

富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）

二〇〇九年年度报告

（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： 中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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 | 富国天惠成长混合 (LOF) |
| 基金主代码 | 161005 |
| 交易代码 | 前端交易代码: 161005 后端交易代码: 161006 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2005 年 11 月 16 日 |
| 基金管理人 | 富国基金管理有限公司 |
| 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 | 1, 866, 346, 951. 13 份 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2006 年 2 月 16 日 |

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且合理定价的股票, 在利用金融工程技术控制组合风险的前提下, 谋求基金资产的长期最大化增值。 |
| 投资策略 | 本基金采用主动投资管理策略, 基于“快速成长、合理定价”的选股标准精选个股, 并在坚持以基本面研究驱动投资的基础上进行适度的选时操作, 争取投资收益的最大化。 |
| 业绩比较基准 | 中信标普 300 指数×70%+中信国债指数×25%+同业存款利率×5% |
| 风险收益特征 | 本基金是一只主动投资的混合型基金, 主要投资于具有良好成长性且合理定价的股票, 风险和预期收益匹配, 属于风险适中的证券投资基金品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产长期稳定增长。 |

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李长伟 | 蒋松云 |
| | 联系电话 | 021-68597788 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | public@fullgoal.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 95105686、4008880688 | 95588 |
| 传真 | | 021-68597799 | 010-66105798 |

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 |

| | |
|--|----------------------------------|
| | 中国工商银行股份有限公司 北京市西城区复兴门内大街 55号 |
|--|----------------------------------|

§ 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 |
|---------------|------------------|-------------------|------------------|
| 本期已实现收益 | 663,986,683.70 | -267,629,621.70 | 2,104,586,206.82 |
| 本期利润 | 1,320,482,548.00 | -1,891,166,199.29 | 3,410,851,763.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.7292 | -0.8976 | 0.8811 |
| 本期基金份额净值增长率 | 75.80% | -47.34% | 101.45% |
| 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 | 0.6427 | -0.0656 | 0.7319 |
| 期末基金资产净值 | 3,065,808,425.16 | 1,882,760,171.23 | 4,504,666,169.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.6427 | 0.9344 | 2.0913 |

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 | 16.11% | 1.53% | 13.62% | 1.22% | 2.49% | 0.31% |
| 过去六个月 | 20.09% | 1.72% | 10.33% | 1.48% | 9.76% | 0.24% |
| 过去一年 | 75.80% | 1.58% | 61.80% | 1.42% | 14.00% | 0.16% |
| 过去三年 | 86.50% | 1.95% | 62.45% | 1.75% | 24.05% | 0.20% |
| 自基金合同生效起至今 | 347.08% | 1.78% | 203.68% | 1.57% | 143.40% | 0.21% |

注：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×70%+中信国债指数×25%+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）按下

列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 70\% * [\text{中信标普 300 指数}_t / (\text{中信标普 300 指数}_{t-1}) - 1] + 25\% * [\text{中信国债指数}_t / (\text{中信国债指数}_{t-1}) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360 ;$$

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：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

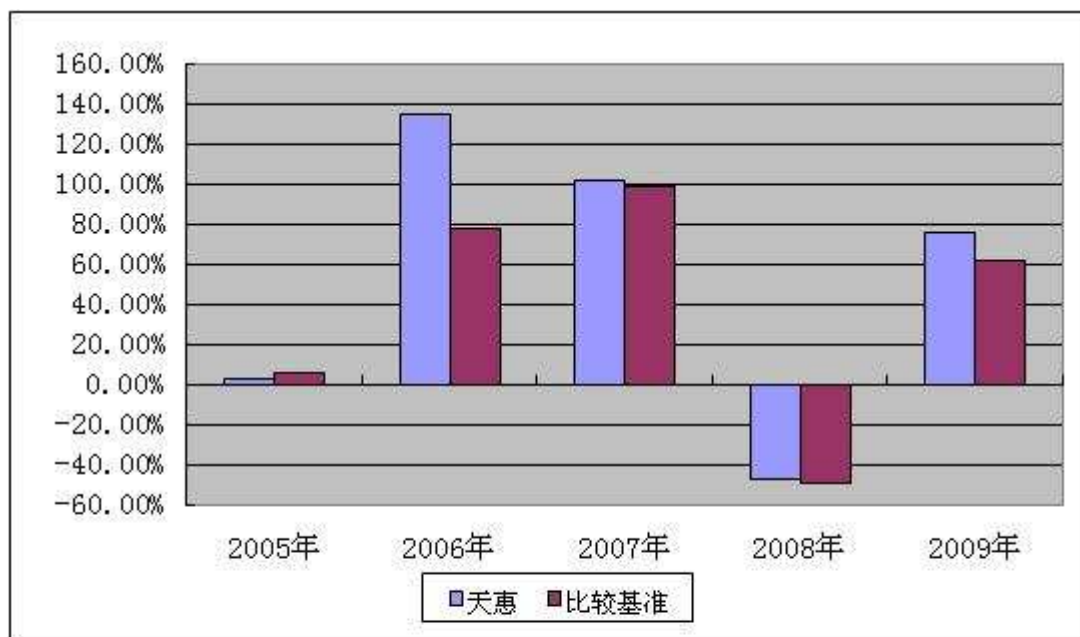
其中， $T=2,3,4,\dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmark}_t)$ 数学连乘。

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



注：截止日期为 2009 年 12 月 31 日。本基金于 2005 年 11 月 16 日成立，建仓期 6 个月，从 2005 年 11 月 16 日至 2006 年 5 月 15 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 自基金合同生效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：基金合同生效日为2005年11月16日。2005年净值增长率按实际存续期计算。

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 | 3.000 | 389,966,450.01 | 332,589,981.40 | 722,556,431.41 | 1次分红 |
| 2007年 | 5.300 | 132,907,676.50 | 47,966,117.52 | 180,873,794.02 | 1次分红 |
| 合计 | 8.300 | 522,874,126.51 | 380,556,098.92 | 903,430,225.43 | 2次分红 |

注：本基金于2005年11月16日成立。

§ 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 | | |
| 朱少醒 | 本基金基金经理兼任研究部总经理、汉盛证券投资基金基金经理。 | 2005-11-16 | — | 10 年 | 博士，曾先后担任华夏证券研究所分析师、富国基金研究策划部分析师、富国基金产品开发主管，2004 年 6 月至 2005 年 8 月任富国天益价值基金经理助理，2008 年 11 月至 2010 年 1 月任汉盛基金经理；2005 年 11 月至今任富国天惠精选成长基金经理，现兼任富国基金研究部总经理。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合规守信情况的说明

本报告期，富国基金管理有限公司作为富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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，严格执行交易系统内的公平交易程序，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 |
|------------------------|--------|-----------|
| 富国天瑞强势地区精选混合型证券投资基金 | 99.16% | 52.63% |
| 富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF） | 75.80% | 61.80% |

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瑞强势地区精选混合型证券投资基金与富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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

2009 年全球经济经历了金融危机后的复苏。中国经济率先走出了 V 型复苏的态势。上证综指在盈利恢复和估值回升的双重影响下上涨 78.79%。本基金期间的净值增长率为 75.80%。

本基金在全年保持高仓位运作，充分参与了市场的上涨。在大类资产配置上取得正收益。风格资产表现上来看，09 年经济复苏的初始阶段，价值类资产的估值大幅修复，全年回报超越成长类风格资产。本基金在成长股上的投资占比很高，风格资产配置的超额收益是负的。相应的在行业配置上，强周期的煤炭、金属行业有更大的估值弹性，在复苏初期超额收益显著。本基金在这几个板块上的配置偏低，行业配置的超额收益为负数。最终制约了基金取得更高的收益。

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 1.6427 元，份额累计净值为 3.1427 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 75.80%，同期业绩比较基准收益率为 61.80%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于 2010 年的 A 股市场我们有如下判断：

实体经济将延续复苏的态势。投资将维持较高的增速，消费保持稳定增长，出口在 09 年较低的基数上至少有一个温和的增长。在实体经济复苏的背景下，前期大量的货币投放必将在未来某个时点形成较强的通胀压力。宽松的货币政策、财政政策的相机退出已成定局。宏观调控的收紧政策也会持续出台。在未来较长一段时间内，市场将在强劲的企业基本面和收紧的流动性两大因素的交织影响下运行。市场投资机会将较多体现为发掘个股的阿尔法投资机会。宏观政策的较大不确定性可能会持续影响市场情绪，并在某些阶段产生过度反应，这期间也会给价值投资者提供较好的投资机会。

个股选择层面，本基金偏好投资于具有良好“企业基因”、公司治理结构完善、管理层优秀的企业。我们认为此类企业，有更大的概率能在未来几年都获得高质量的

增长。分享企业自身增长带来的资本市场收益是成长型基金取得收益的最佳途径。政府主导的投资方向、城市化、产业结构升级、新能源等对市场有中长期影响的投资主题始终体现在本基金组合的构建和调整过程中。

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

本基金于 2010 年 1 月 5 日公告对 2009 年报告期内利润进行收益分配。本基金 2009 年年度已实现收益为 663,986,683.70 元，每 10 份基金份额派发现金红利 1.80 元，本基金 2009 年共计派发红利 343,947,969.52 元，占年度已实现收益的 51.80%。根据本基金《基金合同》约定：“本基金年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的 50%；”，因此本基金本期分红已符合本基金合同的约定。

§ 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，本基金托管人在对富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2009 年，富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）的托管人——富国基金管理有限公司在富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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，富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）未进行利润分配。

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

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国天惠精选成长混合型证券投资基金（LOF）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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2010年3月25日

§ 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：富国天惠精选成长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 | 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 | 113,601,209.01 | 112,198,609.68 |
| 结算备付金 | 10,870,350.85 | 742,247.22 |
| 存出保证金 | 2,807,596.49 | 759,666.76 |
| 交易性金融资产 | 2,944,666,395.96 | 1,770,683,494.75 |
| 其中：股票投资 | 2,833,786,395.96 | 1,629,395,424.75 |
| 基金投资 | — | — |
| 债券投资 | 110,880,000.00 | 141,288,070.00 |
| 资产支持证券投资 | — | — |
| 衍生金融资产 | — | 1,693,851.12 |
| 买入返售金融资产 | — | — |
| 应收证券清算款 | 5,499,767.12 | 457,001.09 |
| 应收利息 | 1,951,907.21 | 1,211,455.71 |
| 应收股利 | — | — |
| 应收申购款 | 783,522.39 | 575,370.96 |
| 递延所得税资产 | — | — |
| 其他资产 | — | — |
| 资产总计 | 3,080,180,749.03 | 1,888,321,697.29 |
| 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 | — | 19,719.54 |
| 应付赎回款 | 5,005,297.17 | 1,221,713.20 |
| 应付管理人报酬 | 3,866,087.75 | 2,442,865.95 |
| 应付托管费 | 644,347.96 | 407,144.33 |
| 应付销售服务费 | — | — |
| 应付交易费用 | 4,234,358.60 | 864,006.85 |
| 应交税费 | — | — |
| 应付利息 | — | — |
| 应付利润 | — | — |
| 递延所得税负债 | — | — |
| 其他负债 | 622,232.39 | 606,076.19 |
| 负债合计 | 14,372,323.87 | 5,561,526.06 |
| 所有者权益： | | |
| 实收基金 | 1,866,346,951.13 | 2,014,839,133.24 |
| 未分配利润 | 1,199,461,474.03 | -132,078,962.01 |
| 所有者权益合计 | 3,065,808,425.16 | 1,882,760,171.23 |
| 负债和所有者权益总计 | 3,080,180,749.03 | 1,888,321,697.29 |

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6427 元，基金份额总额 1,866,346,951.13 份。

7.2 利润表

会计主体：富国天惠精选成长混合型证券投资基金

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 | 1,386,498,574.33 | -1,823,193,487.21 |
| 1. 利息收入 | 3,520,027.99 | 6,086,299.37 |
| 其中：存款利息收入 | 1,098,621.02 | 1,691,098.63 |
| 债券利息收入 | 2,421,406.97 | 4,295,450.74 |
| 资产支持证券利息收入 | — | — |
| 买入返售金融资产收入 | — | 99,750.00 |
| 其他利息收入 | — | — |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | 724,988,927.58 | -208,243,749.07 |
| 其中：股票投资收益 | 684,661,686.10 | -226,253,779.52 |
| 基金投资收益 | — | — |
| 债券投资收益 | 23,976,079.60 | -551,992.47 |
| 资产支持证券投资收益 | — | — |
| 衍生工具投资收益 | 2,774,832.47 | 1,507,916.14 |

| | | |
|----------------------------|-------------------------|--------------------------|
| 股利收益 | 13,576,329.41 | 17,054,106.78 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 656,495,864.30 | -1,623,536,577.59 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | — | — |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 1,493,754.46 | 2,500,540.08 |
| 减：二、费用 | 66,016,026.33 | 67,972,712.08 |
| 1. 管理人报酬 | 35,613,734.03 | 41,486,073.76 |
| 2. 托管费 | 5,935,622.37 | 6,914,345.60 |
| 3. 销售服务费 | — | — |
| 4. 交易费用 | 23,563,228.19 | 17,341,222.24 |
| 5. 利息支出 | 423,200.53 | 1,745,930.48 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | 423,200.53 | 1,745,930.48 |
| 6. 其他费用 | 480,241.21 | 485,140.00 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | 1,320,482,548.00 | -1,891,166,199.29 |
| 减：所得税费用 | — | — |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | 1,320,482,548.00 | -1,891,166,199.29 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天惠精选成长混合型证券投资基金

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） | 2,014,839,133.24 | -132,078,962.01 | 1,882,760,171.23 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | — | 1,320,482,548.00 | 1,320,482,548.00 |
| 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） | -148,492,182.11 | 11,057,888.04 | -137,434,294.07 |
| 其中：1. 基金申购款 | 779,841,160.70 | 297,224,423.58 | 1,077,065,584.28 |
| 2. 基金赎回款 | -928,333,342.81 | -286,166,535.54 | -1,214,499,878.35 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | — | — | — |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 1,866,346,951.13 | 1,199,461,474.03 | 3,065,808,425.16 |
| 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） | 2,153,952,160.39 | 2,350,714,008.79 | 4,504,666,169.18 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动 | — | -1,891,166,199.29 | -1,891,166,199.29 |

| | | | |
|--|-------------------|-----------------|-------------------|
| 数（本期利润） | | | |
| 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） | -139,113,027.15 | 130,929,659.90 | -8,183,367.25 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,238,477,304.73 | 708,450,223.29 | 1,946,927,528.02 |
| 2. 基金赎回款 | -1,377,590,331.88 | -577,520,563.39 | -1,955,110,895.27 |
| 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） | - | -722,556,431.41 | -722,556,431.41 |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 2,014,839,133.24 | -132,078,962.01 | 1,882,760,171.23 |

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：

| | | |
|-----------|-----------|---------|
| 窦玉明 | 林志松 | 雷青松 |
| _____ | _____ | _____ |
| 基金管理公司负责人 | 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

富国天惠精选成长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]143号文《关于同意富国天惠精选成长混合型证券投资基金募集的批复》以及证监基金字[2005]152号《关于同意富国天惠精选成长混合型证券投资基金变更为上市开放式基金（LOF）的批复》的核准，由富国基金管理有限公司作为发起人向社会公开募集，基金合同于2005年11月16日正式生效，首次设立募集规模为584,312,553.76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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具，其中债券部分包括国债、金融债、企业（公司）债（包括可转债）以及中国证监会允许基金投资的其他债券。基金股票部分主要投资于具有良好成长性且合理定价的上市公司股票。本基金投资组合中的股票投资比例浮动范围为：50%-95%；债券和短期金融工具的投资比例浮动范围为：5%-50%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于5%。投资于具有良好成长性且合理定价的上市公司股票的比例不低于基金股票投资的80%。本基金的业绩比较基准为：中信标普300指数×70%+中信国债指数×25%+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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 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 | 4,744,664,345.83 | 30.79 | 2,045,436,578.78 | 32.48 |
| 申银万国 | 3,070,564,160.17 | 19.93 | 1,260,946,523.68 | 20.02 |

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 | 2,469,794.40 | 74.31 | 2,851,980.42 | 32.04 |
| 申银万国 | 853,912.24 | 25.69 | 1,505,823.04 | 16.92 |

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 | 42,904,553.64 | 14.73 | 12,441,944.13 | 3.02 |
| 申银万国 | 21,597,026.54 | 7.41 | 53,017,961.72 | 12.88 |

7.4.7.1.4 回购交易

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 | 占当期回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期回购成交总额的比例(%) |
| 海通证券 | 430,500,000.00 | 15.85 | 100,000,000.00 | 4.52 |
| 申银万国 | 527,400,000.00 | 19.41 | 835,300,000.00 | 37.74 |

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 | 3,933,216.11 | 30.50 | 1,033,591.31 | 24.41 |
| 申银万国 | 2,609,961.22 | 20.24 | 984,865.17 | 23.26 |
| 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 | 1,665,018.14 | 31.58 | 232,587.57 | 26.92 |
| 申银万国 | 1,071,798.47 | 20.33 | 78,849.02 | 9.13 |

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 | 35,613,734.03 | 41,486,073.76 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 3,009,166.78 | 3,779,158.19 |

注：(1) 本基金的管理费按该基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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 | 5,935,622.37 | 6,914,345.60 |

注：(1) 本基金的托管费按基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，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

注：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。

7.4.7.4 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于 2009 年年末和 2008 年年末均未投资本基金。

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 |
| 中国工商银行 | 113,601,209.01 | 994,864.60 | 112,198,609.68 | 1,477,684.91 |

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

本基金本期末无其他关联交易事项的说明。

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 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末 | 备 |
|------|------|-------|------|-----|----|-----|----|----|----|---|
|------|------|-------|------|-----|----|-----|----|----|----|---|

| | | | | 限类型 | 价格 | 值单价 | (单位: 股) | 成本总额 | 估值总额 | 注 |
|--------|------|------------|------------|-------------|-------|--------|-----------|---------------|---------------|---|
| 002024 | 苏宁电器 | 2009-12-30 | 2010-12-31 | 非公开发 行股票 | 17.20 | 17.23 | 2,500,000 | 43,000,000.00 | 43,075,000.00 | — |
| 002299 | 圣农发展 | 2009-10-13 | 2010-01-21 | 新股认购 | 19.75 | 25.03 | 38,387 | 758,143.25 | 960,826.61 | — |
| 002308 | 威创股份 | 2009-11-18 | 2010-03-01 | 新股认购 | 23.80 | 31.83 | 21,850 | 520,030.00 | 695,485.50 | — |
| 002315 | 焦点科技 | 2009-12-01 | 2010-03-09 | 新股认购 | 42.00 | 69.18 | 7,639 | 320,838.00 | 528,466.02 | — |
| 002322 | 理工监测 | 2009-12-11 | 2010-03-18 | 新股认购 | 40.00 | 61.88 | 9,997 | 399,880.00 | 618,614.36 | — |
| 002329 | 皇氏乳业 | 2009-12-25 | 2010-04-06 | 新股认购 | 20.10 | 20.10 | 46,307 | 930,770.70 | 930,770.70 | — |
| 300002 | 神州泰岳 | 2009-09-29 | 2010-02-01 | 新股认购 | 58.00 | 105.20 | 14,806 | 858,748.00 | 1,557,591.20 | — |
| 300027 | 华谊兄弟 | 2009-10-19 | 2010-02-01 | 新股认购 | 28.58 | 55.43 | 22,451 | 641,649.58 | 1,244,458.93 | — |
| 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 | — |
| 600703 | 三安光电 | 2009-09-30 | 2010-09-29 | 非公开发 行股票 | 26.00 | 32.88 | 800,000 | 20,800,000.00 | 26,304,000.00 | — |
| 600999 | 招商证券 | 2009-11-12 | 2010-02-22 | 新股认购 | 31.00 | 29.39 | 43,698 | 1,354,638.00 | 1,284,284.22 | — |
| 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 | — |

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 |
|--------|------|------------|--------|------------|------------|----------------|---------------|--------------|--------------|----|
| 600460 | 士兰微 | 2009-12-25 | 筹划重大事项 | 11.27 | 2010-01-04 | 12.40 | 200,000 | 1,622,240.41 | 2,254,000.00 | — |

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：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无交易所市场债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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 | 2,833,786,395.96 | 92.00 |
| | 其中：股票 | 2,833,786,395.96 | 92.00 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 2 | 固定收益投资 | 110,880,000.00 | 3.60 |
| | 其中：债券 | 110,880,000.00 | 3.60 |
| | 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 | 124,471,559.86 | 4.04 |
| 6 | 其他各项资产 | 11,042,793.21 | 0.36 |
| 7 | 合计 | 3,080,180,749.03 | 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 | 960,826.61 | 0.03 |
| B | 采掘业 | 246,612,897.61 | 8.04 |
| C | 制造业 | 979,188,668.63 | 31.94 |
| C0 | 食品、饮料 | 233,287,053.20 | 7.61 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | 1,168,000.00 | 0.04 |
| C2 | 木材、家具 | — | — |
| C3 | 造纸、印刷 | 10,104,500.56 | 0.33 |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 191,515,130.70 | 6.25 |
| C5 | 电子 | 40,777,652.00 | 1.33 |
| C6 | 金属、非金属 | 155,182,142.28 | 5.06 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 249,043,330.67 | 8.12 |
| C8 | 医药、生物制品 | 97,912,259.22 | 3.19 |
| C99 | 其他制造业 | 198,600.00 | 0.01 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 27,651,000.00 | 0.90 |
| E | 建筑业 | 12,360,000.00 | 0.40 |
| F | 交通运输、仓储业 | 12,051,652.20 | 0.39 |
| G | 信息技术业 | 367,257,337.64 | 11.98 |
| H | 批发和零售贸易 | 395,319,459.82 | 12.89 |
| I | 金融、保险业 | 604,808,237.50 | 19.73 |
| J | 房地产业 | 62,052,910.00 | 2.02 |
| K | 社会服务业 | 2,823,090.00 | 0.09 |
| L | 传播与文化产业 | 37,691,258.93 | 1.23 |
| M | 综合类 | 85,009,057.02 | 2.77 |
| | 合计 | 2,833,786,395.96 | 92.43 |

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 | 9,300,000 | 184,379,000.00 | 6.01 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 1,000,000 | 169,820,000.00 | 5.54 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 2,385,000 | 131,389,650.00 | 4.29 |
| 4 | 600050 | 中国联通 | 17,500,000 | 127,575,000.00 | 4.16 |
| 5 | 600016 | 民生银行 | 15,007,631 | 118,710,361.21 | 3.87 |
| 6 | 600271 | 航天信息 | 5,006,564 | 101,533,117.92 | 3.31 |
| 7 | 000061 | 农产品 | 6,500,000 | 90,220,000.00 | 2.94 |
| 8 | 002153 | 石基信息 | 2,600,000 | 85,748,000.00 | 2.80 |
| 9 | 600858 | 银座股份 | 3,000,849 | 77,962,057.02 | 2.54 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 4,280,000 | 77,254,000.00 | 2.52 |

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 | 600050 | 中国联通 | 357,234,502.11 | 18.97 |
| 2 | 600030 | 中信证券 | 305,933,364.49 | 16.25 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 241,146,339.59 | 12.81 |
| 4 | 600016 | 民生银行 | 177,200,171.05 | 9.41 |
| 5 | 600271 | 航天信息 | 170,754,346.38 | 9.07 |
| 6 | 000024 | 招商地产 | 160,226,452.72 | 8.51 |
| 7 | 600519 | 贵州茅台 | 159,195,147.19 | 8.46 |
| 8 | 000061 | 农产品 | 151,878,445.52 | 8.07 |
| 9 | 601601 | 中国太保 | 143,664,604.55 | 7.63 |
| 10 | 000002 | 万科A | 136,044,754.72 | 7.23 |
| 11 | 600036 | 招商银行 | 136,040,131.75 | 7.23 |
| 12 | 600858 | 银座股份 | 129,809,759.82 | 6.89 |
| 13 | 600585 | 海螺水泥 | 127,999,061.48 | 6.80 |
| 14 | 600196 | 复星医药 | 120,041,770.56 | 6.38 |
| 15 | 000792 | 盐湖钾肥 | 112,828,775.95 | 5.99 |
| 16 | 002001 | 新和成 | 112,473,548.83 | 5.97 |
| 17 | 000012 | 南玻A | 101,296,399.84 | 5.38 |
| 18 | 002024 | 苏宁电器 | 96,326,762.37 | 5.12 |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 95,374,072.13 | 5.07 |
| 20 | 000417 | 合肥百货 | 93,754,960.29 | 4.98 |
| 21 | 601166 | 兴业银行 | 89,813,033.34 | 4.77 |
| 22 | 002007 | 华兰生物 | 88,670,659.51 | 4.71 |
| 23 | 000895 | 双汇发展 | 87,264,064.69 | 4.63 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 24 | 601001 | 大同煤业 | 87,120,124.26 | 4.63 |
| 25 | 000001 | 深发展A | 83,944,015.39 | 4.46 |
| 26 | 000898 | 鞍钢股份 | 81,596,793.94 | 4.33 |
| 27 | 600582 | 天地科技 | 81,538,237.78 | 4.33 |
| 28 | 600028 | 中国石化 | 79,553,173.91 | 4.23 |
| 29 | 000402 | 金融街 | 79,349,445.23 | 4.21 |
| 30 | 600997 | 开滦股份 | 78,331,079.93 | 4.16 |
| 31 | 601168 | 西部矿业 | 77,023,035.27 | 4.09 |
| 32 | 600251 | 冠农股份 | 74,792,411.65 | 3.97 |
| 33 | 600208 | 新湖中宝 | 74,758,513.36 | 3.97 |
| 34 | 000858 | 五粮液 | 73,655,369.79 | 3.91 |
| 35 | 601766 | 中国南车 | 71,848,700.17 | 3.82 |
| 36 | 600104 | 上海汽车 | 71,719,883.13 | 3.81 |
| 37 | 600415 | 小商品城 | 71,434,970.40 | 3.79 |
| 38 | 600703 | 三安光电 | 71,179,865.73 | 3.78 |
| 39 | 600628 | 新世界 | 71,145,733.09 | 3.78 |
| 40 | 000933 | 神火股份 | 70,205,653.49 | 3.73 |
| 41 | 600320 | 振华重工 | 69,352,808.38 | 3.68 |
| 42 | 600000 | 浦发银行 | 68,770,613.93 | 3.65 |
| 43 | 600683 | 京投银泰 | 66,861,809.56 | 3.55 |
| 44 | 600895 | 张江高科 | 64,108,250.77 | 3.41 |
| 45 | 600557 | 康缘药业 | 63,347,834.48 | 3.36 |
| 46 | 000983 | 西山煤电 | 62,821,246.38 | 3.34 |
| 47 | 000028 | 一致药业 | 61,760,234.00 | 3.28 |
| 48 | 600563 | 法拉电子 | 57,933,258.17 | 3.08 |
| 49 | 600007 | 中国国贸 | 54,100,922.01 | 2.87 |
| 50 | 600027 | 华电国际 | 50,303,378.41 | 2.67 |
| 51 | 000937 | 金牛能源 | 48,234,676.32 | 2.56 |
| 52 | 600298 | 安琪酵母 | 47,240,055.24 | 2.51 |
| 53 | 600123 | 兰花科创 | 47,201,735.06 | 2.51 |
| 54 | 000400 | 许继电气 | 46,962,983.69 | 2.49 |
| 55 | 601006 | 大秦铁路 | 46,308,650.37 | 2.46 |
| 56 | 600195 | 中牧股份 | 46,082,993.40 | 2.45 |
| 57 | 002153 | 石基信息 | 45,377,495.64 | 2.41 |
| 58 | 600238 | 海南椰岛 | 44,315,811.68 | 2.35 |
| 59 | 600312 | 平高电气 | 43,181,609.95 | 2.29 |
| 60 | 600009 | 上海机场 | 42,492,057.12 | 2.26 |
| 61 | 000063 | 中兴通讯 | 42,282,482.18 | 2.25 |
| 62 | 601169 | 北京银行 | 42,153,825.48 | 2.24 |
| 63 | 600011 | 华能国际 | 41,981,195.59 | 2.23 |
| 64 | 600037 | 歌华有线 | 41,495,034.42 | 2.20 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 65 | 600642 | 申能股份 | 41,412,303.32 | 2.20 |
| 66 | 601939 | 建设银行 | 40,251,630.94 | 2.14 |
| 67 | 600583 | 海油工程 | 40,025,716.81 | 2.13 |
| 68 | 000338 | 潍柴动力 | 40,007,411.90 | 2.12 |
| 69 | 600660 | 福耀玻璃 | 39,461,593.05 | 2.10 |
| 70 | 600309 | 烟台万华 | 39,029,383.35 | 2.07 |
| 71 | 002142 | 宁波银行 | 38,570,402.37 | 2.05 |
| 72 | 601666 | 平煤股份 | 37,809,697.64 | 2.01 |

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 | 600030 | 中信证券 | 373,639,960.83 | 19.85 |
| 2 | 600050 | 中国联通 | 269,800,024.59 | 14.33 |
| 3 | 002007 | 华兰生物 | 224,874,400.67 | 11.94 |
| 4 | 601318 | 中国平安 | 201,719,930.10 | 10.71 |
| 5 | 000061 | 农产品 | 198,875,132.67 | 10.56 |
| 6 | 600271 | 航天信息 | 196,059,567.69 | 10.41 |
| 7 | 000002 | 万科A | 191,676,194.08 | 10.18 |
| 8 | 600519 | 贵州茅台 | 172,388,655.92 | 9.16 |
| 9 | 000024 | 招商地产 | 169,371,363.68 | 9.00 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 167,607,773.96 | 8.90 |
| 11 | 000012 | 南玻A | 145,780,078.24 | 7.74 |
| 12 | 002024 | 苏宁电器 | 135,043,539.99 | 7.17 |
| 13 | 600196 | 复星医药 | 133,822,383.87 | 7.11 |
| 14 | 600585 | 海螺水泥 | 132,742,136.80 | 7.05 |
| 15 | 600000 | 浦发银行 | 119,734,631.16 | 6.36 |
| 16 | 601601 | 中国太保 | 119,640,809.79 | 6.35 |
| 17 | 600415 | 小商品城 | 118,062,522.94 | 6.27 |
| 18 | 000792 | 盐湖钾肥 | 109,111,481.22 | 5.80 |
| 19 | 600031 | 三一重工 | 107,930,889.45 | 5.73 |
| 20 | 002028 | 思源电气 | 102,729,300.22 | 5.46 |
| 21 | 600036 | 招商银行 | 102,280,492.71 | 5.43 |
| 22 | 600208 | 新潮中宝 | 97,966,517.49 | 5.20 |
| 23 | 000402 | 金融街 | 93,355,757.45 | 4.96 |
| 24 | 000895 | 双汇发展 | 92,358,485.53 | 4.91 |
| 25 | 600104 | 上海汽车 | 90,580,729.32 | 4.81 |
| 26 | 600596 | 新安股份 | 88,447,763.74 | 4.70 |
| 27 | 600858 | 银座股份 | 87,858,053.70 | 4.67 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 28 | 000417 | 合肥百货 | 79,119,514.61 | 4.20 |
| 29 | 601168 | 西部矿业 | 77,517,441.86 | 4.12 |
| 30 | 600315 | 上海家化 | 76,310,125.37 | 4.05 |
| 31 | 600028 | 中国石化 | 75,299,038.32 | 4.00 |
| 32 | 600997 | 开滦股份 | 74,604,045.22 | 3.96 |
| 33 | 600320 | 振华重工 | 73,893,519.61 | 3.92 |
| 34 | 600016 | 民生银行 | 72,233,066.56 | 3.84 |
| 35 | 600251 | 冠农股份 | 71,330,778.68 | 3.79 |
| 36 | 000069 | 华侨城A | 68,066,371.13 | 3.62 |
| 37 | 600009 | 上海机场 | 67,624,819.66 | 3.59 |
| 38 | 000898 | 鞍钢股份 | 66,761,010.82 | 3.55 |
| 39 | 600660 | 福耀玻璃 | 66,610,680.78 | 3.54 |
| 40 | 600557 | 康缘药业 | 63,792,688.71 | 3.39 |
| 41 | 002001 | 新 和 成 | 63,416,572.39 | 3.37 |
| 42 | 600007 | 中国国贸 | 63,114,954.02 | 3.35 |
| 43 | 600895 | 张江高科 | 61,349,065.86 | 3.26 |
| 44 | 000028 | 一致药业 | 61,027,424.46 | 3.24 |
| 45 | 600309 | 烟台万华 | 56,914,845.15 | 3.02 |
| 46 | 600582 | 天地科技 | 55,284,033.46 | 2.94 |
| 47 | 002202 | 金风科技 | 55,264,411.97 | 2.94 |
| 48 | 601006 | 大秦铁路 | 54,744,696.10 | 2.91 |
| 49 | 600298 | 安琪酵母 | 54,358,690.59 | 2.89 |
| 50 | 600628 | 新世界 | 53,578,728.06 | 2.85 |
| 51 | 000858 | 五 粮 液 | 50,480,333.31 | 2.68 |
| 52 | 600703 | 三安光电 | 50,096,737.19 | 2.66 |
| 53 | 600027 | 华电国际 | 48,225,204.45 | 2.56 |
| 54 | 600195 | 中牧股份 | 47,378,064.11 | 2.52 |
| 55 | 601166 | 兴业银行 | 46,590,663.42 | 2.47 |
| 56 | 600123 | 兰花科创 | 46,043,036.85 | 2.45 |
| 57 | 002242 | 九阳股份 | 45,117,411.44 | 2.40 |
| 58 | 600015 | 华夏银行 | 44,912,669.41 | 2.39 |
| 59 | 000400 | 许继电气 | 44,665,003.21 | 2.37 |
| 60 | 600312 | 平高电气 | 44,593,800.90 | 2.37 |
| 61 | 600583 | 海油工程 | 44,423,418.02 | 2.36 |
| 62 | 600238 | 海南椰岛 | 43,261,553.02 | 2.30 |
| 63 | 000001 | 深发展A | 41,767,087.66 | 2.22 |
| 64 | 600785 | 新华百货 | 41,277,001.08 | 2.19 |
| 65 | 600011 | 华能国际 | 39,686,948.53 | 2.11 |
| 66 | 601939 | 建设银行 | 39,572,423.06 | 2.10 |

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 | 7,675,174,486.92 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 7,816,642,979.48 |

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 | 110,880,000.00 | 3.62 |
| 2 | 央行票据 | — | — |
| 3 | 金融债券 | — | — |
| | 其中：政策性金融债 | — | — |
| 4 | 企业债券 | — | — |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 可转债 | — | — |
| 7 | 其他 | — | — |
| 8 | 合计 | 110,880,000.00 | 3.62 |

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 | 010004 | 20 国债(4) | 1,100,000 | 110,880,000.00 | 3.62 |

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。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

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 | 2,807,596.49 |
| 2 | 应收证券清算款 | 5,499,767.12 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 1,951,907.21 |
| 5 | 应收申购款 | 783,522.39 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 11,042,793.21 |

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 | 43,075,000.00 | 1.41 | 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(%) |
| 63029 | 29,610.92 | 618,012,780.31 | 33.11 | 1,248,334,170.82 | 66.89 |

9.2 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 | 季占柱 | 1,837,378 | 2.91 |
| 2 | 张红 | 963,833 | 1.46 |

| | | | |
|----|--------------------|---------|------|
| 3 | 杭州建软软件技术开发有限公司 | 767,787 | 1.16 |
| 4 | 孙福坚 | 516,182 | 0.78 |
| 5 | 北京安华房地产开发有限公司 | 463,764 | 0.70 |
| 6 | 陕西省国际信托股份有限公司-弘酬1号 | 457,521 | 0.69 |
| 7 | 赵玉林 | 440,967 | 0.67 |
| 8 | 王群 | 425,377 | 0.64 |
| 9 | 陈荣新 | 381,871 | 0.58 |
| 10 | 王慕洁 | 355,446 | 0.54 |

注：持有人为场内持有人等。

9.3 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 | 173,848.21 | 0.0093 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2005年11月16日)基金份额总额 | 584,312,553.76 |
| 报告期期初基金份额总额 | 2,014,839,133.24 |
| 本报告期基金总申购份额 | 779,841,160.70 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 928,333,342.81 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | — |
| 本报告期期末基金份额总额 | 1,866,346,951.13 |

§ 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本基金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 10 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 (%) | |
| 海通证券 | 2 | 4,744,664,345.83 | 30.79 | 42,904,553.64 | 14.73 | 430,500,000.00 | 15.85 | 2,469,794.40 | 74.31 | 3,933,216.11 | 30.50 | — |
| 华西证券 | 1 | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — | — |
| 申银万国 | 1 | 3,070,564,160.17 | 19.93 | 21,597,026.54 | 7.41 | 527,400,000.00 | 19.41 | 853,912.24 | 25.69 | 2,609,961.22 | 20.24 | — |
| 湘财证券 | 1 | 843,197,613.36 | 5.47 | 154,513,098.63 | 53.04 | 209,200,000.00 | 7.70 | — | — | 716,711.03 | 5.56 | — |
| 兴业证券 | 1 | 746,777,947.40 | 4.85 | 36,326,084.70 | 12.47 | 197,000,000.00 | 7.25 | — | — | 634,756.24 | 4.92 | — |
| 银河证券 | 1 | 2,723,577,271.17 | 17.68 | — | — | — | — | — | — | 2,212,924.98 | 17.16 | — |
| 中信证券 | 1 | 3,278,513,500.92 | 21.28 | 35,955,980.94 | 12.34 | 1,352,800,000.00 | 49.79 | — | — | 2,786,721.61 | 21.61 | — |

注：我对基金交易单元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。本期内本基金租用券商交易单元无变更。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金无影响投资者决策的其他重要事项。