兴业可转债混合型证券投资基金

2009 年年度报告

2009 年 12 月 31 日

基金管理人：兴业全球基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年三月二十七日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告期自 2009 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....1
§2 基金简介.....3
2.1 基金基本情况.....3
2.2 基金产品说明.....3
2.3 基金管理人和基金托管人.....3
2.4 信息披露方式.....4
2.5 其他相关资料.....4
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....4
3.1 主要会计数据和财务指标.....4
3.2 基金净值表现.....5
3.3 过去三年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
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....12

§5 托管人报告.....12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....12
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.....12
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.....12
§6 审计报告.....13
6.1 管理层对财务报表的责任.....13
6.2 注册会计师的责任.....13
6.3 审计意见.....14
§7 年度财务报表.....14
7.1 资产负债表.....14
7.2 利润表.....15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....16
7.4 报表附注.....17
§8 投资组合报告.....42
8.1 期末基金资产组合情况.....42
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....43
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....45
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....47
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....48
8.7 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.....48
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....48
8.9 投资组合报告附注.....48
§9 基金份额持有人信息.....49
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....49
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.....49
§10 开放式基金份额变动.....50
§11 重大事件揭示.....50
11.1 基金份额持有人大会决议.....50
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.....50
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....51
11.4 基金投资策略的改变.....51
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....51
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.....51
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....51
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....58
§13 备查文件目录.....58

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴业可转债混合型证券投资基金
基金简称	兴业可转债混合
基金主代码	340001
交易代码	340001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004 年 5 月 11 日
基金管理人	兴业全球基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,422,322,487.49 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在锁定投资组合下方风险的基础上，以有限的期权成本获取基金资产的长期稳定增值。
投资策略	基金的资产配置采用自上而下的程序，个券和个股选择采用自下而上的程序，并严格控制投资风险。在个券选择层面，积极参与发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债的一级市场申购；选择对应的发债公司具有良好发展潜力或基础股票有着较高上涨预期的可转债进行投资，以有效规避市场风险，并充分分享股市上涨的收益；运用“兴业可转债评价体系”，选择定价失衡的个券进行投资，实现低风险的套利。在个股选择层面，以“相对投资价值”判断为核心，选择所处行业发展前景良好、价值被相对低估的股票进行投资。
业绩比较基准	80%×天相可转债指数 + 15%×中信标普 300 指数 + 5%×同业存款利率
风险收益特征	本基金的风险水平处于市场低端，收益水平处于市场中高端。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杜建新	蒋松云
	联系电话	021-58368998	010-66105799
	电子邮箱	dujx@xyfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006780099，021-38824536	95588

传真	021-58368858	010-66105798
注册地址	上海市黄浦区金陵东路368号	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	上海市张杨路500号时代广场20楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	200122	100140
法定代表人	兰荣	姜建清

注：2009 年 3 月 12 日起，基金管理人法定代表人变更为兰荣。

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.xyfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	上海市静安区南京西路1601号越洋广场29楼
注册登记机构	兴业全球基金管理有限公司	上海市浦东新区张杨路500号时代广场20楼

§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	2007 年
本期已实现收益	518,408,497.55	259,269,739.73	1,522,670,935.86
本期利润	822,146,983.33	-496,666,066.49	1,878,458,039.83
加权平均基金份额本期利润	0.3386	-0.2564	1.0312
本期加权平均净值利润率	28.11%	-22.83%	69.47%
本期基金份额净值增长率	35.21%	-19.65%	113.44%
3.1.2 期末数据和指标	**2009 年末**	**2008 年末**	**2007 年末**

期末可供分配利润	110,409,252.17	-105,631,808.91	43,642,858.84
期末可供分配基金份额利润	0.0456	-0.0533	0.0238
期末基金资产净值	3,052,404,840.02	2,014,888,384.18	2,730,601,874.70
期末基金份额净值	1.2601	1.0169	1.4889
3.1.3 累计期末指标	**2009 年末**	**2008 年末**	**2007 年末**
基金份额累计净值增长率	315.30%	207.14%	282.26%

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。

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
过去三个月	9.54%	0.75%	11.33%	0.95%	-1.79%	-0.20%
过去六个月	9.28%	1.01%	3.28%	1.83%	6.00%	-0.82%
过去一年	35.21%	0.80%	37.37%	1.46%	-2.16%	-0.66%
过去三年	131.89%	0.99%	58.69%	1.51%	73.20%	-0.52%
过去五年	328.15%	0.87%	154.37%	1.23%	173.78%	-0.36%
自基金合同生效起至今	315.30%	0.82%	143.11%	1.16%	172.19%	-0.34%

注：本基金业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：选取天相可转债指数和中信标普 300 指数分别作为可转债业绩和股票业绩的比较基准。“天相可转债指数”是国内较早编制的可转债指数，编制原则具有严肃性，能够较好的反映可转债市场变化。中信标普 300 指数代表效果较好。

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：

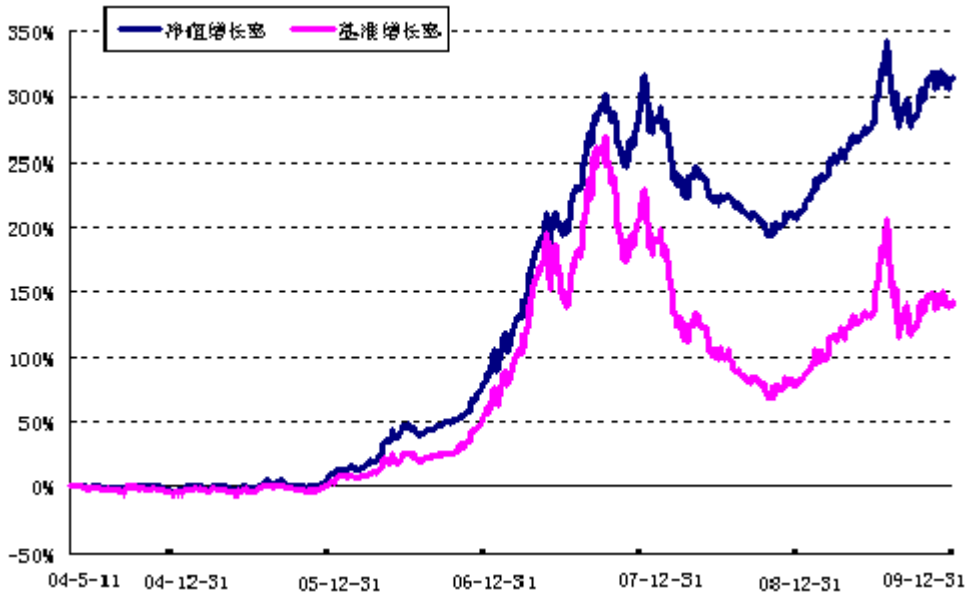
Return t =80%×（天相可转债指数 t / 天相可转债指数 t-1-1） +15％×（中信标普 300 指数 t / 中信标普 300 指数 t-1 -1）+5%×（同业存款利率 t / 同业存款利率 t-1 -1)

Benchmark t =（1+Return t）×Benchmark t-1

其中，t=1,2,3,… T，T 表示时间截至日。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

兴业可转债混合型证券投资基金
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
（2004 年 5 月 11 日至 2009 年 12 月 31 日）



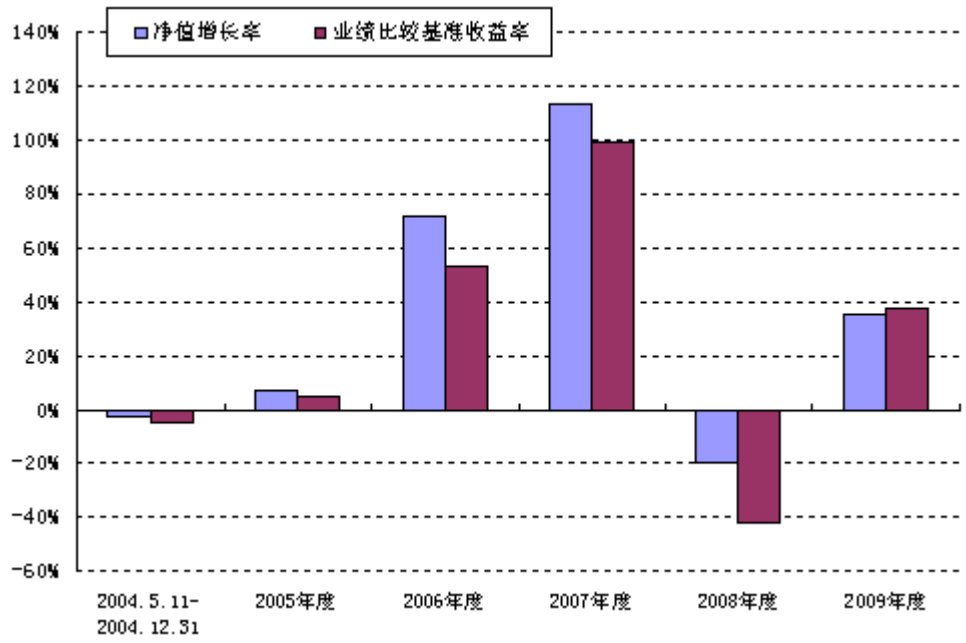
注：1、净值表现所取数据截至到 2009 年 12 月 31 日。

2、按照《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2004 年 5 月 11 日至 2004 年 11 月 10 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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴业可转债混合型证券投资基金

过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：2004 年 5 月 11 日至 2004 年 12 月 31 日期间的数据按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

金额单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009	1.120	66,709,976.79	213,537,201.46	280,247,178.25	-
2008	2.220	52,671,888.87	353,768,971.40	406,440,860.27	-
2007	8.360	324,224,765.92	1,177,865,600.39	1,502,090,366.31	-
合计	11.700	443,606,631.58	1,745,171,773.25	2,188,778,404.83	-

§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 12 月 31 日，公司旗下管理着七只基金，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、兴业磐稳增利债券型证券投资基金。

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		
杨云	本基金基金经理	2007-02-06	-	6 年	1974 年生，理学硕士，历任申银万国证券研究所金融工程部、策略部研究员，主要从事可转债研究；兴业可转债混合型证券投资基金的基金经理助理。

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、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。

3、“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、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，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

目前，本基金管理人管理的投资组合中没有与本基金投资风格相似的投资组合，暂无法对本基金的投资业绩进行比较。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2009 年，本基金收益相对不高的主要原因有：1、年初可转债处在相对便宜的水平，本基金转债仓位虽然有所提高，但受制于市场规模和流动性等因素的影响，仓位提升不够明显，或者说市场很好的建仓时间段不是很长，因此在上半年可转债的主要上涨阶段，本基金明显跟不上市场涨幅；2、2009 年市场的大波段操作机会较为明显，比如在 8 月份初的见顶回调，虽然本基金有所行动，但仓位的控制和调整不够显著。

转债操作上，本基金主要是在年初增仓不够积极，市场并没有在便宜的情况

下给与充足的加仓时间，而 2009 年在疯狂的阶段，转债在估值上甚至超过了 2008 年，以至于在 8 月份的下跌中，转债指数跌幅超过股票指数。在 7 月份见顶随后的下跌中，本基金对转债仓位的把握相对较好。在债券操作上，本基金在年初即认识到经过 2008 年的大幅上涨后，债券绝对收益率水平已不具有吸引力，因此在操作上较为谨慎，持仓主要以短期央票为主。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本年度累计净值增长率为 35.21%，同期业绩比较基准收益率为 37.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入 2010 年后，提前市场预期的宏观调控迅速到来，在 1、2 月份，央行即两次上调了存款准备金率，从历史经验来看，通常调控行为的出台往往会滞后于市场的预期，但今年明显例外，说明央行对后续包括经济局部过热和通货膨胀是非常警惕的，而股市在货币紧缩的环境下通常是很难有较好机会的。如果再考虑目前中小市值公司估值显著偏高，而大市值公司在资金逐步收紧的情况下同样难有好的机会。从宏观的惯性来看，我们估计央行的货币紧缩政策可能持续 6 个月左右，可能导致上半年股市都将不会有较好的机会，而下半年，随着紧缩政策逐步结束，金融危机后经济内生的可持续增长将开始显现出来，股市在下半年可能存在相对更好的机会。

转债市场在 2010 年将迎来快速的扩容基本上是确定的事情，在供给显著增加后，转债的高估值状况可能得到较大的改善，从而变的相对具有较好的吸引力，因此，转债市场随着转债扩容后将出现估值回归的较好机会。在未来，兴业转债基金将秉承一贯的稳健风格，在契约规定范围内努力为投资者创造较好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总和分析。

2、定期撰写风险管理报告：每个季度结束之后，由公司监察稽核部对本基

金的流动性进行压力测试，同时对本基金进行全面的风险评价，并形成书面报告。此外，在对本基金异常交易进行实时监测的基础上，每个季度出具一份异常交易报告。

3、加强对公平交易的监督：根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司在 2009 年进一步加强了对公平交易的监督。对本基金所有投资品种以及本基金投资管理活动的各个环节进行了全面监控和评估，坚决杜绝利益输送等损害基金持有人利益的行为发生。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司监察稽核部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《基金法》、《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次，收益分配比例不低于净收益的 90%，收益分配后基金份额净值不能低于面值。本报告期内本基金已实施利润分配 3 次，共分配利润 280,247,178.25 元，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

2009 年，本基金托管人在对兴业可转债混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

2009 年，兴业可转债混合型证券投资基金的管理人——兴业全球基金管理有限公司在兴业可转债混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，兴业可转债混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了三次利润分配，分配金额为 280,247,178.25 元。

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

本托管人依法对兴业全球基金管理有限公司编制和披露的兴业可转债混合型证券投资基金 2009 年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

安永华明（2010）审字第 60467611_B01 号

兴业可转债混合型证券投资基金全体基金份额持有人:

我们审计了后附的兴业可转债混合型证券投资基金（以下简称“兴业可转债基金”）财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表和 2009 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则的规定编制财务报表是兴业可转债基金的基金管理人兴业全球基金管理有限公司的责任。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人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，兴业可转债基金财务报表已经按照企业会计准则的规定编制，在所有重大方面公允反映了兴业可转债基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和净值变动情况。

安永华明会计师事务所　　注册会计师 严盛炜 戴维维

中国 北京

2010-03-26

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴业可转债混合型证券投资基金

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
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	200,690,706.97	193,172,735.58
结算备付金		4,127,311.22	723,402.29
存出保证金		2,600,800.55	1,098,780.49
交易性金融资产	7.4.7.2	2,793,047,537.94	1,770,489,507.40
其中：股票投资		818,457,985.90	193,048,433.88
基金投资		-	-
债券投资		1,974,589,552.04	1,577,441,073.52
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		57,087,879.62	22,080,264.44
应收利息	7.4.7.5	6,140,282.19	21,196,570.49
应收股利		-	-
应收申购款		2,762,745.33	15,179,673.33
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,066,457,263.82	2,023,940,934.02
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2009年12月31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		-	1,458,801.20
应付赎回款		6,099,081.75	3,173,659.80
应付管理人报酬		3,386,897.26	2,192,894.73
应付托管费		651,326.40	421,710.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	2,791,467.30	695,740.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,123,651.09	1,109,742.72
负债合计		14,052,423.80	9,052,549.84
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,422,322,487.49	1,981,317,338.37
未分配利润	7.4.7.10	630,082,352.53	33,571,045.81
所有者权益合计		3,052,404,840.02	2,014,888,384.18
负债和所有者权益总计		3,066,457,263.82	2,023,940,934.02

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.2601 元，基金份额总额 2,422,322,487.49 份。

7.2 利润表

会计主体：兴业可转债混合型证券投资基金

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12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入		**886,745,786.63**	**-453,517,347.63**
1.利息收入		33,148,741.07	28,663,450.52
其中：存款利息收入	7.4.7.11	3,796,034.50	3,459,428.43
债券利息收入		29,326,706.57	24,627,050.07

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		26,000.00	576,972.02
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		548,268,797.31	273,130,748.00
其中：股票投资收益	7.4.7.12	321,801,481.11	177,568,433.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	220,832,880.51	78,313,348.04
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	836,540.45	14,066,617.69
股利收益	7.4.7.15	4,797,895.24	3,182,348.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	303,738,485.78	-755,935,806.22
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,589,762.47	624,260.07
减：二、费用		**64,598,803.30**	**43,148,718.86**
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	37,754,749.93	28,373,161.54
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,260,528.80	5,456,377.23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	18,687,185.71	8,223,433.43
5. 利息支出		570,845.05	770,261.75
其中：卖出回购金融资产支出		570,845.05	770,261.75
6. 其他费用	7.4.7.19	325,493.81	325,484.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**822,146,983.33**	**-496,666,066.49**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列		822,146,983.33	-496,666,066.49

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴业可转债混合型证券投资基金

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）	1,981,317,338.37	33,571,045.81	2,014,888,384.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	822,146,983.33	822,146,983.33
三、本期基金份额交易产生的	441,005,149.12	54,611,501.64	495,616,650.76

基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,743,207,838.30	337,346,413.48	2,080,554,251.78
2.基金赎回款	-1,302,202,689.18	-282,734,911.84	-1,584,937,601.02
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）	-	-280,247,178.25	-280,247,178.25
五、期末所有者权益（基金净值）	2,422,322,487.49	630,082,352.53	3,052,404,840.02
项目	**上年度可比期间** 2008年1月1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）	1,833,945,667.94	896,656,206.76	2,730,601,874.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-496,666,066.49	-496,666,066.49
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）	147,371,670.43	40,021,765.81	187,393,436.24
其中：1.基金申购款	770,334,998.63	114,364,360.00	884,699,358.63
2.基金赎回款	-622,963,328.20	-74,342,594.19	-697,305,922.39
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）	-	-406,440,860.27	-406,440,860.27
五、期末所有者权益（基金净值）	1,981,317,338.37	33,571,045.81	2,014,888,384.18

报告附注为财务报表的组成部分

本报告序号从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：兰荣，主管会计工作负责人：杨东，会计机构负责人：詹鸿飞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴业可转债混合型证券投资基金(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”）证监基金字[2004]27 号文《关于同意兴业可转债混合型证券投资基金设立的批复》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 2004 年 5 月 11 日正式生效，首次设立募集规模为 3,282,404,810.93 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为及注册登记机构为兴

业全球基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市的可转换公司债券、股票、国债，以及法律法规允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：80%×天相可转债指数＋15%×中信标普 300 指数＋5%×同业存款利率。

7.4.2 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、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了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》、《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>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2009 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1)金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

(2)金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方(转入方)；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

(1)股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资，股票投资成本，按成交日应支付的全部

价款扣除交易费用入账;

卖出股票于成交日确认股票投资收益,卖出股票的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本,按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账,其中所包含的债券应收利息单独核算,不构成债券投资成本;

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,按上述会计处理方法核算;

卖出债券于成交日确认债券投资收益;

卖出债券的成本按移动加权平均法结转;

(3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账;

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益,卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转;

(4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日,按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本,按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本;

上市后,上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算;

(5)回购协议

基金持有的回购协议(封闭式回购),以成本列示,按实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时,也可以用合同利率)在实际持有期间内逐日计提利息。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。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。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

1) 股票投资

(1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票的初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票的初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理；

2) 债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2)证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价

中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3)未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4)在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

3)权证投资

(1)上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2)未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3)因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

4)分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3)中的相关原则进行估值；

5)其他

(1)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2)如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此

以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/(损失)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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示;

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提;

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提;

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提;

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账;

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 1.30%的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3) 卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4) 其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益分配采用现金方式，投资者可选择获取现金红利或者将现金红利按红利权益登记日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资（下称“再投资方式”）；如果投资者没有明示选择，则视为选择现金分红方式；

(2) 在满足分配条件下，本基金收益每年至少分配一次。成立不满 3 个月，则不进行收益分配。期中分配由基金管理人另行公告，年度分配在基金会计年度结束后 4 个月内完成；

(3) 基金当年收益弥补上一年度亏损后，才可进行当年收益分配；

(4) 如果基金投资当期出现亏损，则可不进行收益分配；

(5) 基金收益分配比例不低于净收益的 90%；

(6) 基金中每一基金份额享有同等分配权；

(7) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

(8) 上述规定若根据国家法律、法规以及中国证监会规定发生调整时，经中国证监会核准后公告，无须召开持有人大会；

(9) 法律、法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

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的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1.印花税

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。

2.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。

3.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。

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	200,690,706.97	193,172,735.58
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计	200,690,706.97	193,172,735.58

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		748,156,577.16	818,457,985.90	70,301,408.74
债券	交易所市场	1,242,410,826.16	1,379,169,552.04	136,758,725.88
	银行间市场	595,304,400.00	595,420,000.00	115,600.00
	合计	1,837,715,226.16	1,974,589,552.04	136,874,325.88

资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,585,871,803.32	2,793,047,537.94	207,175,734.62
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		208,128,442.69	193,048,433.88	-15,080,008.81
债券	交易所市场	1,178,384,515.87	1,093,841,073.52	-84,543,442.35
	银行间市场	480,539,300.00	483,600,000.00	3,060,700.00
	合计	1,658,923,815.87	1,577,441,073.52	-81,482,742.35
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		1,867,052,258.56	1,770,489,507.40	-96,562,751.16

7.4.7.3 买入返售金融资产

7.4.7.3.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

7.4.7.3.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

7.4.7.4 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	116,767.42	31,382.06
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	1,444.60	325.52
应收债券利息	6,022,035.57	21,164,818.42
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
其他	34.60	44.49
合计	6,140,282.19	21,196,570.49

7.4.7.5 其他资产

本基金 2009 年年末及 2008 年年末均未持有其他资产。

7.4.7.6 应付交易费用

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
交易所市场应付交易费用	2,789,398.80	695,390.87
银行间市场应付交易费用	2,068.50	350.00
合计	2,791,467.30	695,740.87

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	1,000,000.00	1,000,000.00
应付赎回费	19,913.71	9,325.28
应付转换费	3,737.38	417.44
预提审计费	100,000.00	100,000.00
合计	1,123,651.09	1,109,742.72

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	1,981,317,338.37	1,981,317,338.37
本期申购	1,743,207,838.30	1,743,207,838.30
本期赎回（以“-”号填列）	-1,302,202,689.18	-1,302,202,689.18
本期末	2,422,322,487.49	2,422,322,487.49

注：申购含红利再投资、转入转换份额，赎回含转换转出份额。

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	-105,631,808.91	139,202,854.72	33,571,045.81
本期利润	518,408,497.55	303,738,485.78	822,146,983.33
本期基金份额交易产生的变动数	-22,120,258.22	76,731,759.86	54,611,501.64
其中：基金申购款	-13,755,167.72	351,101,581.20	337,346,413.48
基金赎回款	-8,365,090.50	-274,369,821.34	-282,734,911.84
本期已分配利润	-280,247,178.25	-	-280,247,178.25
本期末	110,409,252.17	519,673,100.36	630,082,352.53

7.4.7.10 存款利息收入

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1月1日至2008年12月31日
活期存款利息收入	3,697,254.22	3,414,083.59
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	62,918.23	32,762.10
其他	35,862.05	12,582.74
合计	3,796,034.50	3,459,428.43

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

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1月1日至2008年12月31日
卖出股票成交总额	6,267,060,520.97	2,015,370,291.80
减：卖出股票成本总额	5,945,259,039.86	1,837,801,857.99
买卖股票差价收入	321,801,481.11	177,568,433.81

7.4.7.12 债券投资收益

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1月1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	2,795,485,530.57	1,614,401,732.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,524,367,666.52	1,523,198,410.92
减：应收利息总额	50,284,983.54	12,889,973.10
债券投资收益	220,832,880.51	78,313,348.04

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

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1月1日至2008年12月31日
卖出权证成交总额	2,333,842.56	25,799,202.76
减：卖出权证成本总额	1,497,302.11	11,732,585.07
买卖权证差价收入	836,540.45	14,066,617.69

7.4.7.14 股利收益

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1月1日至2008年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,797,895.24	3,182,348.46
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,797,895.24	3,182,348.46

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
1. 交易性金融资产	303,738,485.78	-744,772,216.43
——股票投资	85,381,417.55	-396,928,937.32
——债券投资	218,357,068.23	-347,843,279.11
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2. 衍生工具	-	-11,163,589.79
——权证投资	-	-11,163,589.79
3.其他	-	-
合计	303,738,485.78	-755,935,806.22

7.4.7.16 其他收入

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1月1日至2008年12月31日
基金赎回费收入	1,264,440.04	516,897.27
转换费收入	311,371.61	96,938.64
其他	13,950.82	10,424.16
合计	1,589,762.47	624,260.07

7.4.7.17 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1月1日至2008年12月31日
交易所市场交易费用	18,680,285.71	8,220,708.43
银行间市场交易费用	6,900.00	2,725.00

合计	18,687,185.71	8,223,433.43

7.4.7.18 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1月1日至2008年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	200,000.00	200,000.00
银行汇划费	7,493.81	7,484.91
帐户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	325,493.81	325,484.91

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2010 年 1 月 19 日对本基金份额持有人按每 10 份基金份额分配人民币 0.48 元进行分红，实际分配收益为人民币 115,741,893.70 元。

除以上情况外，无其他需要说明的资产负债表日后的非调整事项。

7.4.9 关联方关系

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“兴业全球基金”）	基金发起人、基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（以下简称“工商银行”）	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
全球人寿保险国际公司（AEGON International N.V）	基金管理人的股东

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。

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

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
兴业证券	712,951,571.5	5.99%	697,847,729.81	23.95%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金 2009 年度及 2008 年度均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	198,744,259.89	10.43%	452,469,819.91	21.98%

7.4.10.1.4 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日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31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	300,000,000.0	100.00%	-	-

7.4.10.1.5 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日至2009年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	609,643.52	6.03%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	616,687.66	23.75%	511,048.85	73.49%

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上海证券交易所买(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。

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 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	37,754,749.93	28,373,161.54
其中：支付销售机构的客户维护费	5,259,998.96	3,832,613.44

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30%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×1.30%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

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1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,260,528.80	5,456,377.23

注：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。

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 2009 年度及 2008 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固有资金投资本基金的情况

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 1 月 1 日至 2008 年 12 月 31 日
期初持有的基金份额	89,995,685.25	76,380,390.73
期间申购/买入总份额	8,176,785.73	13,615,294.52
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	98,172,470.98	89,995,685.25
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.05%	4.54%

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。

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

本基金除基金管理人之外的其他关联方于 2009 年年末和 2008 年年末均未投资本基金。

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 1 月 1 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
工商银行	200,690,706.97	3,697,254.22	193,172,735.58	3,414,083.59

7.4.10.6 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 日至 2009 年 12 月 31 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 日至 2008 年 12 月 31 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

注：兴业证券为“五洲转债”的副主承销商。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	利润分配合计	备注
1	2009-06-12	2009-06-12	0.210	12,720,228.16	37,794,355.30	50,514,583.46	-
2	2009-07-30	2009-07-30	0.510	31,277,818.29	97,386,078.22	128,663,896.51	-
3	2009-08-21	2009-08-21	0.400	22,711,930.34	78,356,767.94	101,068,698.28	-
合计	-	-	1.120	66,709,976.79	213,537,201.46	280,247,178.25	-

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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	备注
300017	网宿科技	2009-10-15	2010-02-01	认购新发证券	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	-
600000	浦发银行	2009-09-30	2010-09-29	非公开增发	16.59	17.90	5,000,000	82,950,000.00	89,500,000.00	-
300019	硅宝科技	2009-10-15	2010-02-01	认购新发证券	23.00	43.74	41,754	960,342.00	1,826,319.96	-
300026	红日药业	2009-10-19	2010-02-01	认购新发证券	60.00	91.20	30,148	1,808,880.00	2,749,497.60	-
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	认购新发证券	28.58	55.43	55,467	1,585,246.86	3,074,535.81	-
300041	回天胶业	2009-12-28	2009-01-08	认购新发证券	36.40	36.40	500	18,200.00	18,200.00	-
002301	齐心文具	2009-10-14	2010-01-21	认购新发证券	20.00	35.20	35,656	713,120.00	1,255,091.20	-
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	认购新发证券	11.78	20.94	59,572	701,758.16	1,247,437.68	-

002304	洋河股份	2009-10-29	2010-02-08	认购新发证券	60.00	113.99	7,423	445,380.00	846,147.77	-
002306	湘鄂情	2009-11-05	2010-02-11	认购新发证券	18.90	33.36	46,639	881,477.10	1,555,877.04	-
002310	东方园林	2009-11-20	2010-03-01	认购新发证券	58.60	110.88	13,914	815,360.40	1,542,784.32	-
002313	日海通讯	2009-11-26	2009-03-03	认购新发证券	24.80	40.82	17,281	428,568.80	705,410.42	-
002315	焦点科技	2009-12-01	2010-03-09	认购新发证券	42.00	69.18	18,189	763,938.00	1,258,315.02	-
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-01-08	认购新发证券	28.99	28.99	500	14,495.00	14,495.00	-
002333	罗普斯金	2009-12-30	2010-01-12	认购新发证券	22.00	22.00	500	11,000.00	11,000.00	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有流通受限证券。

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

本基金本期末未持有银行间市场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

本基金本期末未持有交易所市场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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

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。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入

短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时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。

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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	200,690,706.97	-	-	-	-	-	200,690,706.97
结算备付金	4,127,311.22	-	-	-	-	-	4,127,311.22
存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	2,502,020.06	2,600,800.55
交易性金融资产	-	398,680,000.00	196,740,000.00	1,171,813,188.57	207,356,363.47	818,457,985.90	2,793,047,537.94
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	57,087,879.62	57,087,879.62
应收利息	-	-	-	-	-	6,140,282.19	6,140,282.19
应收申购款	2,762,745.33	-	-	-	-	-	2,762,745.33
资产总计	207,679,544.01	398,680,000.00	196,740,000.00	1,171,813,188.57	207,356,363.47	884,188,167.77	3,066,457,263.82
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	0.00
应付赎回款	-	-	-	-	-	6,099,081.75	6,099,081.75
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,386,897.26	3,386,897.26
应付托管费	-	-	-	-	-	651,326.40	651,326.40
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,791,467.30	2,791,467.30
其他负债	-	-	-	-	-	1,123,651.09	1,123,651.09

负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	14,052,423.80	14,052,423.80
利率敏感度缺口	**207,679,544.01**	**398,680,000.00**	**196,740,000.00**	**1,171,813,188.57**	**207,356,363.47**	**870,135,743.97**	**3,052,404,840.02**
上年度末 2008 年 12 月 31 日	**1 个月以内**	**1-3 个月**	**3 个月-1 年**	**1-5 年**	**5 年以上**	**不计息**	**合计**
资产							
银行存款	193,172,735.58	-	-	-	-	-	193,172,735.58
结算备付金	723,402.29	-	-	-	-	-	723,402.29
存出保证金	98,780.49	-	-	-	-	1,000,000.00	1,098,780.49
交易性金融资产	-	483,600,000.00	-	896,064,266.28	197,776,807.24	193,048,433.88	1,770,489,507.40
应收证券清算款	-	-	-	-	-	22,080,264.44	22,080,264.44
应收利息	-	-	-	-	-	21,196,570.49	21,196,570.49
应收申购款	15,179,673.33	-	-	-	-	-	15,179,673.33
资产总计	209,174,591.69	483,600,000.00	-	896,064,266.28	197,776,807.24	237,325,268.81	2,023,940,934.02
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	3,173,659.80	3,173,659.80
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,192,894.73	2,192,894.73
应付托管费	-	-	-	-	-	421,710.52	421,710.52
应付证券清算款	-	-	-	-	-	1,458,801.20	1,458,801.20
应付交易费用	-	-	-	-	-	695,740.87	695,740.87
其他负债	-	-	-	-	-	1,109,742.72	1,109,742.72
负债总计	-	-	-	-	-	9,052,549.84	9,052,549.84
利率敏感度缺口	**209,174,591.69**	**483,600,000.00**	**-**	**896,064,266.28**	**197,776,807.24**	**228,272,718.97**	**2,014,888,384.18**

注：表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	其他影响债券公允价值的变量保持不变,仅利率发生变动		
	假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化(即平移收益率曲线)		
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：人民币千元）**	
		本期末 2009 年 12 月 31 日	**上年度末 2008 年 12 月 31 日**
	利率 +1%	减少 1,834.44	减少 1,116.42
	利率 -1%	增加 1,861.59	增加 1,132.22

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债权公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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	818,457,985.90	26.81	193,048,433.88	9.58
交易性金融资产-债券投资	1,974,589,552.04	64.69	1,577,441,073.52	78.29
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,793,047,537.94	91.50	1,770,489,507.40	87.87

本基金投资组合中股票投资比例范围为不超过基金资产净值的 30%; 可转债为 30%-95%; 现金和到期日在一年以内的政府债券的比例在 5%以上。于 2009 年 12 月 31 日和 2008 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值依照资本-资产定价模型（CAPM）描述的规律进行变动;		
	使用本基金业绩比较基准所对应的市场组合进行分析;		
	在业绩基准变化 10%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到基金净值的变化。		
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：人民币千元）**	
		本期末 2009 年 12 月 31 日	**上年度末 2008 年 12 月 31 日**
	+10%	增加 128,179.17	增加 129,728.40
	-10%	减少 128,179.17	减少 129,728.40

注：本基金管理人运用 CAPM 模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。

上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§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	818,457,985.90	26.69
	其中：股票	818,457,985.90	26.69
2	固定收益投资	1,974,589,552.04	64.39
	其中：债券	1,974,589,552.04	64.39
	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	204,818,018.19	6.68

6	其他各项资产	68,591,707.69	2.24
7	合计	3,066,457,263.82	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	46,978,453.00	1.54
C	制造业	333,341,411.59	10.92
C0	食品、饮料	100,119,049.73	3.28
C1	纺织、服装、皮毛	14,000,000.00	0.46
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,255,091.20	0.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	60,329,842.31	1.98
C5	电子	5,664,048.00	0.19
C6	金属、非金属	11,000.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	27,105,948.60	0.89
C8	医药、生物制品	124,856,431.75	4.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	16,780.00	-
E	建筑业	1,542,784.32	0.05
F	交通运输、仓储业	25,590.00	-
G	信息技术业	129,262,167.96	4.23
H	批发和零售贸易	21,850,000.00	0.72
I	金融、保险业	279,562,948.50	9.16
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	2,803,314.72	0.09
L	传播与文化产业	3,074,535.81	0.10
M	综合类	-	-
	合计	818,457,985.90	26.81

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600000	浦发银行	5,000,000	89,500,000.00	2.93
2	601318	中国平安	1,397,400	76,982,766.00	2.52
3	601628	中国人寿	2,000,000	63,380,000.00	2.08
4	000063	中兴通讯	1,373,825	61,643,527.75	2.02
5	000895	双汇发展	1,009,571	53,608,220.10	1.76

6	600664	哈药股份	2,863,997	52,898,024.59	1.73
7	600015	华夏银行	4,001,625	49,700,182.50	1.63
8	000983	西山煤电	1,177,700	46,978,453.00	1.54
9	000869	张 裕A	600,693	45,664,681.86	1.50
10	600196	复星医药	2,000,000	39,140,000.00	1.28
11	000826	合加资源	1,990,975	30,760,563.75	1.01
12	600570	恒生电子	1,409,988	29,623,847.88	0.97
13	600765	中航重机	1,220,966	26,983,348.60	0.88
14	000919	金陵药业	2,098,900	25,606,580.00	0.84
15	002261	拓维信息	600,074	24,002,960.00	0.79
16	002092	中泰化学	999,920	21,828,253.60	0.72
17	000301	东方市场	2,000,000	14,000,000.00	0.46
18	600693	东百集团	1,000,000	11,650,000.00	0.38
19	600865	百大集团	1,000,000	10,200,000.00	0.33
20	002065	东华软件	421,800	9,802,632.00	0.32
21	600777	新潮实业	813,800	5,664,048.00	0.19
22	600143	金发科技	500,000	5,285,000.00	0.17
23	300027	华谊兄弟	55,467	3,074,535.81	0.10
24	300026	红日药业	30,148	2,749,497.60	0.09
25	600479	千金药业	71,792	1,929,768.96	0.06
26	002294	信立泰	21,680	1,923,666.40	0.06
27	300019	硅宝科技	41,754	1,826,319.96	0.06
28	300017	网宿科技	37,544	1,603,504.24	0.05
29	002306	湘鄂情	46,639	1,555,877.04	0.05
30	002310	东方园林	13,914	1,542,784.32	0.05
31	002315	焦点科技	18,189	1,258,315.02	0.04
32	002301	齐心文具	35,656	1,255,091.20	0.04
33	601888	中国国旅	59,572	1,247,437.68	0.04
34	002304	洋河股份	7,423	846,147.77	0.03
35	002313	日海通讯	17,281	705,410.42	0.02
36	002296	辉煌科技	9,585	621,970.65	0.02
37	000513	丽珠集团	15,380	608,894.20	0.02
38	000635	英 力 特	31,000	579,700.00	0.02
39	601299	中国北车	20,000	122,600.00	0.00
40	002320	海峡股份	500	25,590.00	0.00
41	300041	回天胶业	500	18,200.00	0.00
42	002324	普利特	500	17,310.00	0.00
43	601139	深圳燃气	1,000	16,780.00	0.00
44	300037	新宙邦	500	14,495.00	0.00
45	002333	罗普斯金	500	11,000.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600219	南山铝业	339,103,321.42	16.83
2	600016	民生银行	224,977,311.18	11.17
3	600028	中国石化	201,178,154.56	9.98
4	000983	西山煤电	189,257,508.63	9.39
5	000063	中兴通讯	147,717,364.94	7.33
6	601166	兴业银行	140,554,117.54	6.98
7	601328	交通银行	138,060,205.22	6.85
8	000629	攀钢钢钒	137,539,815.26	6.83
9	600971	恒源煤电	133,311,396.87	6.62
10	600196	复星医药	132,971,044.19	6.60
11	601001	大同煤业	130,138,888.85	6.46
12	601318	中国平安	104,483,760.32	5.19
13	000301	东方市场	92,063,787.84	4.57
14	601857	中国石油	91,689,551.59	4.55
15	601168	西部矿业	88,035,767.35	4.37
16	600649	城投控股	87,222,056.44	4.33
17	601088	中国神华	86,468,107.00	4.29
18	600000	浦发银行	82,950,000.00	4.12
19	600015	华夏银行	80,895,623.93	4.01
20	601628	中国人寿	78,249,663.99	3.88
21	000402	金 融 街	72,110,601.98	3.58
22	600664	哈药股份	72,025,842.82	3.57
23	600837	海通证券	69,244,840.34	3.44
24	600232	金鹰股份	68,769,512.67	3.41
25	601699	潞安环能	68,283,029.69	3.39
26	600777	新潮实业	64,374,708.91	3.19
27	600426	华鲁恒升	63,104,851.55	3.13
28	002031	巨轮股份	58,684,223.15	2.91
29	000630	铜陵有色	56,522,429.62	2.81
30	600598	北大荒	50,205,479.04	2.49
31	000895	双汇发展	49,775,522.68	2.47
32	000006	深振业 A	48,905,444.11	2.43
33	000002	万 科 A	48,805,653.20	2.42
34	600143	金发科技	48,292,593.17	2.40

35	600415	小商品城	47,492,588.14	2.36
36	000677	山东海龙	47,491,961.21	2.36
37	000001	深发展 A	47,162,771.20	2.34
38	600309	烟台万华	44,337,001.04	2.20
39	000009	中国宝安	43,455,481.00	2.16
40	000869	张 裕 A	42,482,303.27	2.11
41	600642	申能股份	42,468,203.75	2.11
42	600039	四川路桥	41,915,875.60	2.08
43	601919	中国远洋	40,991,522.00	2.03
44	002064	华峰氨纶	40,449,718.85	2.01

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600219	南山铝业	324,030,750.86	16.08
2	600016	民生银行	248,390,252.43	12.33
3	600028	中国石化	213,911,114.16	10.62
4	601001	大同煤业	164,345,240.17	8.16
5	601166	兴业银行	159,605,014.35	7.92
6	000983	西山煤电	156,907,102.38	7.79
7	000629	攀钢钢钒	144,631,585.00	7.18
8	600196	复星医药	135,948,209.92	6.75
9	600971	恒源煤电	132,820,716.88	6.59
10	601328	交通银行	125,884,217.85	6.25
11	000063	中兴通讯	124,646,017.01	6.19
12	601857	中国石油	96,724,966.48	4.80
13	601168	西部矿业	92,610,774.59	4.60
14	601088	中国神华	89,342,357.11	4.43
15	600232	金鹰股份	78,604,477.95	3.90
16	000301	东方市场	77,610,382.50	3.85
17	600036	招商银行	75,823,847.01	3.76
18	601699	潞安环能	75,149,258.92	3.73
19	600426	华鲁恒升	72,282,254.61	3.59
20	000002	万 科 A	70,725,958.91	3.51
21	600837	海通证券	70,260,381.24	3.49
22	600649	城投控股	70,195,588.23	3.48
23	000402	金 融 街	69,192,843.72	3.43

24	000630	铜陵有色	59,691,532.50	2.96
25	600777	新潮实业	58,333,166.56	2.90
26	002031	巨轮股份	57,761,401.15	2.87
27	600415	小商品城	51,328,714.99	2.55
28	600598	北大荒	50,447,926.98	2.50
29	000001	深发展 A	50,132,892.00	2.49
30	002064	华峰氨纶	49,449,906.08	2.45
31	000677	山东海龙	49,379,773.64	2.45
32	000006	深振业 A	48,664,490.57	2.42
33	600309	烟台万华	47,963,724.57	2.38
34	000933	神火股份	47,871,834.80	2.38
35	600642	申能股份	45,977,817.90	2.28
36	600143	金发科技	41,647,432.05	2.07
37	601919	中国远洋	40,372,661.96	2.00

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	6,485,287,174.33
卖出股票的收入（成交）总额	6,267,060,520.97

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	595,420,000.00	19.51
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	290,170,341.20	9.51
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	1,088,999,210.84	35.68
7	其他	-	-
8	合计	1,974,589,552.04	64.69

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	0901063	09 央行票据 63	4,000,000	398,680,000.00	13.06
2	110003	新钢转债	2,211,930	304,317,329.40	9.97
3	125709	唐钢转债	2,039,617	248,649,708.47	8.15
4	0901028	09 央行票据 28	2,000,000	196,740,000.00	6.45
5	110006	龙盛转债	970,000	149,147,200.00	4.89

8.7 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。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，并且未在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.2 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。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,600,800.55
2	应收证券清算款	57,087,879.62
3	应收股利	-
4	应收利息	6,140,282.19
5	应收申购款	2,762,745.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	68,591,707.69

8.9.4 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	110003	新钢转债	304,317,329.40	9.97
2	125709	唐钢转债	248,649,708.47	8.15
3	110078	澄星转债	54,625,871.30	1.79
4	125960	锡业转债	22,555,500.00	0.74
5	110567	山鹰转债	21,030,777.60	0.69

8.9.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600000	浦发银行	89,500,000.00	2.93	非公开增发

§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
60,207	40,233.24	346,037,454.96	14.29%	2,076,285,032.53	85.71%

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	1,351,240.67	0.06%

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004 年 5 月 11 日)基金份额总额	3,282,404,810.93
本报告期期初基金份额总额	1,981,317,338.37
本报告期期间基金总申购份额	1,743,207,838.30
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,302,202,689.18
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	2,422,322,487.49

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。

§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、报告期内基金管理人的重大人事变动:

（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，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，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。

（4）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，决定聘任徐天舒先生担任公司副总经理。

（5）经兴业全球基金管理有限公司股东会 2009 年第三次会议审议通过，由霍以礼先生（Elio Fattorini）担任兴业全球基金管理有限公司董事，祖百瑞（Imaad

Zuberi）先生不再担任公司董事。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起连续 6 年聘请安永华明会计师事务所有限公司为本基金提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 10 万元人民币。

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

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。

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	
兴业证券	2	712,951,571.53	5.99%	609,643.52	6.03%	-
中金公司	1	2,229,002,834.46	18.74%	1,917,582.80	18.96%	-
广发证券	1	2,512,133,778.20	21.12%	2,180,674.39	21.56%	-
中银国际	2	2,244,021,674.12	18.86%	1,840,006.10	18.19%	-
国泰君安	1	1,706,375,623.68	14.34%	1,464,682.01	14.48%	-
申银万国	1	1,476,020,934.40	12.41%	1,259,138.19	12.45%	-
光大证券	1	1,016,376,659.88	8.54%	844,009.92	8.34%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	新增
国元证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	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
兴业证券	198,744,259.89	10.43%	300,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	280,245,771.00	14.71%	-	-	-	-
广发证券	504,163,764.50	26.46%	-	-	2,333,842.56	100.00%
中银国际	334,400,056.63	17.55%	-	-	-	-
国泰君安	158,596,778.60	8.32%	-	-	-	-
申银万国	50,316,259.40	2.64%	-	-	-	-
光大证券	379,171,077.62	19.90%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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	旗下各基金 2008 年年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-01-01
2	关于光大银行基金定期定额业务申购费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-01-16
3	关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-06
4	关于增加渤海证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-16
5	关于增加宁波银行为旗下五基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-24
6	关于增加中国邮储银行为旗下四基金代销机构及相关费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理	2009-02-24

		人网站	
7	关于调整交通银行网上银行基金申购优惠费率的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-25
8	关于参加中国工商银行“基智定投”及其费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-25
9	关于公司高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-27
10	关于开通招商银行一卡通基金网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-02-28
11	关于兴业可转债混合型证券投资基金暂停接受伍万元以上申购及转换转入申请的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-03-17
12	关于增加中信银行股份有限公司为旗下两基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-03-24
13	关于在宁波银行开通兴业旗下基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-03-25
14	关于调整基金网上直销平台转换业务费率的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-03-26
15	关于通过工商银行个人网银申购旗下部分基金申购费率优惠活动展期的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-03-30
16	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的第一次提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-03-31
17	关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务及调整转换数额限制的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-01
18	关于通过中国建设银行电话银行申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-09
19	关于通过农业银行定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-10
20	关于增加瑞银证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-13

21	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的第二次提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-17
22	关于通过瑞银证券网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-18
23	关于旗下基金在部分代销机构开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-18
24	关于增加瑞银证券为办理旗下部分基金定期定额投资业务代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-04-18
25	关于旗下部分基金参加联合证券定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-04
26	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的第三次提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-04
27	关于在中国银行开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-20
28	关于在中国银行开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-20
29	关于旗下部分基金参加中国银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-20
30	关于旗下部分基金参加中国银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-20
31	关于通过光大证券网上交易系统申购兴业趋势基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-05-22
32	关于在中信银行开通旗下部分基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-06-03
33	关于聘任公司高级管理人员的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-06-03
34	关于旗下部分基金参加兴业银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-06-09
35	关于董事变更的公告	中国证券报、上海	2009-06-11

		证券报、基金管理人网站	
36	兴业可转债混合型证券投资基金第三十四次分红公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-06-12
37	关于旗下部分基金参加上海浦东发展银行网上基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-06-29
38	关于旗下部分基金参加中国邮储银行定期定额业务申购费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-06-29
39	旗下各基金 2009 年半年度资产净值公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-07-01
40	关于调整旗下基金在光大银行定期定额投资业务起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-07-08
41	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-07-16
42	关于旗下部分基金在天相投顾开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-07-28
43	兴业可转债混合型证券投资基金第三十五次分红公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-07-29
44	关于增加光大证券为办理旗下部分基金定期定额投资业务代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-08-10
45	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-08-15
46	兴业可转债混合型证券投资基金第三十六次分红公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-08-19
47	关于旗下部分基金参加农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-09-03
48	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-09-16
49	关于旗下部分基金参加创业板市场投资的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理	2009-09-23

		人网站	
50	关于公司旗下部分基金投资浦发银行（600000）非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-10-12
51	关于旗下部分基金参加民生银行网上银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-10-17
52	关于增加广发华福为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-05
53	关于长期停牌股票估值政策调整及对基金资产净值影响的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-10
54	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-16
55	关于旗下部分基金在广发华福开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-18
56	关于通过广发华福网上交易系统申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-18
57	关于增加广发华福证券为办理旗下基金定期定额投资业务代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-19
58	关于旗下部分基金参加广发华福定期定额申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-19
59	关于增加华夏银行为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-26
60	关于在华夏银行开通旗下部分基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-26
61	关于旗下部分基金参加华夏银行优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-11-26
62	关于旗下部分基金参加光大银行基金定期定额业务申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-01
63	关于增加深圳发展银行为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-03

64	关于在深圳发展银行开通旗下基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-03
65	关于旗下部分基金在深圳发展银行开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-03
66	关于董事变更的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-04
67	关于通过中国建设银行网上银行等电子渠道申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-08
68	关于兴业可转债混合型证券投资基金继续暂停接受伍万元以上申购、转入申请的提示性公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-16
69	关于通过宁波银行网上银行申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-21
70	关于旗下部分基金参加宁波银行网上银行定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-24
71	关于参加中国工商银行定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-30
72	关于通过农业银行定期定额申购旗下部分基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、基金管理人网站	2009-12-31
73	关于参加交通银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、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

根据《证券投资基金法》、《首次公开发行股票并在创业板上市管理暂行办法》、《深圳证券交易所创业板股票上市规则》、《关于证券投资基金投资创业板上市证券的说明》等相关法律法规及基金合同的规定，本基金将遵循《基金合同》中关于基金投资目标、投资策略、投资范围、资产配置比例和风险收益特征的规定运用基金财产参与创业板市场投资。公司已按照相关规定于 2009 年 9 月 23 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站上对相关信息予以披露。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准兴业可转债混合型证券投资基金设立的文件

2、 《兴业可转债混合型证券投资基金基金合同》

3、 《兴业可转债混合型证券投资基金托管协议》

4、 《兴业可转债混合型证券投资基金招募说明书》

5、 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

6、 本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536

兴业全球基金管理有限公司

二〇一〇年三月二十七日