315.67	4.29
46	600123	兰花科创	37,130,791.72	4.20
47	000522	白云山A	35,745,154.72	4.04
48	000046	泛海建设	34,981,957.75	3.95
49	600549	厦门钨业	34,561,081.59	3.91
50	600475	华光股份	33,334,460.20	3.77
51	600787	中储股份	32,969,564.61	3.73
52	600973	宝胜股份	32,865,309.96	3.71
53	600770	综艺股份	32,603,722.70	3.68
54	600348	国阳新能	31,774,743.53	3.59
55	600983	合肥三洋	30,767,271.46	3.48
56	000601	韶能股份	30,406,224.83	3.44
57	600456	宝钛股份	30,311,747.91	3.43
58	600660	福耀玻璃	30,058,226.74	3.40
59	600895	张江高科	29,186,823.30	3.30
60	000762	西藏矿业	28,135,930.56	3.18
61	600267	海正药业	26,410,263.27	2.98
62	000006	深振业A	26,109,120.12	2.95
63	601857	中国石油	26,001,535.87	2.94
64	000878	云南铜业	25,068,316.30	2.83
65	600739	辽宁成大	25,046,948.01	2.83
66	000527	美的电器	25,022,406.56	2.83
67	000422	湖北宜化	24,956,062.21	2.82
68	600496	精工钢构	24,860,887.77	2.81
69	600875	东方电气	24,322,074.13	2.75
70	600581	八一钢铁	24,000,026.40	2.71
71	600316	洪都航空	23,812,244.88	2.69
72	600893	航空动力	22,947,717.88	2.59
73	000960	锡业股份	22,706,343.24	2.57
74	000530	大冷股份	22,647,803.74	2.56
75	600703	三安光电	22,313,890.40	2.52
76	000932	华菱钢铁	22,292,846.47	2.52
77	600432	吉恩镍业	21,936,507.61	2.48
78	600271	航天信息	21,769,924.49	2.46
79	601899	紫金矿业	21,519,255.00	2.43
80	000777	中核科技	21,328,430.75	2.41
81	600048	保利地产	21,089,859.16	2.38
82	600258	首旅股份	20,824,808.26	2.35
83	600500	中化国际	20,612,656.43	2.33
84	600019	宝钢股份	20,539,064.61	2.32
85	600266	北京城建	20,191,697.34	2.28
86	600664	哈药股份	19,775,791.79	2.23
87	002091	江苏国泰	18,906,713.03	2.14
88	000708	大冶特钢	18,869,449.95	2.13
89	600388	龙净环保	18,809,262.42	2.13
90	000402	金融街	18,447,125.46	2.08
91	600321	国栋建设	18,255,443.37	2.06
92	000876	新希望	17,731,766.80	2.00
93	600295	鄂尔多斯	17,729,311.88	2.00

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位:人民币元

买入股票的成本(成交)总额	7,087,160,486.44
卖出股票的收入(成交)总额	5,300,170,844.65

7.5 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	289,915,000.00	7.41
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	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	289,915,000.00	7.41

7.6 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	0801092	08央票92	1,000,000	96,440,000.00	2.46
2	0801112	08央票112	500,000	48,575,000.00	1.24
3	0801106	08央票106	500,000	48,360,000.00	1.24
4	0801101	08央票101	500,000	48,295,000.00	1.23
5	0801095	08央票95	500,000	48,245,000.00	1.23

7.7 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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本基金本期投资的前十名证券中,无报告期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

7.9.2 本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库之外的股票。

7.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,052,242.80
2	应收证券清算款	251,498,808.59
3	应收股利	278,040.60
4	应收利息	9,552,954.77
5	应收申购款	21,828,987.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	285,211,034.56

7.9.4 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。

7.9.5 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 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
55,967	55,102.40	1,629,279,877.31	52.83%	1,454,636,268.97	47.17%

8.2 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	4,126,517.88	0.1338%

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008-04-30)基金份额总额	1,388,696,479.84
报告期期初基金份额总额	1,137,731,245.85
报告期期间基金总申购份额	3,206,655,300.69
报告期期间基金总赎回份额	-1,260,470,400.26
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	3,083,916,146.28

注:总申购份额含红利再投资、转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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、基金管理人:

(1)经兴业全球基金管理有限公司董事会2008年第一次会议审议通过,并经中国证监会核准,决定聘任兰荣先生担任公司董事长,郑苏芬女士不再担任公司董事长。

(2)经兴业全球基金管理有限公司董事会2008年第四次会议审议通过,并经中国证监会核准,决定聘任杨卫东先生和杜昌勇先生担任公司副总经理。

(3)经兴业全球基金管理有限公司董事会2009年第三次会议审议通过,并经中国证监会核准,决定聘任徐天舒先生担任公司副总经理。

(4)经兴业全球基金管理有限公司股东会2009年第二次会议审议通过,由Eric Rutten担任兴业全球基金管理有限公司董事,刘先觉不再担任公司董事。

2、基金托管人:

本报告期内,本基金基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	
兴业证券	2	6,594,361,885.67	53.28%	73,057,718.77	66.34%	
湘财证券	1	1,599,107,935.54	12.92%	-	-	
德邦证券	1	1,445,015,955.72	11.67%	30,047,630.40	27.28%	
华泰证券	2	378,882,118.19	3.06%	7,027,263.00	6.38%	
国泰君安	1	1,440,217,905.56	11.64%	-	-	新增1个
长江证券	1	920,065,530.41	7.43%	-	-	新增1个
华宝证券	2	-	-	-	-	新增2个
国元证券	1	-	-	-	-	
申银万国	1	-	-	-	-	新增1个
银河证券	1	-	-	-	-	新增1个

券商名称	回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金	
	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例
兴业证券	-	-	-	-	5,432,308.56	52.50%
湘财证券	-	-	-	-	1,359,239.79	13.14%
德邦证券	-	-	-	-	1,228,258.52	11.87%
华泰证券	-	-	-	-	322,048.00	3.11%
国泰君安	-	-	-	-	1,224,173.16	11.83%
长江证券	-	-	-	-	782,055.81	7.56%
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

注:根据中国证监会的有关规定,我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力的基础上,选择基金专用交易席位。

11 影响投资者决策的其他重要信息

1、2009年1月16日,基金托管人公告中国建设银行股份有限公司聘请胡哲一先生担任该行副行长;

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,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股份有限公司执行董事。

兴业全球基金管理有限公司

二〇〇九年八月二十六日