

富国天博创新主题股票型证券投资基金

二 00 九年年度报告

(摘要)

2009 年 12 月 31 日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 中国建设银行股份有限公司
(简称中国建设银行)

送出日期： 2010 年 03 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

富国基金管理有限公司的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2010年3月25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。

富国基金管理有限公司承诺以诚实信用、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2009年1月1日起至2009年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天博创新股票
基金主代码	519035
交易代码	前端交易代码：519035 后端交易代码：519036
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年04月27日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行)
报告期末基金份额总额	10,695,232,023.12份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有良好成长性的创新主题类上市公司,在充分注重投资组合收益性、流动性与安全性的基础上,力争实现资本的长期稳定增值。
投资策略	本基金将采用“自上而下”与“自下而上”相结合的主动投资管理策略,将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、行业细分、个券选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中信标普300指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金,属于较高预期收益、较高预期风险的证券投资基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司 (简称中国建设银行)
信息披露负责人	姓名	李长伟	尹东
	联系电话	021-68597788	010-67595003
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		95105686、4008880688	010-67595096
传真		021-68597799	010-67595853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的 管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层

中国建设银行股份有限公司 北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

§ 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

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2009 年	2008 年	2007 年(自基金合同生效日 2007 年 4 月 27 日起至 2007 年 12 月 31 日)
本期已实现收益	45,303,631.44	-2,764,201,758.78	932,888,853.76
本期利润	4,322,108,369.24	-7,644,487,549.22	3,126,209,260.89
加权平均基金份额本期利润	0.3706	-0.5888	0.3215
本期基金份额净值增长率	66.88%	-51.52%	55.53%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年 12 月 31 日	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日
期末可供分配基金份额利润	-0.2086	-0.2194	-0.0023
期末基金资产净值	9,754,496,520.40	6,749,850,469.71	15,824,227,649.63
期末基金份额净值	0.9120	0.5465	1.1273

注：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、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。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。

3.2 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	16.00%	1.49%	15.54%	1.40%	0.46%	0.09%
过去六个月	16.18%	1.70%	11.49%	1.69%	4.69%	0.01%
过去一年	66.88%	1.59%	72.36%	1.63%	-5.48%	-0.04%
自基金转型日起至今	25.82%	1.85%	8.63%	2.00%	17.19%	-0.15%

注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于 2007 年 4 月 27 日生效。根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=中信标普 300 指数×80%+中信国债指数×15%+同业存款利率×5%。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普 300 指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中信国债指数。中信标普 300 指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成，样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查，能较全面地描述中国 A 股市场地总体趋势。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。本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率（benchmark_t）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 80\% * [\text{中信标普 300 指数 } t / (\text{中信标普 300 指数 } t-1) - 1] + 15\% * [\text{中信国债指数 } t / (\text{中信国债指数 } t-1) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360 ;$$
 其中， $t=1,2,3,\dots,T$ ， T 表示时间截至日；
 期间 T 日收益率（benchmark T ）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$
 其中， $T=2,3,4,\dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 数学连乘。

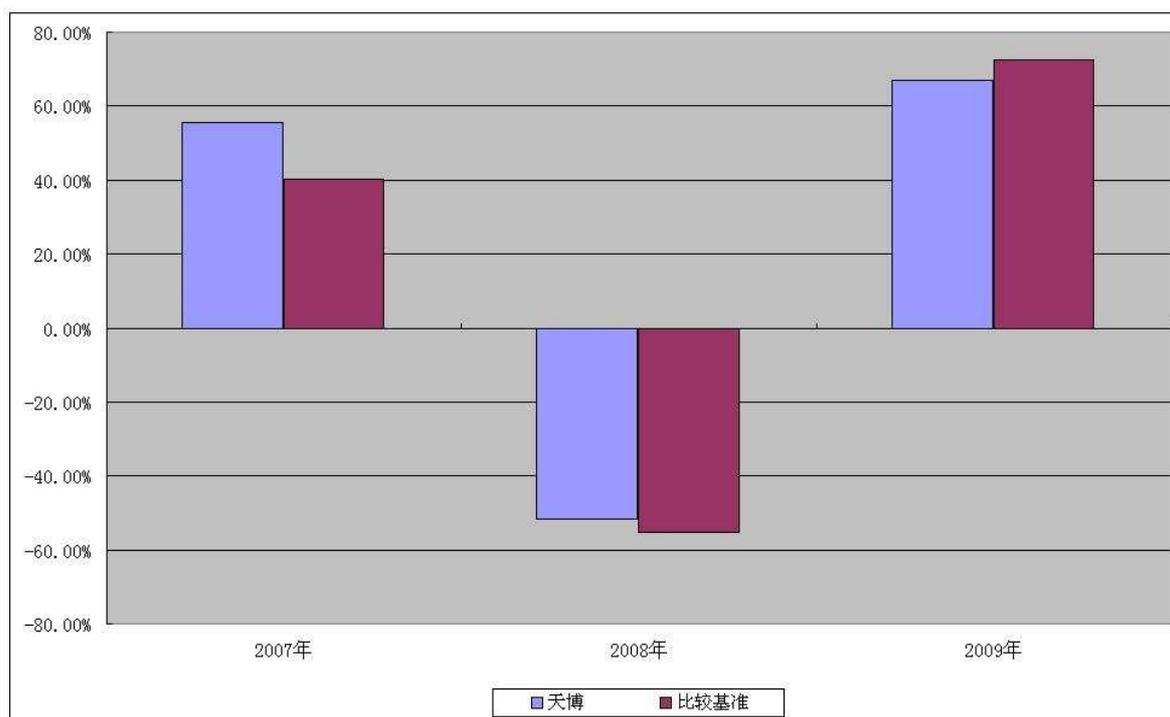
3.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为2009年12月31日。

本基金于2007年4月27日由原汉博证券投资基金转型而成，建仓期6个月，从2007年4月27日至2007年10月26日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于 2007 年 4 月 27 日生效。2007 年净值增长率数据按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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年	—	—	—	—	—
2008年	—	—	—	—	—
2007年	2.580	1,352,953,536.69	712,314,705.89	2,065,268,242.58	2次分红
合计	2.580	1,352,953,536.69	712,314,705.89	2,065,268,242.58	2次分红

注：本基金由原汉博证券投资基金转型而成，基金合同于 2007 年 4 月 27 日生效。

§ 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

富国基金管理有限公司于 1999 年 4 月 13 日获国家工商行政管理局登记注册成立，是经中国证监会批准设立的首批十家基金管理公司之一，公司于 2001 年 3 月从北京迁址上海。2003 年 9 月加拿大蒙特利尔银行（BMO）参股富国基金管理有限公司的工商变更登记办理完毕，富国基金管理有限公司成为国内首批成立的十家基金公司中，第一家中外合资的基金管理公司。截止 2009 年 12 月 31 日，本基金管理人管理汉盛证

券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金三只封闭式证券投资基金和富国天源平衡混合型证券投资基金、富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金、富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金、富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）、富国天时货币市场基金、富国天合稳健优选股票型证券投资基金和富国天博创新主题股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、富国天鼎中证红利指数增强型证券投资基金、富国优化增强债券型证券投资基金及富国沪深 300 增强证券投资基金十二只开放式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）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		
毕天宇	本基金基金经理	2005-11-26	—	10 年	硕士，曾任中国燕兴桂林公司汽车经营部经理助理；中国北方工业上海公司处长助理；兴业证券研究员；2002.3 至今任富国基金管理有限公司行业研究员，现任富国天博基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
李晓铭	本基金前任基金经理助理	2008-03-01	2009-10-28	5 年	硕士，曾任华富基金管理有限公司研究员，现任富国基金管理有限公司研究部行业研究员，兼任富国天博基金基金经理助理。具有基金从业资格，中国国籍。

注：上述表格内基金经理的任职日期、离任日期均指公司作出决定并公告披露之日。证券从业的涵义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 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，富国基金管理有限公司作为富国天博创新主题股票型证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，管理和运用基金资产，无损害基金持有人利益的行为，基金投资组合符合有关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的相关公平交易制度，投资管理和交易执行相隔离，实行集中交易制度，严格执行交易系统中的公平交易程序，未出现违反公平交易制度的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

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

公司旗下相似投资风格的开放式基金业绩比较：

项目	净值增长率	业绩比较基准收益率
富国天益价值证券投资基金	49.73%	89.15%
富国天合稳健优选股票型证券投资基金	71.05%	72.36%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	66.88%	72.36%

注：根据经托管行审定的基金年报数据，本公司旗下相似投资风格的富国天益价值证券投资基金分别与富国天合稳健优选股票型证券投资基金、富国天博创新主题股票型证券投资基金之间在本报告期的净值增长率之差超过 5%。其原因主要是基金合同约定及投资策略不同所致。日常监控和公平性交易分析结果表明，没有证据显示两者之间的投资行为存在利益输送的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

09 年全年天博基净值表现一般。

总结过去一年的操作，存在的主要问题在于：

第一、年初过于保守的投资策略导致一季度表现最差，净值仅增长 15.5%，远低于市场 37% 的涨幅。在经历了 08 年大幅下跌后，09 年初投资者普遍处于悲观情绪当中。而市场却在国家宏观经济政策的刺激下，率先走出了低谷。我们未能把握住市场的拐点。单季巨大的差距直接导致我们全年的净值表现差强人意。

第二、配置策略相对保守。尽管从 1 月中下旬开始房地产、汽车两大支柱产业率先走出低谷，使得我们看到了经济转好的迹象，也逐渐改变了我们对经济悲观的看法。我们逐步增加仓位，重点增持了银行、房地产以及汽车等行业。但由于我们对经济快速复苏心存疑虑，投资策略未能作出彻底转变，在行业配置上依旧偏防御，组合的进攻性明显不足。

第三、行业轮动不够坚决。09 年行业机会层出不穷，从年初的煤炭、银行和地产，下半年的医药和消费，尽管我们均抓住了投资机会，但在配置权重过于保守。在行业出现调整时，减持同样不够坚决。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2009 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9120 元，份额累计净值为 3.1310 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 66.88%，同期业绩比较基准收益率为 72.36%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在四万亿投资和宽松的货币政策和积极的财政政策拉动下，09 年中国经济的复苏是非常强劲的。从微观企业层面来看，与投资拉动相关的部分行业已经超过了 07、08 年的高峰时期。09 年底的电荒和煤荒虽然有天气因素，但从我们的分析来看，部分行业可能已经出现过热迹象，市场对通胀的预期也日益强烈。在当前的宏观背景下，一旦

出口复苏超过预期，政府制定的适度宽松、灵活应对的货币政策将逐步收紧。

尽管政策退出是对经济复苏的进一步确认，但从年初央行出台政策的时间节点和调控措施力度来看，均快于和强于市场预期。这表明国家对经济过热的担心正逐步加大，使得我们不得不谨慎对待 2010 年的投资。

展望 2010 年，我们认为一方面，经济复苏与刺激政策退出的交织使得 2010 年宏观经济面临更多的不确定性，这也势必加剧市场波动的幅度。紧密跟踪政策和行业的变化，积极适时地调整投资策略是我们的必然选择。另一方面，宏观经济的好转也为许多优质的上市公司提供了良好的发展机遇，自下而上选股将会有明显超额收益的。我们将在在新的一年里精选个股，争取为投资者获得更好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司按照相关法律法规的规定成立了估值委员会，并制订了《富国基金管理有限公司估值委员会运作管理办法》。估值委员会是公司基金估值的主要决策机关，由主管运营副总经理负责，成员包括基金清算、监察稽核、金融工程方面的业务骨干以及相关基金经理，所有相关成员均具有丰富的证券投资基金行业从业经验。公司估值委员会负责提出估值意见、提供和评估估值技术、执行估值决策和程序、对外信息披露等工作，保证基金估值的公允性和合理性，维护基金持有人的利益。基金经理是估值委员会的重要成员，必须列席估值委员会的定期会议，提出基金估值流程及估值技术中存在的潜在问题，参与估值程序和估值技术的决策。估值委员会各方不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定：“基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；”，本基金期末可供分配利润为负数，则本基金本期不进行收益分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、

投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

本基金审计的注册会计师出具的是无保留意见的审计报告。
投资者可通过本基金年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

资 产	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	200,168,795.85	583,789,290.91
结算备付金	9,120,650.04	911,670.66
存出保证金	2,071,196.29	478,597.41
交易性金融资产	9,537,076,535.75	6,164,393,655.77
其中：股票投资	9,029,744,247.75	4,487,992,805.57
基金投资	—	—
债券投资	507,332,288.00	1,676,400,850.20
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	1,763,365.63
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	35,095,914.07	—
应收利息	4,033,994.54	26,417,696.95
应收股利	—	—
应收申购款	278,221.88	184,855.45
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	9,787,845,308.42	6,777,939,132.78
负债和所有者权益	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	—	14,783,058.25

应付赎回款	14,388,256.05	1,713,330.00
应付管理人报酬	12,263,993.40	8,772,102.49
应付托管费	2,043,998.90	1,462,017.05
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	3,597,285.73	580,146.65
应交税费	119,288.51	119,288.51
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	935,965.43	658,720.12
负债合计	33,348,788.02	28,088,663.07
所有者权益：		
实收基金	3,996,575,192.84	4,615,527,943.46
未分配利润	5,757,921,327.56	2,134,322,526.25
所有者权益合计	9,754,496,520.40	6,749,850,469.71
负债和所有者权益总计	9,787,845,308.42	6,777,939,132.78

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9120 元，基金份额总额 10,695,232,023.12 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日)
一、收入	4,503,345,590.82	-7,441,234,376.04
1. 利息收入	25,351,949.69	45,297,481.11
其中：存款利息收入	3,227,858.38	6,897,830.05
债券利息收入	22,124,091.31	37,995,547.06
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	404,104.00
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	199,384,034.76	-2,610,100,416.56
其中：股票投资收益	43,277,081.67	-2,712,249,816.16
基金投资收益	—	—
债券投资收益	100,263,978.66	3,554,605.67
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	3,627,123.94	14,886,906.34
股利收益	52,215,850.49	83,707,887.59
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	4,276,804,737.80	-4,880,285,790.44

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	1,804,868.57	3,854,349.85
减：二、费用	181,237,221.58	203,253,173.18
1. 管理人报酬	128,876,593.00	150,486,330.41
2. 托管费	21,479,432.18	25,081,055.03
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	28,279,933.66	23,000,274.33
5. 利息支出	2,114,619.30	4,177,213.50
其中：卖出回购金融资产支出	2,114,619.30	4,177,213.50
6. 其他费用	486,643.44	508,299.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	4,322,108,369.24	-7,644,487,549.22
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	4,322,108,369.24	-7,644,487,549.22

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天博创新主题股票型证券投资基金

本报告期：2009年01月01日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2009年01月01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）	4,615,527,943.46	2,134,322,526.25	6,749,850,469.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	4,322,108,369.24	4,322,108,369.24
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）	-618,952,750.62	-698,509,567.93	-1,317,462,318.55
其中：1. 基金申购款	64,636,096.77	63,231,426.44	127,867,523.21
2. 基金赎回款	-683,588,847.39	-761,740,994.37	-1,445,329,841.76
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）	3,996,575,192.84	5,757,921,327.56	9,754,496,520.40
项目	上年度可比期间 (2008年01月01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）	5,245,412,216.72	10,578,815,432.91	15,824,227,649.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-7,644,487,549.22	-7,644,487,549.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值	-629,884,273.26	-800,005,357.44	-1,429,889,630.70

变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	574,885,140.03	1,020,444,006.66	1,595,329,146.69
2. 基金赎回款	-1,204,769,413.29	-1,820,449,364.10	-3,025,218,777.39
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）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	4,615,527,943.46	2,134,322,526.25	6,749,850,469.71

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

竇玉明

林志松

雷青松

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

富国天博创新主题股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）由汉博证券投资基金转型而成。依据中国证券监督管理委员会 2007 年 4 月 16 日证监基金字[2007]108 号文《关于核准汉博证券投资基金基金份额持有人大会决议的批复》，汉博证券投资基金由封闭式基金转为开放式基金，调整存续期限，终止上市交易，调整投资目标、范围和策略，修订基金合同，并更名为“富国天博创新主题股票型证券投资基金”。自 2007 年 4 月 27 日起，《富国天博创新主题股票型证券投资基金基金合同》生效，原《汉博证券投资基金基金合同》失效。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富国基金管理有限公司，注册登记人为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据上述证监基金字[2007]108 号文的核准，基金管理人于 2007 年 5 月 9 日至 2007 年 5 月 18 日向社会开放集中申购，集中申购期结束经安永大华会计师事务所有限责任公司验证并出具第 597 号验资报告。集中申购扣除申购费后的净申购金额为人民币 4,754,945,538.62 元，在集中申购期间产生的利息为人民币 2,410,452.06 元，以上实收基金合计为人民币 4,757,355,990.68 元，折合 4,757,355,990.68 份基金份额。另外，集中申购验资结束日同时为原汉博证券投资基金的拆分日。拆分日，基金管理人原汉博证券投资基金通过基金份额拆分，使得验资结束当日基金份额净值为 1.00 元，再根据当日基金份额净值（1.00 元）计算投资者集中申购应获得的基金份额，并由注册登记机构根据基金管理人进行投资者集中申购份额的登记确认。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法公开发行上市股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的业绩比较基准为：中信标普 300 指数×80%+中信标普国债指数×15%+同业存款利率×5%。

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 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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报告相一致。

7.4.5 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。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司（“申银万国证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
山东省国际信托有限公司	基金管理人的股东
蒙特利尔银行	基金管理人的股东
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01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(%)
海通证券	2,308,904,080.95	12.50	63,686,437.27	0.90
申银万国	588,639,454.26	3.19	147,473,018.64	2.08

7.4.7.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31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(%)
海通证券	2,743,725.27	53.54	—	—

7.4.7.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01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(%)
海通证券	168,592,758.71	24.30	106,438,379.23	11.38
申银万国	36,946,832.43	5.32	84,675.00	0.01

7.4.7.1.4 回购交易

注：本基金本期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.7.1.5 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01月01日至2009年12月31日）			
	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（%）
海通证券	1,906,829.12	12.32	348,803.17	9.72
申银万国	500,338.60	3.23	—	—
关联方名称	上年度可比期间（2008年01月01日至2008年12月31日）			
	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（%）
海通证券	51,745.66	0.87	43,935.07	7.58
申银万国证券	125,351.15	2.10	27,464.64	4.74

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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2009年01月01日至2009年12月31日）	上年度可比期间（2008年01月01日至2008年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	128,876,593.00	150,486,330.41
其中：支付销售机构的客户维护费	29,606,648.59	34,081,261.47

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H为每日应支付的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

上述表格中“当期已支付”不包含当期已支付的上期应付管理费。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间（2008年01月01日至2008年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	21,479,432.18	25,081,055.03

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：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

7.4.7.3 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

本期（2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日）						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国建设银行	—	—	—	—	3,428,900,000.00	1,241,087.31
上年度可比期间（2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日）						
银行间市场交易的各关联方名称	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
中国建设银行	—	—	—	—	1,055,900,000.00	937,769.27

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人 2009 年度及 2008 年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.7.4.2 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

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方 2009 年年末及 2008 年年末未投资本基金。

7.4.7.5 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 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	200,168,795.85	3,127,858.43	583,789,290.91	6,740,345.86

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于 2009 年度及 2008 年度未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.7.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期末无需要说明的其他关联交易事项。

7.4.8 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.8.1.1 受限证券类别：股票

金额单位：人民币元

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
------	------	-------	------	--------	------	--------	----------	--------	--------	----

002024	苏宁电器	2009-12-30	2010-12-31	非公开发行股票	17.20	17.23	6,000,000	103,200,000.00	103,380,000.00	—
002299	圣农发展	2009-10-13	2010-01-21	新股认购	19.75	25.03	64,239	1,268,720.25	1,607,902.17	—
002300	太阳电缆	2009-10-13	2010-01-21	新股认购	20.56	33.33	48,535	997,879.60	1,617,671.55	—
002301	齐心文具	2009-10-14	2010-01-21	新股认购	20.00	35.20	35,656	713,120.00	1,255,091.20	—
002305	南国置业	2009-10-29	2010-02-08	新股认购	12.30	19.57	59,221	728,418.30	1,158,954.97	—
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	新股认购	23.80	31.83	56,492	1,344,509.60	1,798,140.36	—
002311	海大集团	2009-11-20	2010-03-01	新股认购	28.00	37.54	73,704	2,063,712.00	2,766,848.16	—
002313	日海通讯	2009-11-26	2010-03-03	新股认购	24.80	40.82	15,899	394,295.20	648,997.18	—
002315	焦点科技	2009-12-01	2010-03-09	新股认购	42.00	69.18	21,354	896,868.00	1,477,269.72	—
002316	键桥通讯	2009-12-01	2010-03-09	新股认购	18.80	31.13	35,953	675,916.40	1,119,216.89	—
002322	理工监测	2009-12-11	2010-03-18	新股认购	40.00	61.88	14,995	599,800.00	927,890.60	—
002323	中联电气	2009-12-11	2010-03-18	新股认购	30.00	40.57	24,197	725,910.00	981,672.29	—
002324	普利特	2009-12-11	2010-03-18	新股认购	22.50	34.62	42,716	961,110.00	1,478,827.92	—
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-04-06	新股认购	20.10	20.10	51,032	1,025,743.20	1,025,743.20	—
002332	仙琚制药	2009-12-30	2010-01-12	新股认购	8.20	8.20	500	4,100.00	4,100.00	—
300002	神州泰岳	2009-09-29	2010-02-01	新股认购	58.00	105.20	71,753	4,161,674.00	7,548,415.60	—
300003	乐普医疗	2009-09-29	2010-02-01	新股认购	29.00	51.20	70,615	2,047,835.00	3,615,488.00	—
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	新股认购	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	—
300017	网宿科技	2009-10-15	2010-02-01	新股认购	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	—
300024	机器人	2009-10-19	2010-02-01	新股认购	39.80	72.28	26,015	1,035,397.00	1,880,364.20	—
300026	红日药业	2009-10-19	2010-02-01	新股认购	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	新股认购	28.58	55.43	55,467	1,585,246.86	3,074,535.81	—
300029	天龙光电	2009-12-18	2010-03-25	新股认购	18.18	29.10	124,780	2,268,500.40	3,631,098.00	—
300030	阳普医疗	2009-12-18	2010-03-26	新股认购	25.00	35.10	20,990	524,750.00	736,749.00	—
300034	钢研高纳	2009-12-18	2010-03-25	新股认购	19.53	34.53	39,466	770,770.98	1,362,760.98	—
300035	中科电气	2009-12-18	2010-03-25	新股认购	36.00	48.42	13,813	497,268.00	668,825.46	—
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-04-08	新股认购	28.99	28.99	71,240	2,065,247.60	2,065,247.60	—
300039	上海凯宝	2009-12-28	2010-01-08	新股认购	38.00	38.00	500	19,000.00	19,000.00	—
300040	九洲电气	2009-12-28	2010-01-08	新股认购	33.00	33.00	500	16,500.00	16,500.00	—
600703	三安光电	2009-09-30	2010-09-29	非公开发行股票	26.00	32.88	2,900,000	75,400,000.00	95,352,000.00	—
600999	招商证券	2009-11-12	2010-02-22	新股认购	31.00	29.39	136,557	4,233,267.00	4,013,410.23	—
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新股认购	5.43	5.43	13,000	70,590.00	70,590.00	—
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	新股认购	11.78	20.94	131,060	1,543,886.80	2,744,396.40	—

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	--------------	--------	--------	----

000623	吉林敖东	2009-12-28	筹划重大事项	49.19	2010-01-11	54.11	200,000	10,059,779.00	9,838,000.00	—
000709	唐钢股份	2009-12-16	筹划重大事项	7.09	2010-01-25	6.60	13,212,709	93,678,106.81	93,678,106.81	—
600739	辽宁成大	2009-12-28	筹划重大事项	38.09	2010-01-11	41.90	200,000	7,339,789.10	7,618,000.00	—

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本期末无正回购余额，没有因正回购而作为抵押的债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末无交易所市场债券正回购余额。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	9,029,744,247.75	92.25
	其中：股票	9,029,744,247.75	92.25
2	固定收益投资	507,332,288.00	5.18
	其中：债券	507,332,288.00	5.18
	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	209,289,445.89	2.14
6	其他各项资产	41,479,326.78	0.42
7	合计	9,787,845,308.42	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	1,607,902.17	0.02
B	采掘业	683,130,496.86	7.00
C	制造业	4,199,953,522.79	43.06
C0	食品、饮料	553,196,591.36	5.67
C1	纺织、服装、皮毛	—	—

C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	50,047,939.24	0.51
C4	石油、化学、塑胶、塑料	486,048,259.60	4.98
C5	电子	124,912,084.00	1.28
C6	金属、非金属	1,065,812,962.73	10.93
C7	机械、设备、仪表	1,464,429,183.02	15.01
C8	医药、生物制品	355,460,650.61	3.64
C99	其他制造业	100,045,852.23	1.03
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	交通运输、仓储业	—	—
G	信息技术业	585,181,904.09	6.00
H	批发和零售贸易	1,077,645,654.72	11.05
I	金融、保险业	2,109,406,505.91	21.62
J	房地产业	261,874,225.21	2.68
K	社会服务业	10,836,859.20	0.11
L	传播与文化产业	100,107,176.80	1.03
M	综合类	—	—
	合计	9,029,744,247.75	92.57

8.3 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	002024	苏宁电器	38,630,000	781,431,400.00	8.01
2	601166	兴业银行	15,000,000	604,650,000.00	6.20
3	600519	贵州茅台	3,200,000	543,424,000.00	5.57
4	000338	潍柴动力	5,500,000	354,640,000.00	3.64
5	601318	中国平安	6,009,901	331,085,446.09	3.39
6	600036	招商银行	16,009,944	288,979,489.20	2.96
7	000001	深发展A	10,497,748	255,830,118.76	2.62
8	600585	海螺水泥	5,000,000	249,300,000.00	2.56
9	600271	航天信息	10,500,104	212,942,109.12	2.18
10	000625	长安汽车	15,000,000	210,450,000.00	2.16

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

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	600030	中信证券	521,643,832.32	7.73
2	600000	浦发银行	388,472,039.02	5.76
3	600036	招商银行	367,306,162.44	5.44
4	600050	中国联通	359,482,576.80	5.33
5	000002	万科A	348,450,292.72	5.16
6	601318	中国平安	302,362,892.92	4.48
7	601166	兴业银行	300,574,740.77	4.45
8	000625	长安汽车	299,521,537.77	4.44
9	000983	西山煤电	289,350,468.45	4.29
10	601601	中国太保	275,276,430.46	4.08
11	002024	苏宁电器	238,952,793.46	3.54
12	600196	复星医药	232,753,298.95	3.45
13	600016	民生银行	227,089,353.44	3.36
14	000898	鞍钢股份	216,402,858.04	3.21
15	000024	招商地产	215,443,756.28	3.19
16	000001	深发展A	185,192,101.54	2.74
17	601899	紫金矿业	184,539,844.80	2.73
18	601666	平煤股份	166,935,223.86	2.47
19	601088	中国神华	163,425,989.17	2.42
20	600104	上海汽车	131,145,194.20	1.94

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额（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	600000	浦发银行	592,937,786.29	8.78
2	600030	中信证券	494,675,042.37	7.33
3	002024	苏宁电器	458,191,302.67	6.79
4	000002	万科A	411,224,642.69	6.09
5	600596	新安股份	392,792,246.78	5.82
6	600196	复星医药	365,263,051.09	5.41
7	600271	航天信息	352,794,190.36	5.23
8	600036	招商银行	342,006,007.66	5.07
9	600519	贵州茅台	335,500,065.49	4.97
10	600050	中国联通	321,794,172.42	4.77
11	600320	振华重工	252,791,179.68	3.75
12	002007	华兰生物	252,593,616.47	3.74
13	601398	工商银行	209,418,689.80	3.10
14	601601	中国太保	202,563,223.78	3.00
15	600048	保利地产	185,245,094.23	2.74

16	601666	平煤股份	181,176,910.83	2.68
17	000625	长安汽车	171,887,732.71	2.55
18	000983	西山煤电	170,225,372.36	2.52
19	601699	潞安环能	157,780,850.71	2.34
20	000063	中兴通讯	157,490,371.52	2.33
21	000792	盐湖钾肥	154,449,590.79	2.29
22	000338	潍柴动力	136,001,252.88	2.01

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（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

买入股票成本（成交）总额	9,505,368,767.41
卖出股票收入（成交）总额	9,463,200,052.25

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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。

8.5 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	161,299,288.00	1.65
2	央行票据	226,451,000.00	2.32
3	金融债券	100,150,000.00	1.03
	其中：政策性金融债	100,150,000.00	1.03
4	企业债券	19,432,000.00	0.20
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—
8	合计	507,332,288.00	5.20

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	080404	08 农发 04	1,000,000	100,150,000.00	1.03
2	0901038	09 央行票据 38	1,000,000	98,280,000.00	1.01
3	0901040	09 央行票据 40	1,000,000	98,270,000.00	1.01
4	010004	20 国债(4)	610,360	61,524,288.00	0.63
5	090008	09 付息国债 08	500,000	49,920,000.00	0.51

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：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 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本基金本报告期内投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的。

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	2,071,196.29
2	应收证券清算款	35,095,914.07
3	应收股利	—
4	应收利息	4,033,994.54
5	应收申购款	278,221.88
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	41,479,326.78

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002024	苏宁电器	103,380,000.00	1.06	非公开发行股票

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§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(%)
525731	20,343.54	299,348,371.33	2.80	10,395,883,651.79	97.20

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	799,090.59	0.0075

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2007年04月27日)基金份额总额	500,000,000.00
报告期期初基金份额总额	12,351,614,135.89
本报告期基金总申购份额	172,973,249.06
减：本报告期基金总赎回份额	1,829,355,361.83
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	10,695,232,023.12

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有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

本报告期内经中国证监会核准，本基金基金管理人于2009年6月4日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告聘任孟朝霞女士担任公司副总经理。

本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

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所。本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所审计报酬为 12 万元人民币，其已为本公司提供审计服务的连续年限为 7 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

11.7 本期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		债券回购交易		权证交易		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 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	2,655,162,749.61	14.37	59,174,020.94	8.53	—	—	—	—	2,256,867.87	14.59	—
长城证券	1	800,299,067.07	4.33	33,428,348.93	4.82	492,000,000.00	31.25	—	—	680,251.11	4.40	—
长江证券	1	1,097,365,397.65	5.94	4,407,950.10	0.64	127,000,000.00	8.07	—	—	932,751.01	6.03	—
德邦证券	1	192,752,805.53	1.04	0.00	0.00	—	—	—	—	163,840.35	1.06	—
高华证券	1	74,152,634.06	0.40	23,784,823.37	3.43	—	—	—	—	63,029.43	0.41	—
国泰君安	2	3,705,120,959.94	20.06	92,868,169.06	13.38	220,500,000.00	14.01	—	—	3,043,783.68	19.67	—
国信证券	1	1,413,117,006.25	7.65	2,094,050.00	0.30	—	—	—	—	1,148,162.29	7.42	—
海通证券	2	2,308,904,080.95	12.50	168,592,758.71	24.30	—	—	2,743,725.27	53.54	1,906,829.12	12.32	—
上海证券	1	12,936,231.00	0.07	0.00	0.00	—	—	—	—	10,995.76	0.07	—
申银万国	1	588,639,454.26	3.19	36,946,832.43	5.32	—	—	—	—	500,338.60	3.23	—
湘财证券	1	1,080,001,316.52	5.85	26,108,925.00	3.76	53,100,000.00	3.37	—	—	917,994.10	5.93	—
兴业证券	1	914,592,386.88	4.95	27,650,180.68	3.98	—	—	—	—	777,397.12	5.02	—
中投证券	1	2,869,551,769.46	15.53	37,924,064.58	5.47	681,700,000.00	43.30	2,380,700.78	46.46	2,439,115.55	15.76	—
中信建投	1	49,685,789.36	0.27	0.00	0.00	—	—	—	—	42,232.73	0.27	—

中信证券	1	312,191,695.77	1.69	180,918,073.19	26.07	—	—	—	—	265,359.86	1.71	—
中银国际	1	399,354,413.19	2.16	0.00	0.00	—	—	—	—	324,477.90	2.10	—

注：我对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的；我对基金交易席位的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的；上述佣金已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金；本基金本报告期新租用以下交易单元：德邦证券的上交所 24228 交易单元。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2009年1月16日，本基金托管人公告聘请胡哲一先生担任本基金托管人副行长；
- 2、2009年5月14日，美国银行公告关于本基金托管人股权变动报告书；
- 3、2009年5月26日，中国建银投资有限责任公司公告关于本基金托管人股权变动报告书；
- 4、2009年5月26日，中央汇金投资有限责任公司公告关于本基金托管人股权变动报告书；
- 5、2009年8月2日，本基金托管人公告，自2009年7月24日起陈佐夫先生就任本基金托管人执行董事；
- 6、2009年9月27日，本基金托管人发布关于控股股东增持股份计划实施情况的公告；
- 7、2009年10月11日，本基金托管人发布关于控股股东增持本基金托管人股份的公告。