兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)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:兴业银行股份有限公司
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

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。

基金的托管人兴业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、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。

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及其更新。

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。

1.2 目录

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)
基金简称	兴业趋势投资混合(LOF)
交易代码	163402
前端交易代码	163402
后端交易代码	163403
基金运作方式	契约型上市开放式(LOF)
基金合同生效日	2005年11月3日
报告期末基金份额总额	18,613,704,858.90 份
基金份额上市的证券交易所	深交所
上市日期	2006-1-19

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金旨在把握投资对象中长期可测的确定收益,增加投资组合收益的确定性和稳定性;分享中国上市公司高速成长带来的资本增值;减少决策的失误率,实现最优化的风险调整后的投资收益。
投资策略	根据对股市趋势分析的结论实施灵活的大类资产配置;运用兴业多维趋势分析系统,对公司成长趋势、行业景气趋势和价格趋势进行分析,并运用估值把关来精选个股。在固定收益类证券投资方面,本基金主要运用"兴业固定收益证券组合优化模型",在固定收益资产组合久期控制的条件下追求最高的投资收益率。
业绩比较基准	中信标普 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金在混合型基金大类中属于强调控制风险,中高风险,中高回报的基金产品。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜建新	张志永
	联系电话	021-58368998	021-62677777
	电子邮箱	dujx@xyfunds.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4006780099,021-38824536	95561
传真		021-58368858	021-62159217

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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	报告期(2009 年 1 月 1 日 - 2009 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,793,867,185.02
本期利润	7,365,094,882.79
加权平均基金份额本期利润	0.3876
本期基金份额净值增长率	51.02%
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	0.1253
期末基金资产净值	21,338,944,037.55
期末基金份额净值	1.1464

注:1、上述财务指标采用的计算公式,详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号<主要财务指标的计算及披露>》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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,期末可供分配利润采用期末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。

3、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:开放式基金的申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	12.19%	0.97%	6.81%	0.59%	5.38%	0.38%
过去三个月	23.91%	1.16%	12.23%	0.76%	11.68%	0.40%
过去六个月	51.02%	1.32%	31.80%	0.95%	19.22%	0.37%
过去一年	24.09%	1.36%	11.75%	1.25%	12.34%	0.11%
过去三年	252.48%	1.53%	67.51%	1.20%	184.97%	0.33%
自基金合同生效起至今	500.62%	1.46%	115.57%	1.12%	385.05%	0.34%

注:本基金业绩比较基准为中信标普 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%,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。基于本基金的股票、债券和现金比例,选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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

兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2005 年 11 月 3 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《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的规定,本基金建仓期为 2005 年 11 月 3 日至 2006 年 5 月 2 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		
王晓明	兴业全球基金管理有限公司投资总监、本基金基金经理	2005-11-3	-	8年	王晓明先生,1974 年生,经济学硕士。历任上海中技投资顾问有限公司研究员、投资部经理、公司副总经理,兴业可转债混合型证券投资基金基金经理助理、兴业可转债混合型证券投资基金基金经理,兴业全球视野股票型证券投资基金基金经理。
张惠萍	本基金基金经理	2008-1-31	-	6年	张惠萍女士,1976 年生,经济学硕士。2002 年 6 月加入兴业基金管理有限公司(筹),历任兴业基金管理有限公司研究策划部行业研究员、兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金经理助理。

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守《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)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,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
兴业趋势投资混合(LOF)	51.02	31.80
兴业有机增长混合	1.88	14.72

兴业有机增长混合的基金合同于 09 年 3 月 25 日开始生效。截止 2009 年 6 月 30 日,兴业有机增长混合都处于建仓期之中,与兴业趋势投资混合(LOF)在业绩上不具备比较基础。

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

2009 年上半年 A 股市场上演几乎单边的上涨行情,其背后最主要的因素是两个:流动性在 6 月底之前的超预期释放;宏观经济的超预期复苏。首先,国家 4 万亿经济刺激计划提振了市场对宏观经济复苏的信心,尤其是在刚性需求的推动下出现了房地产、汽车销量的强劲复苏,这一步增强了市场对经济回暖的信心;其次,银行信贷资金持续大量投放,仅上半年就创出了 7.36 万亿的新增贷款,流动性的宽松使得通胀预期日益升温,股市和房市的泡沫成为可能;第三,宏观经济数据表现出逐月好转的迹象,盈利预测的不断上调也推动了股价的上涨;第四,海外市场股市在上半年的强劲反弹也为国内 A 股市场的上涨提供了良好的外部环境。而经过 2008 年的深幅调整,市场本身已经积聚了较强的反弹动力,在多重外在因素的共同作用下,市场出现了超过我们预期幅度的反弹。

09 年上半年,随着流动性逐渐释放以及经济复苏的不断演进,不同的板块先后表现出色,年初流动性释放刚刚开始,超跌反弹、4 万亿投资以及十大产业振兴规划受益板块、新能源相关板块、创业板受益板块、率先受益于宏观经济复苏的汽车以及股债较低的煤炭、有色等资源股的表现出色,围绕着日渐升温的通胀预期以及过多的流动性带来的资产价格泡沫预期,市场在二季度将焦点更多集中在房地产、金融、煤炭、有色等几大板块上。

尽管在 2009 年年初,我们估计到流动性将是今年行情的主推手,但我们对流动性释放的程度估计不足,同时基于对更长时间段内宏观经济可能会出现反复的担心,本基金延续了去年以来的较为谨慎的投资策略,我们提升了基金的股票仓位,但总体仓位水平仍然偏保守。在持仓结构上,兼顾了周期股和非周期股的平衡,相对均衡,防御类的行业始终占据基金资产的相当比重。上半年在周期股上我们增持的主要是煤炭、房地产、保险、钢铁等板块中的个股,同时我们也提升了医药生物占比较小的医药、食品饮料等防御性板块的比重,主题类投资方面主要是参与了部分新能源以及环保概念股、重组题材股、上海本地股等。值得反省的是我们对于流动性异常充裕情况下的反弹力度估计不足,所以构建的投资组合总体上偏稳健,并没有对一些热门板块进行很激进的配置,我相信,从长期来看稳健投资者会错失一些机会,但同样也会远离一些不必要的风险,只有坚持一贯的稳健、理性的投资理念,才能长期保证净值稳定增长。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

市场经过半年左右的大幅反弹,我们认为市场整体估值在剔除银行板块后 2009 年动态估值已经不低,如果一定要做一个判断,我们认为基本处于合理估值区间的上限。要推动市场整体继续上扬,需要更多超预期的因素出现,从流动性角度来讲,相对宽松的货币政策环境还能持续,但最宽松的时间已经过去,而过度依赖固定资产投资拉动的宏观经济,增长也会出现反复,并且会加剧投资者对长期产能过剩的担心。因此市场目前的估值水平,需要时间来验证已经包含在股价中的投资者较为乐观的预期,从而为市场继续上扬腾出空间。

宽松的信贷、通胀预期以及缺少足够的投资渠道,资金流向资本市场或房地产行业似乎是大概率事件,资产泡沫似乎不可避免地出现,但长期来看在泡沫上冲浪,鲜有赢家。因此我们将坚持一贯稳健理性的投资风格和理念,在 09 年下半年,行业上继续强调均衡配置,坚持自下而上挖掘个股的投资机会,我们相信随着流动性宽松的进一步演进,确定性增长将逐渐体现出溢价。

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给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。

本基金未签订任何与估值相关的定价服务。

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》、《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)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

本托管人依据《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)基金合同》与《兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)托管协议》,自 2005 年 11 月 3 日起托管兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)(以下称本基金)的全部资产。

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,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:兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)

报告截止日:2009 年 6 月 30 日

单位:人民币元

基金名称	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		1,705,747,496.13	632,225,957.44
结算备付金		24,831,568.71	28,091,114.62
存出保证金		6,819,180.24	3,750,000.00
交易性金融资产		19,493,137,516.37	14,521,819,276.75
其中:股票投资		16,877,908,887.64	7,608,231,244.96
债券投资		2,615,228,628.73	6,913,588,031.79
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		106,965,249.14	-
应收利息		72,103,274.03	165,584,329.44
应收股利		-	-
应收申购款		31,902,603.98	1,056,615.86
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		21,441,506,888.60	15,352,527,294.11
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		-	-
应付证券清算款		-	23,970,262.48
应付赎回款		58,962,493.40	14,649,541.01
应付管理人报酬		25,026,506.63	20,332,808.51
应付托管费		4,171,084.45	3,388,801.43
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		12,021,252.37	6,647,103.88
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		2,381,514.20	1,705,468.96
负债合计		102,562,851.05	70,693,986.27
所有者权益:			
实收基金		4,660,543,853.27	5,040,389,246.01
未分配利润		16,678,400,184.28	10,241,444,061.83
所有者权益合计		21,338,944,037.55	15,281,833,307.84
负债和所有者权益总计		21,441,506,888.60	15,352,527,294.11

注:报告截止日 2009 年 6 月 30 日,基金份额净值 1.1464 元,基金份额总额 18,613,704,858.90 份。

6.2 利润表

会计主体:兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)

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1月1日 - 2008年6月30日
一、收入		7,557,094,880.86	-7,575,593,888.44
1.利息收入		72,518,810.91	98,464,887.67
其中:存款利息收入		4,251,791.95	20,638,905.30
债券利息收入		68,267,018.96	74,005,092.72
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	3,820,889.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		1,910,303,815.18	1,400,360,290.52
其中:股票投资收益		1,782,253,568.63	1,328,170,992.79
债券投资收益		25,372,498.81	9,579,587.78
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-20,037,889.87
股利收益		102,677,747.74	82,647,599.82
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		5,571,227,697.77	-9,081,422,024.62
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)		3,044,557.00	7,002,957.99
二、费用(以"-"号填列)		-191,999,998.07	-272,918,192.15
1.管理人报酬		-132,036,766.99	-182,788,360.71
2.托管费		-22,006,127.88	-30,464,726.81
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-37,713,560.16	-52,274,323.22
5.利息支出		-10,079.75	-7,104,308.49
其中:卖出回购金融资产支出		-10,079.75	-7,104,308.49
6.其他费用		-233,463.29	-286,472.92
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		7,365,094,882.79	-7,848,512,080.59
所得税费用(以"-"号填列)		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列		7,365,094,882.79	-7,848,512,080.59

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)

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)	5,040,389,246.01	10,241,444,061.83	15,281,833,307.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,365,094,882.79	7,365,094,882.79
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)	-379,845,392.74	-928,138,760.34	-1,307,984,153.08
其中:1.基金申购款	548,254,981.71	1,651,576,945.37	2,199,831,927.08
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-928,100,374.45	-2,579,715,705.71	-3,507,816,080.16
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	4,660,543,853.27	16,678,400,184.28	21,338,944,037.55
项目	上年度可比期间 2008年1月1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)	4,927,188,076.63	21,579,797,162.40	26,506,985,239.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-7,848,512,080.59	-7,848,512,080.59
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)	183,012,236.38	1,007,789,330.99	1,190,801,567.37
其中:1.基金申购款	1,423,757,662.20	5,663,883,856.06	7,087,641,518.26
2.基金赎回款(以"-"号填列)	-1,240,745,425.82	-4,656,094,525.07	-5,896,839,950.89
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)	5,110,200,313.01	14,739,074,412.80	19,849,274,725.81

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)(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")证监基金字[2005]156 号文《关于同意兴业趋势投资混合型证券投资基金(LOF)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")作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于 2005 年 11 月 3 日正式生效,首次设立募集规模为 927,645,098.72 份基金份额。本基金为契约型上市开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为兴业全球基金管理有限公司,注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行、上市交易的股票和固定收益证券(包括各种债券和货币市场工具)以及中国证监会规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。本基金的业绩比较基准为:中标 300 指数×50%+中信国债指数×45%+同业存款利率×5%。

2007 年 5 月 11 日,本基金管理人兴业全球基金管理有限公司对本基金进行了基金份额拆分。拆分后基金份额面值为人民币 0.2504 元。

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》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《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企业所得税;

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、储蓄存款利息收入,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(以下简称"兴业基金")	基金管理人、基金发起人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(以下简称"兴业银行")	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1月1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	6,774,808,531.75	26.93%	5,037,861,830.27	32.54%

6.4.7.1.2 权证交易

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1月1日 - 2008年6月30日	
	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	46,152,677.01	14.51%

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1月1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	65,860,248.93	36.60%	-	-

6.4.7.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

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	5,625,130.97	26.63%	910,932.74	7.58%
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1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	4,265,410.09	32.65%	1,419,277.15	23.86%

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1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的管理费	132,036,766.99	182,788,360.71
其中:当期已支付	107,010,260.36	157,120,459.82
期末未支付	25,026,506.63	25,667,900.89

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1月1日 - 2008年6月30日
当期应支付的托管费	22,006,127.88	30,464,726.81
其中:当期已支付	17,835,043.43	26,186,743.33
期末未支付	4,171,084.45	4,277,983.48

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

本基金 2009 年上半年度及 2008 年上半年度末与关联方在银行间市场进行债券(含回购)交易。

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1月1日 - 2008年6月30日
期初持有的基金份额	22,722,022.17	22,722,022.17
期间认购总份额	-	-
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	-22,722,022.17	-
期末持有的基金份额	-	22,722,022.17
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.11%

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2009 年上半年度和 2008 年度均未投资本基金。

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1月1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
兴业银行	1,705,747,496.13	3,954,258.54	3,572,719,084.78	20,473,419.40

6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

本期 2009年1月1日 - 2009年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2008年1月1日 - 2008年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:股/张)	总金额
兴业证券	110368	五洲转债	网下申购	10,880	1,088,000.00
兴业证券	110368	五洲转债	网上申购	10,880	1,088,000.00

注:兴业证券为"五洲转债"的副主承销商。

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

金额单位:人民币元

6.4.11.1.1 受限证券类别:股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600844	丹化科技	2009-5-11	2010-5-7	非公开发行	12.98	13.89	6,000,000	778,800,000.00	83,340,000.00

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
000400	许继电气	2009-6-5	重大事项	18.28	2009-7-6	20.11	3,000,000	47,640,000.00	54,840,000.00
600607	上实医药	2009-6-18	重大事项	19.33	-	-	1,999,916	33,778,383.92	38,658,376.28
600849	上海医药	2009-6-18	重大事项	12.18	-	-	10,413,410	116,707,473.05	126,835,333.80

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	16,877,908,887.64	78.72
	其中:股票	16,877,908,887.64	78.72
2	固定收益投资	2,615,228,628.73	12.20
	其中:债券	2,615,228,628.73	12.20
	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	1,730,579,064.84	8.07
6	其他资产	217,790,307.39	1.02
7	合计	21,441,506,888.60	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	1,701,386,383.49	7.97
C	制造业	5,613,359,051.66	26.31
C0	食品、饮料	1,446,205,960.59	6.78
C1	纺织、服装、皮毛	47,112,312.50	0.22
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	38,344,560.10	0.18
C4	石油、化学、塑胶、塑料	699,863,152.31	3.28
C5	电子	24,447,555.00	0.11
C6	金属、非金属	1,403,907,290.70	6.58
C7	机械、设备、仪表	370,052,904.30	1.73
C8	医药、生物制品	1,517,458,623.11	7.11
C99	其他制造业	65,966,693.05	0.31
D	电力、煤气及水的生产和供应业	441,751,764.26	2.07
E	建筑业	944,239,808.99	4.42
F	交通运输、仓储业	161,924,591.18	0.76
G	信息技术业	963,916,592.70	4.52
H	批发和零售贸易	523,132,732.11	2.45
I	金融、保险业	5,042,410,562.00	23.63
J	房地产业	1,295,538,665.48	6.07
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	190,248,735.77	0.89
	合计	16,877,908,887.64	79.09

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	600036	招商银行	79,580,365	1,783,395,979.65	8.36
2	600016	民生银行	206,000,000	1,631,520,000.00	7.65
3	000002	万 科 A	57,068,137	727,618,746.75	3.41
4	601390	中国中铁	105,435,685	715,908,301.15	3.35
5	600000	浦发银行	26,000,000	598,520,000.00	2.80
6	601398	工商银行	93,424,592	506,361,288.64	2.37
7	600309	烟台万华	31,586,503	498,119,152.31	2.33
8	600519	贵州茅台	3,045,270	450,730,412.70	2.11
9	600019	宝钢股份	63,569,853	447,531,765.12	2.10
10	600050	中国联通	59,966,846	411,372,563.56	1.93

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	000629	攀钢钢钒	736,726,045.61	4.82
2	000002	万 科 A	729,950,158.42	4.78
3	601390	中国中铁	455,527,731.52	2.98
4	601398	工商银行	447,788,717.81	2.93
5	600019	宝钢股份	403,803,440.28	2.64
6	600276	恒瑞医药	376,966,027.00	2.47
7	601899	紫金矿业	348,824,699.97	2.28
8	600383	金地集团	333,668,833.82	2.18
9	600050	中国联通	318,850,965.16	2.09
10	600519	贵州茅台	305,251,784.67	2.00
11	600036	招商银行	287,548,728.72	1.88
12	600030	中信证券	283,060,975.38	1.85
13	600808	马钢股份	275,150,424.53	1.80
14	601328	交通银行	251,648,341.11	1.65
15	600016	民生银行	248,352,944.21	1.63
16	000895	双汇发展	229,536,776.00	1.50
17	600309	烟台万华	224,754,337.06	1.47
18	601919	中国远洋	212,672,048.32	1.39
19	601186	中国铁建	198,451,343.10	1.30
20	002024	苏宁电器	189,122,361.77	1.24

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	600000	浦发银行	816,444,556.67	5.34
2	000629	攀钢钢钒	779,302,701.00	5.10
3	600383	金地集团	531,478,429.82	3.48
4	601666	平煤股份	414,105,157.82	2.71
5	600036	招商银行	403,181,209.57	2.64
6	601318	中国平安	364,593,990.90	2.39
7	600005	武钢股份	336,905,455.33	2.20
8	601001	大同煤业	323,193,293.31	2.11
9	600030	中信证券	271,153,084.67	1.77
10	000983	西山煤电	263,836,266.31	1.73
11	600348	国阳新能	253,033,300.01	1.66
12	600586	金晶科技	251,031,261.86	1.64
13	000839	中信国安	246,164,961.30	1.61
14	601699	潞安环能	242,646,888.66	1.59
15	600019	宝钢股份	241,281,055.76	1.58
16	600123	兰花科创	239,221,519.12	1.57
17	600016	民生银行	231,825,758.85	1.52
18	000002	万 科 A	229,955,216.44	1.50
19	601628	中国人寿	178,345,073.53	1.17
20	601919	中国远洋	149,354,063.75	0.98

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	13,540,626,629.27
卖出股票的收入(成交)总额	11,695,568,433.69

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	1,830,530,000.00	8.58
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	762,887,190.14	3.58
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	21,811,438.59	0.10
7	其他	-	-
8	合计	2,615,228,628.73	12.26

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	10,000,000	964,400,000.00	4.52
2	0801084	08央票 84	5,000,000	481,400,000.00	2.26
3	126018	08江铜债	3,984,660	290,601,253.80	1.36
4	0801078	08央票 78	3,000,000	288,510,000.00	1.35
5	126011	08石化债	2,084,140	180,569,889.60	0.85

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	6,819,180.24
2	应收证券清算款	106,965,249.14
3	应收股利	-
4	应收利息	72,103,274.03
5	应收申购款	31,902,603.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	217,790,307.39

7.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	125709	唐钢转债	21,811,438.59	0.10

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
677,340	27,480.59	2,158,023,347.64	11.59%	16,455,681,511.26	88.41%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司分红账户	19,969,505.00	2.49%
2	苏冰	4,310,000.00	0.54%
3	林丽萍	2,789,120.00	0.35%
4	成素梅	2,603,600.00	0.33%
5	林日昇	2,215,266.00	0.28%
6	林正雄	2,209,127.00	0.28%
7	吴向东	2,000,000.00	0.25%
8	叶凤	1,954,366.00	0.24%
9	黄建鹏	1,650,000.00	0.21%
10	蒋月仙	1,650,000.00	0.21%

注:持有人为 LOF 基金场内持有人。

8.3 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	244,288.11	0.0013%

9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2005-11-03)基金份额总额	927,645,098.72
报告期期初基金份额总额	20,130,765,832.39
报告期期间基金总申购份额	2,189,684,813.82
报告期期间基金总赎回份额	-3,706,745,787.31
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	18,613,704,858.90

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

10.2.1 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。

10.2.2 基金托管人:

本报告期内,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到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	6,774,808,531.75	26.93%	65,860,248.93	36.60%	
招商证券	1	2,113,631,476.02	8.40%	31,785,788.16	17.66%	
国元证券	1	849,171,591.76	3.38%	-	-	
申银万国	1	6,970,671,616.70	27.71%	59,843,698.63	33.25%	
中金公司	1	2,317,119,551.02	9.21%	12,798,083.51	7.11%	
海通证券	2	2,050,869,023.11	8.15%	3,024,146.85	1.68%	
安信证券	2	591,612,728.07	2.35%	6,654,296.68	3.70%	
国金证券	1	1,965,436,910.77	7.81%	-	-	
民族证券	1	326,296,713.08	1.30%	-	-	
东北证券	2	135,963,713.35	0.54%	-	-	
光大证券	1	714,823,296.64	2.84%	-	-	新增 1 个
民生证券	2	347,909,910.69	1.38%	-	-	新增 2 个
东方证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国海证券	1	-	-	-	-	
金元证券	1	-	-	-	-	
联合证券	1	-	-	-	-	
中信建投	2	-	-	-	-	
中信证券	1	-	-	-	-	
中银国际	1	-	-	-	-	

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	-	-	-	-	5,625,130.97	26.63%
招商证券	-	-	-	-	1,796,576.34	8.51%
国元证券	-	-	-	-	689,952.52	3.27%
申银万国	-	-	-	-	5,925,027.52	28.05%
中金公司	-	-	-	-	1,969,549.71	9.33%
海通证券	-	-	-	-	1,682,037.34	7.96%
安信证券	-	-	-	-	489,931.21	2.32%
国金证券	-	-	-	-	1,670,615.91	7.91%
民族证券	-	-	-	-	265,119.33	1.26%
东北证券	-	-	-	-	115,568.90	0.55%
光大证券	-	-	-	-	607,595.08	2.88%
民生证券	-	-	-	-	282,678.40	1.34%
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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。

兴业全球基金管理有限公司

二〇〇九年八月二十六日