

富国天合稳健优选股票型证券投资基金

二〇一〇年半年度报告

2010年06月30日

基金管理人： 富国基金管理有限公司

基金托管人： 招商银行股份有限公司

送出日期： 2010年08月24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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2010 年 8 月 20 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	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合规守信情况的说明.....	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说明.....	10
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	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§5	托管人报告.....	10
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3	托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6	半年度财务报表(未经审计).....	11
6.1	资产负债表.....	11
6.2	利润表.....	12
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	13
6.4	报表附注.....	14
§7	投资组合报告.....	28
7.1	期末基金资产组合情况.....	28
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	29
7.3	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.....	29
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	35
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
7.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	37
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	37
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	37
7.9	投资组合报告附注.....	37
§8	基金份额持有人信息.....	38
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	38

§9	开放式基金份额变动.....	38
§10	重大事件揭示.....	39
10.1	基金份额持有人大会决议.....	39
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	39
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4	基金投资策略的改变.....	39
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	39
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	40
10.8	其他重大事件.....	41
§11	备查文件目录.....	41

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	富国天合稳健优选股票型证券投资基金
基金简称	富国天合稳健股票
基金主代码	100026
交易代码	前端交易代码：100026 后端交易代码：100027
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年11月15日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,496,270,005.05份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要采用“核心—卫星”总体策略，以优选并复制绩优基金重仓股为基石，有效综合基金管理人的主动投资管理能力，力争投资业绩实现基金行业平均水平之上的二次超越，谋求基金资产的长期最大化增值。
投资策略	本基金诉求“三重优化”概念，通过优选基金、（构建）优选指数、优选个股进行投资操作，将主动管理与被动跟踪有效结合，力争实现稳健投资业绩基础上的“二次超越”。
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%
风险收益特征	本基金是一只主动投资的股票型基金，力争在稳健投资的基础上实现对基金业平均收益水平的超越，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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李长伟	张燕
	联系电话	021-68597788	0755-83199084
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		95105686、4008880688	95555
传真		021-68597799	0755-83195201
注册地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
办公地址		上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5、6层	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		200120	518040

法定代表人	陈敏	秦晓
-------	----	----

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、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	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 招商银行股份有限公司 深圳市深南大道7088号招商银行大厦

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年01月01日至2010年06月30日)
本期已实现收益	35,471,833.84
本期利润	-739,395,485.49
加权平均基金份额本期利润	-0.1659
本期加权平均净值利润率	-18.51%
本期基金份额净值增长率	-17.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年06月30日)
期末可供分配利润	-881,618,311.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1961
期末基金资产净值	3,614,651,693.62
期末基金份额净值	0.8039
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2010年06月30日)
基金份额累计净值增长率	91.21%

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。期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.31%	1.29%	-6.09%	1.31%	1.78%	-0.02%
过去三个月	-14.57%	1.44%	-18.58%	1.44%	4.01%	0.00%
过去六个月	-17.00%	1.32%	-22.08%	1.26%	5.08%	0.06%
过去一年	0.24%	1.56%	-13.12%	1.50%	13.36%	0.06%
过去三年	-0.35%	1.75%	-20.11%	1.89%	19.76%	-0.14%
自基金合同生效起至今	91.21%	1.79%	68.03%	1.90%	23.18%	-0.11%

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×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（benchmarkt）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkt} = 80\% * [\text{中信标普 300 指数 } t / (\text{中信标普 300 指数 } t-1) - 1] + 15\% * [\text{中信国债指数 } t / (\text{中信国债指数 } t-1) - 1] + 5\% * \text{同业存款利率} / 360 ;$$

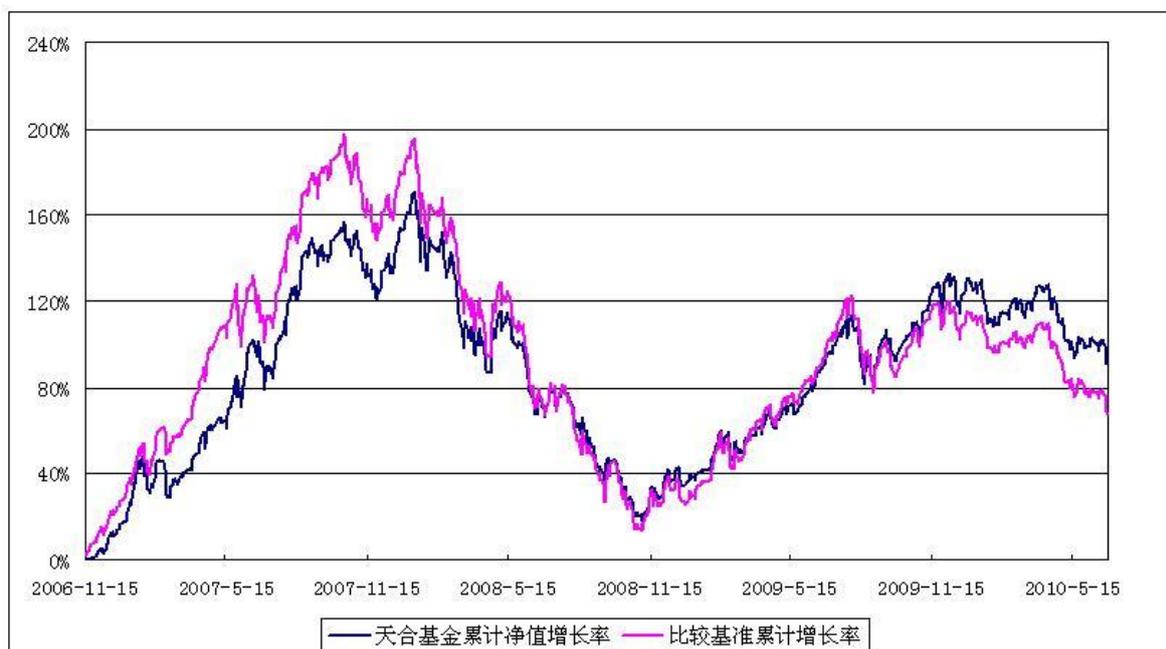
其中，t=1, 2, 3, . . . , T, T 表示时间截至日；

期间 T 日收益率（benchmarkT）按下列公式计算：

$$\text{benchmarkT} = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, . . . ; $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmarkt})$ 表示 t 日至 T 日的 $(1 + \text{benchmarkt})$ 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：本图中所示时间区间为 2006 年 11 月 15 日至 2010 年 6 月 30 日。
本基金于 2006 年 11 月 15 日成立，建仓期 6 个月，从 2006 年 11 月 15 日至 2007 年 5 月 14 日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§ 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 2010 年 6 月 30 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、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、富国沪深 300 增强证券投资基金和富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金十三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		
周蔚文	本基金基金经理	2006-11-15	—	12年	硕士，曾任光大证券研究所研究员；2000年10月任富国基金管理有限公司研究员、高级研究员，2006年11月至今任富国天合基金经理。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合稳健优选股票型证券投资基金的管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《中华人民共和国证券法》、《富国天合稳健优选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，以尽可能减少和分散投资风险，力保基金资产的安全并谋求基金资产长期稳定的增长为目标，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	-17.56%	-26.08%
富国天合稳健优选股票型证券投资基金	-17.00%	-22.08%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	-20.79%	-22.08%

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

年初，本基金判断整个经济为上升周期的中期前半段，虽有政策紧缩，但 A 股市场全年为一个震荡格局，各行业都会有机会，因此各个行业都有配置。虽然周期性行业配置比例不高，但半年来下跌明显。二季度本基金降低了一些行业的股票配置比例，增加了一些个股配置。降低配置的行业是化工、钢铁、煤炭等周期性的板块。个股增加主要分为两部分，一是原有的一些股票增加配置，这主要集中在消费类股票上；二是根据自下而上选择了一些中小股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.8039 元，份额累计净值为 2.1834 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-17%，同期业绩比较基准收益率为-22.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，半年到一年之内国内固定资产投资增长率难以更高，出口也难以有更高增长率，没有出现明显的大市场行业成为经济领头羊，经济增长率难以更高。但是，我们看到 2011 年货币政策不会更紧缩，看到有些新兴产业在孕育之中，如果此时在收入分配制度改革、在抑制房地产泡沫、在放开市场准入等方面政策恰当，中国经济转型将相对平稳。再考虑到股票市场已经大幅回落，即使未来 1-2 年经济增长率相对平稳，也会出现一些结构性机会。

总体上，本基金将继续寻找好行业的优势公司，并在这方面增大配置，为基金净值增长而尽力！

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

本基金本报告期未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

§ 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

托管人声明,在本报告期内,基金托管人——招商银行股份有限公司不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内基金管理人在投资运作、基金资产净值的计算、利润分配、基金份额申购赎回价格的计算、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,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本半年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、利润分配、投资组合报告等内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:富国天合稳健优选股票型证券投资基金

报告截止日:2010年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 (2010年06月30日)	上年度末 (2009年12月31日)
资产:		
银行存款	375,296,858.58	96,542,393.02
结算备付金	5,069,840.67	13,643,512.48
存出保证金	2,091,883.82	1,876,885.99
交易性金融资产	3,227,772,726.86	4,382,690,994.07
其中:股票投资	3,022,019,644.46	4,178,660,994.07
基金投资	—	—
债券投资	205,753,082.40	204,030,000.00
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	81,144,000.00	174,757,150.01
应收利息	1,532,737.20	2,255,364.78
应收股利	341,290.56	—
应收申购款	695,169.36	2,169,593.90
递延所得税资产	—	—

其他资产	—	—
资产总计	3,693,944,507.05	4,673,935,894.25
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2010年06月30日)	(2009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	—	96,000,000.00
应付证券清算款	68,029,629.61	—
应付赎回款	1,524,877.70	7,925,662.85
应付管理人报酬	4,669,734.73	5,723,600.03
应付托管费	778,289.12	953,933.35
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	2,949,981.80	5,769,054.48
应交税费	86,904.00	86,904.00
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	1,253,396.47	879,075.48
负债合计	79,292,813.43	117,338,230.19
所有者权益:		
实收基金	4,496,270,005.05	4,704,755,938.57
未分配利润	-881,618,311.43	-148,158,274.51
所有者权益合计	3,614,651,693.62	4,556,597,664.06
负债和所有者权益总计	3,693,944,507.05	4,673,935,894.25

注：报告截止日 2010 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.8039 元，基金份额总额 4,496,270,005.05 份。

6.2 利润表

会计主体：富国天合稳健优选股票型证券投资基金

本报告期：2010 年 01 月 01 日至 2010 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2010年01月01日至 2010年06月30日)	上年度可比期间 (2009年01月01日至 2009年06月30日)
一、收入	-691,657,193.47	1,268,175,176.85
1. 利息收入	3,471,597.01	4,920,250.52
其中：存款利息收入	1,289,481.94	2,135,247.94
债券利息收入	2,182,115.07	2,785,002.58
资产支持证券利息收入	—	—

买入返售金融资产收入	—	—
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	79,108,064.51	17,685,978.38
其中：股票投资收益	65,589,243.71	-19,493,986.82
基金投资收益	—	—
债券投资收益	-1,774,500.00	18,034,400.66
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	15,293,320.80	19,145,564.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-774,867,319.33	1,244,867,184.24
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	630,464.34	701,763.71
减：二、费用	47,738,292.02	43,274,495.57
1. 管理人报酬	29,745,375.85	25,792,449.80
2. 托管费	4,957,562.67	4,298,741.65
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	12,377,029.12	12,974,180.19
5. 利息支出	446,175.20	—
其中：卖出回购金融资产支出	446,175.20	—
6. 其他费用	212,149.18	209,123.93
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-739,395,485.49	1,224,900,681.28
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-739,395,485.49	1,224,900,681.28

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天合稳健优选股票型证券投资基金

本报告期：2010年01月01日至2010年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 (2010年01月01日至2010年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,704,755,938.57	-148,158,274.51	4,556,597,664.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	-739,395,485.49	-739,395,485.49
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)	-208,485,933.52	5,935,448.57	-202,550,484.95
其中：1. 基金申购款	363,416,035.00	-35,154,152.54	328,261,882.46
2. 基金赎回款	-571,901,968.52	41,089,601.11	-530,812,367.41
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）	4,496,270,005.05	-881,618,311.43	3,614,651,693.62
项目	上年度可比期间 (2009年01月01日至2009年06月30日)		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	5,436,958,830.06	-2,358,338,880.89	3,078,619,949.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,224,900,681.28	1,224,900,681.28
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）	-204,883,518.74	97,329,007.59	-107,554,511.15
其中：1. 基金申购款	673,384,551.77	-186,758,041.23	486,626,510.54
2. 基金赎回款	-878,268,070.51	284,087,048.82	-594,181,021.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,232,075,311.32	-1,036,109,192.02	4,195,966,119.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

富国天合稳健优选股票型证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]178号文《关于同意富国天合稳健优选股票型证券投资基金募集的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2006年11月15日正式生效,首次设立募集规模为4,481,572,083.59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及注册登记人为富国基金管理有限公司,基金托管人为招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 的股票、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。本基金业绩比较基准:中信标普300指数×80%+中信国债指数×15%+同业存款利率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部 2006 年 2 月颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半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而编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则及应用指南、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

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 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期内本基金所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

1. 印花税

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

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2010年06月30日）
活期存款	375,296,858.58
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	375,296,858.58

注：本报告期内本基金未投资于定期存款。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末（2010年06月30日）			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	3,283,866,931.43	3,022,019,644.46	-261,847,286.97	
债券	交易所市场	107,759,000.00	107,643,082.40	-115,917.60
	银行间市场	98,270,000.00	98,110,000.00	-160,000.00
	合计	206,029,000.00	205,753,082.40	-275,917.60
资产支持证券	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	3,489,895,931.43	3,227,772,726.86	-262,123,204.57	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本报告期末本基金未持有买断式逆回购中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末（2010年06月30日）
应收活期存款利息	109,408.01
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	1,774.40
应收债券利息	1,421,463.79
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
其他	91.00
合计	1,532,737.20

6.4.7.6 其他资产

注：本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末（2010年06月30日）
交易所市场应付交易费用	2,949,180.80
银行间市场应付交易费用	801.00
合计	2,949,981.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末（2010年06月30日）
应付券商交易单元保证金	1,000,000.00
应付赎回费	7,042.19
其他	48,000.00
信息披露费	148,765.71
审计费	49,588.57
合计	1,253,396.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	4,704,755,938.57	4,704,755,938.57
本期申购	363,416,035.00	363,416,035.00
本期赎回（以“-”号填列）	-571,901,968.52	-571,901,968.52
本期末	4,496,270,005.05	4,496,270,005.05

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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	-52,311,780.82	-95,846,493.69	-148,158,274.51
本期利润	35,471,833.84	-774,867,319.33	-739,395,485.49
本期基金份额交易产生的变动数	1,016,616.73	4,918,831.84	5,935,448.57
其中：基金申购款	5,645,749.05	-40,799,901.59	-35,154,152.54
基金赎回款	-4,629,132.32	45,718,733.43	41,089,601.11
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-15,823,330.25	-865,794,981.18	-881,618,311.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
活期存款利息收入	1,231,404.92
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	56,407.21
其他	1,669.81
合计	1,289,481.94

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
卖出股票成交总额	4,291,827,205.58
减：卖出股票成本总额	4,226,237,961.87
买卖股票差价收入	65,589,243.71

6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成交总额	108,013,500.00
减：卖出债券（、含债转股及债券到期兑付）成本总额	106,774,500.00
减：应收利息总额	3,013,500.00
债券投资收益	-1,774,500.00

6.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本报告期本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
股票投资产生的股利收益	15,293,320.80
基金投资产生的股利收益	—
合计	15,293,320.80

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期发生（2010年01月01日至2010年06月30日）
1. 交易性金融资产	-774,867,319.33
股票投资	-775,605,901.73
债券投资	738,582.40
资产支持证券投资	—
基金投资	—
2. 衍生工具	—
权证投资	—
3. 其他	—
合计	-774,867,319.33

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
基金赎回费收入	612,124.94
转换费收入	6,031.49
其他收入	12,307.91
合计	630,464.34

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
交易所市场交易费用	12,377,029.12
银行间市场交易费用	—
合计	12,377,029.12

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）
审计费用	49,588.57
信息披露费	148,765.71
银行费用	4,794.90
账户维护费	9,000.00

合计	212, 149. 18
----	--------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本期内本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
富国基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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
招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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30日)	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
申银万国	563, 242, 730. 53	7. 12	879, 207, 620. 25	10. 40

6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30日)	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)
申银万国	—	—	683, 150. 98	0. 55

6.4.10.1.4 回购交易

注：本报告期及上年度可比期间内本基金均未通过关联方交易单元进行回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2010年01月01日至2010年06月30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（%）
申银万国	457,635.83	6.91	269,515.86	9.14
关联方名称	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30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（%）
申银万国	714,360.31	10.06	405,666.07	11.47

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年06月30日）	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30日）
当期发生的基金应支付的管理费	29,745,375.85	25,792,449.80
其中：支付销售机构的客户维护费	4,814,736.37	4,335,939.32

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首日起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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30日）
当期发生的基金应支付的托管费	4,957,562.67	4,298,741.65

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首日起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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）的交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度可比期间末本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.5 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（2010年01月01日至2010年06月30日）		上年度可比期间（2009年01月01日至2009年06月30日）	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	375,296,858.58	1,231,404.92	426,816,707.86	2,082,808.10

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2010年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.12.1.1 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	11.40	3,000,000	51,600,000.00	34,200,000.00	—
002024	苏宁电器	2010-04-16	2010-12-31	非公开发行股票-转增	—	11.40	1,500,000	—	17,100,000.00	—
002378	章源钨业	2010-03-23	2010-07-01	新股认购	13.00	26.34	32,458	421,954.00	854,943.72	—
002384	东山精密	2010-03-31	2010-07-09	新股认购	26.00	57.67	33,624	874,224.00	1,939,096.08	—
002391	长青股份	2010-04-08	2010-07-16	新股认购	51.00	45.39	46,228	2,357,628.00	2,098,288.92	—
002402	和而泰	2010-04-30	2010-08-11	新股认购	35.00	32.80	11,965	418,775.00	392,452.00	—
002405	四维图新	2010-05-06	2010-08-18	新股认购	25.60	33.18	53,907	1,380,019.20	1,788,634.26	—

002407	多氟多	2010-05-06	2010-08-18	新股认购	39.39	41.65	13,740	541,218.60	572,271.00	—
002411	九九久	2010-05-13	2010-08-25	新股认购	25.80	33.00	32,255	832,179.00	1,064,415.00	—
002422	科伦药业	2010-05-26	2010-09-03	新股认购	83.36	93.80	27,223	2,269,309.28	2,553,517.40	—
002431	棕榈园林	2010-06-02	2010-09-10	新股认购	45.00	54.89	30,233	1,360,485.00	1,659,489.37	—
002432	九安医疗	2010-06-02	2010-09-10	新股认购	19.38	23.06	59,058	1,144,544.04	1,361,877.48	—
002441	众业达	2010-06-25	2010-07-06	新股认购	39.90	39.90	500	19,950.00	19,950.00	—
002442	龙星化工	2010-06-25	2010-07-06	新股认购	12.50	12.50	500	6,250.00	6,250.00	—
300072	三聚环保	2010-04-16	2010-07-27	新股认购	32.00	40.82	24,688	790,016.00	1,007,764.16	—
300073	当升科技	2010-04-16	2010-07-27	新股认购	36.00	58.75	33,955	1,222,380.00	1,994,856.25	—
300077	国民技术	2010-04-23	2010-08-02	新股认购	87.50	116.75	10,223	894,512.50	1,193,535.25	—
300082	奥克股份	2010-05-10	2010-08-20	新股认购	85.00	67.55	42,297	3,595,245.00	2,857,162.35	—
300085	银之杰	2010-05-17	2010-08-26	新股认购	28.00	27.80	38,135	1,067,780.00	1,060,153.00	—
300090	盛运股份	2010-06-18	2010-09-27	新股认购	17.00	24.12	120,683	2,051,611.00	2,910,873.96	—
300094	国联水产	2010-06-30	2010-07-08	新股认购	14.38	14.38	500	7,190.00	7,190.00	—
600141	兴发集团	2010-04-23	2011-04-21	非公开发行股票	20.23	14.47	652,572	13,201,531.56	9,442,716.84	—

6.4.12.2 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
000001	深发展A	2010-06-30	筹划重大事项	17.51	—	—	6,105,055	138,880,752.72	106,899,513.05	—
002181	粤传媒	2010-05-26	筹划重大事项	10.47	—	—	16,149	93,040.78	169,080.03	—
600675	中华企业	2010-05-17	筹划重大事项	7.18	—	—	156	2,204.45	1,120.08	—
601318	中国平安	2010-06-29	筹划重大事项	44.55	—	—	4,441,428	221,211,070.71	197,865,617.40	—

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金无银行间市场债券正回购。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金无交易所市场债券正回购。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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、风险控制委员会、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。

6.4.13.2 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。

6.4.13.3 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,除在附注十一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。

6.4.13.4 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,包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,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。

单位：人民币元

本期末（2010年06月30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	375,296,858.58	—	—	—	—	—	375,296,858.58
结算备付金	5,069,840.67	—	—	—	—	—	5,069,840.67
存出保证金	260,000.00	—	—	—	—	1,831,883.82	2,091,883.82
交易性金融资产	—	—	205,753,082.40	—	—	3,022,019,644.46	3,227,772,726.86
应收证券清算款	—	—	—	—	—	81,144,000.00	81,144,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	1,532,737.20	1,532,737.20
应收股利	—	—	—	—	—	341,290.56	341,290.56
应收申购款	695,169.36	—	—	—	—	—	695,169.36
资产总计	381,321,868.61	—	205,753,082.40	—	—	3,106,869,556.04	3,693,944,507.05
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	68,029,629.61	68,029,629.61
应付赎回款	—	—	—	—	—	1,524,877.70	1,524,877.70
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	4,669,734.73	4,669,734.73
应付托管费	—	—	—	—	—	778,289.12	778,289.12
应付交易费用	—	—	—	—	—	2,949,981.80	2,949,981.80
应付税费	—	—	—	—	—	86,904.00	86,904.00
其他负债	—	—	—	—	—	1,253,396.47	1,253,396.47
负债总计	—	—	—	—	—	79,292,813.43	79,292,813.43
利率敏感度缺口	381,321,868.61	—	205,753,082.40	—	—	3,027,576,742.61	3,614,651,693.62
上年度末（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

月 31 日)							
资产							
银行存款	96,542,393.02	—	—	—	—	—	96,542,393.02
结算备付金	13,643,512.48	—	—	—	—	—	13,643,512.48
存出保证金	260,000.00	—	—	—	—	1,616,885.99	1,876,885.99
交易性金融资产	—	—	204,030,000.00	—	—	4,178,660,994.07	4,382,690,994.07
应收证券清算款	—	—	—	—	—	174,757,150.01	174,757,150.01
应收利息	—	—	—	—	—	2,255,364.78	2,255,364.78
应收申购款	2,169,593.90	—	—	—	—	—	2,169,593.90
资产总计	112,615,499.40	—	204,030,000.00	—	—	4,357,290,394.85	4,673,935,894.25
负债							
卖出回购金融资产款	96,000,000.00	—	—	—	—	—	96,000,000.00
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,925,662.85	7,925,662.85
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	5,723,600.03	5,723,600.03
应付托管费	—	—	—	—	—	953,933.35	953,933.35
应付交易费用	—	—	—	—	—	5,769,054.48	5,769,054.48
应付税费	—	—	—	—	—	86,904.00	86,904.00
其他负债	—	—	—	—	—	879,075.48	879,075.48
负债总计	96,000,000.00	—	—	—	—	21,338,230.19	117,338,230.19
利率敏感度缺口	16,615,499.40	—	204,030,000.00	—	—	4,335,952,164.66	4,556,597,664.06

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，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，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动；		
	2. 利率变动范围合理。		
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：元）	
		本期末（2010年06月30日）	上年度末（2009年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-32,602.29	-117,570.00
	2. 基准点利率减少0.1%	32,602.29	117,570.00

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的60%-95%；债券和短期金融工具为5%-40%；现金或者到期日在一年以内的政府债券比例在5%以上，权证为0-3%。于2010年6月30日和2009年12月31日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2010年06月30日）		上年度末（2009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	3,022,019,644.46	83.60	4,178,660,994.07	91.71
交易性金融资产—债券投资	205,753,082.40	5.69	204,030,000.00	4.48
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

合计	3,227,772,726.86	89.30	4,382,690,994.07	96.18
----	------------------	-------	------------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下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，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关；		
	2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
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：元）	
		本期末（2010年06月30日）	上年度末（2009年12月31日）
	1. 业绩比较基准减少1%	-36,559,521.87	-41,099,610.00
	2. 业绩比较基准增加1%	36,559,521.87	41,099,610.00

6.4.14 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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	3,022,019,644.46	81.81
	其中：股票	3,022,019,644.46	81.81
2	固定收益投资	205,753,082.40	5.57
	其中：债券	205,753,082.40	5.57
	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	380,366,699.25	10.30
6	其他各项资产	85,805,080.94	2.32
7	合计	3,693,944,507.05	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	492,759.26	0.01
B	采掘业	182,259,888.56	5.04
C	制造业	1,264,124,342.01	34.97
C0	食品、饮料	354,493,003.23	9.81
C1	纺织、服装、皮毛	213,784,855.55	5.91
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	30,236,938.76	0.84
C4	石油、化学、塑胶、塑料	194,073,683.73	5.37
C5	电子	2,307,083.01	0.06
C6	金属、非金属	100,978,997.14	2.79
C7	机械、设备、仪表	147,505,216.00	4.08
C8	医药、生物制品	220,744,564.59	6.11
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,404,271.46	0.07
E	建筑业	105,117,980.04	2.91
F	交通运输、仓储业	2,365,303.03	0.07
G	信息技术业	63,018,442.92	1.74
H	批发和零售贸易	451,171,245.80	12.48
I	金融、保险业	790,680,681.14	21.87
J	房地产业	144,255,704.95	3.99
K	社会服务业	329.34	0.00
L	传播与文化产业	16,128,695.95	0.45
M	综合类	—	—
	合计	3,022,019,644.46	83.60

7.3 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	601318	中国平安	4,441,428	197,865,617.40	5.47
2	600519	贵州茅台	1,269,331	161,661,996.16	4.47
3	601166	兴业银行	6,940,662	159,843,445.86	4.42
4	002422	科伦药业	1,276,513	119,736,919.40	3.31
5	002293	罗莱家纺	2,210,015	117,948,500.55	3.26
6	600693	东百集团	10,763,853	109,145,469.42	3.02
7	000001	深发展A	6,105,055	106,899,513.05	2.96
8	002024	苏宁电器	9,310,905	106,144,317.00	2.94
9	002081	金螳螂	3,228,269	101,044,819.70	2.80

10	600208	新湖中宝	20,577,250	98,153,482.50	2.72
11	002029	七匹狼	3,194,116	95,823,480.00	2.65
12	600028	中国石化	12,172,356	95,187,823.92	2.63
13	600858	银座股份	3,407,022	86,572,429.02	2.40
14	601601	中国太保	3,619,966	82,426,625.82	2.28
15	002215	诺普信	3,401,262	82,378,565.64	2.28
16	000869	张裕A	1,021,341	81,686,853.18	2.26
17	601328	交通银行	13,382,310	80,427,683.10	2.23
18	002336	人人乐	3,265,681	79,878,557.26	2.21
19	600664	哈药股份	4,128,927	76,343,860.23	2.11
20	601299	中国北车	15,399,941	74,535,714.44	2.06
21	601169	北京银行	5,073,915	61,546,588.95	1.70
22	000061	农产品	3,539,725	56,210,833.00	1.56
23	002216	三全食品	2,005,383	54,646,686.75	1.51
24	600997	开滦股份	4,088,927	53,319,608.08	1.48
25	601009	南京银行	4,949,626	49,694,245.04	1.37
26	300041	回天胶业	816,821	46,967,207.50	1.30
27	000024	招商地产	2,886,585	42,952,384.80	1.19
28	000651	格力电器	1,895,257	35,630,831.60	0.99
29	002153	石基信息	1,000,000	33,460,000.00	0.93
30	600016	民生银行	5,466,500	33,072,325.00	0.91
31	002080	中材科技	956,301	31,653,563.10	0.88
32	002028	思源电气	1,200,000	30,480,000.00	0.84
33	000718	苏宁环球	3,468,601	29,968,712.64	0.83
34	000933	神火股份	1,723,787	28,804,480.77	0.80
35	600503	华丽家族	3,000,000	26,370,000.00	0.73
36	000825	太钢不锈	5,101,793	25,917,108.44	0.72
37	600305	恒顺醋业	1,850,854	25,634,327.90	0.71
38	600713	南京医药	2,247,742	23,646,245.84	0.65
39	600141	兴发集团	1,489,677	21,555,626.19	0.60
40	600537	海通集团	1,150,000	20,688,500.00	0.57
41	600660	福耀玻璃	2,000,000	17,800,000.00	0.49
42	600810	神马股份	2,000,000	17,300,000.00	0.48
43	601999	出版传媒	1,549,146	15,801,289.20	0.44
44	600352	浙江龙盛	1,639,262	14,917,284.20	0.41
45	000861	海印股份	1,136,611	13,298,348.70	0.37
46	600015	华夏银行	1,000,980	11,130,897.60	0.31
47	600280	南京中商	468,710	9,374,200.00	0.26
48	000568	泸州老窖	300,000	8,466,000.00	0.23
49	600030	中信证券	420,066	4,914,772.20	0.14
50	600102	莱钢股份	427,311	3,546,681.30	0.10

51	600048	保利地产	287,785	2,944,040.55	0.08
52	300090	盛运股份	120,683	2,910,873.96	0.08
53	300082	奥克股份	42,297	2,857,162.35	0.08
54	002375	亚厦股份	59,743	2,317,430.97	0.06
55	600348	国阳新能	171,098	2,227,695.96	0.06
56	002391	长青股份	46,228	2,098,288.92	0.06
57	300073	当升科技	33,955	1,994,856.25	0.06
58	002384	东山精密	33,624	1,939,096.08	0.05
59	002405	四维图新	53,907	1,788,634.26	0.05
60	000759	武汉中百	161,130	1,736,981.40	0.05
61	000022	深赤湾A	145,917	1,683,882.18	0.05
62	600000	浦发银行	123,669	1,681,898.40	0.05
63	002431	棕榈园林	30,233	1,659,489.37	0.05
64	600396	金山股份	177,500	1,432,425.00	0.04
65	002304	洋河股份	9,279	1,363,085.10	0.04
66	002432	九安医疗	59,058	1,361,877.48	0.04
67	300077	国民技术	10,223	1,193,535.25	0.03
68	002372	伟星新材	71,783	1,172,216.39	0.03
69	002142	宁波银行	104,400	1,150,488.00	0.03
70	600683	京投银泰	190,704	1,087,012.80	0.03
71	002411	九九久	32,255	1,064,415.00	0.03
72	300085	银之杰	38,135	1,060,153.00	0.03
73	000968	煤气化	77,500	1,054,000.00	0.03
74	000410	沈阳机床	99,933	1,019,316.60	0.03
75	300072	三聚环保	24,688	1,007,764.16	0.03
76	000612	焦作万方	55,509	938,657.19	0.03
77	601088	中国神华	40,500	889,785.00	0.02
78	002378	章源钨业	32,458	854,943.72	0.02
79	002123	荣信股份	22,721	727,072.00	0.02
80	600703	三安光电	17,142	701,279.22	0.02
81	600011	华能国际	109,034	690,185.22	0.02
82	601001	大同煤业	23,150	647,737.00	0.02
83	000538	云南白药	9,389	605,590.50	0.02
84	600019	宝钢股份	100,000	589,000.00	0.02
85	600231	凌钢股份	100,000	582,000.00	0.02
86	002407	多氟多	13,740	572,271.00	0.02
87	000972	新中基	50,227	471,129.26	0.01
88	600005	武钢股份	99,695	427,691.55	0.01
89	600115	东方航空	60,000	415,800.00	0.01
90	002402	和而泰	11,965	392,452.00	0.01
91	600549	厦门钨业	19,152	348,566.40	0.01

92	600875	东方电气	7,872	342,825.60	0.01
93	600309	烟台万华	21,405	312,298.95	0.01
94	600725	云维股份	42,302	311,342.72	0.01
95	000792	盐湖钾肥	7,428	289,692.00	0.01
96	600432	吉恩镍业	15,730	289,432.00	0.01
97	002008	大族激光	25,450	282,240.50	0.01
98	600729	重庆百货	6,800	279,072.00	0.01
99	600963	岳阳纸业	38,761	268,226.12	0.01
100	000959	首钢股份	81,594	254,573.28	0.01
101	600600	青岛啤酒	7,387	243,918.74	0.01
102	600785	新华百货	7,331	240,603.42	0.01
103	600521	华海药业	16,608	223,211.52	0.01
104	002025	航天电器	20,000	192,600.00	0.01
105	600550	天威保变	9,978	188,185.08	0.01
106	600859	王府井	5,314	180,676.00	0.00
107	002181	粤传媒	16,149	169,080.03	0.00
108	600563	法拉电子	6,200	146,940.00	0.00
109	600037	歌华有线	10,000	138,400.00	0.00
110	000999	华润三九	5,307	121,795.65	0.00
111	600315	上海家化	3,959	120,709.91	0.00
112	600596	新安股份	12,135	119,893.80	0.00
113	000060	中金岭南	9,046	117,055.24	0.00
114	600410	华胜天成	9,700	113,587.00	0.00
115	000690	宝新能源	22,500	113,400.00	0.00
116	600428	中远航运	15,100	108,418.00	0.00
117	000970	中科三环	9,337	107,748.98	0.00
118	600058	五矿发展	7,560	106,369.20	0.00
119	000960	锡业股份	6,512	97,745.12	0.00
120	601618	中国中冶	24,000	96,240.00	0.00
121	600511	国药股份	3,960	86,209.20	0.00
122	600098	广州控股	15,235	84,858.95	0.00
123	002001	新和成	3,250	83,362.50	0.00
124	000401	冀东水泥	5,591	83,361.81	0.00
125	000667	名流置业	26,020	81,963.00	0.00
126	600887	伊利股份	2,717	79,825.46	0.00
127	600588	用友软件	3,650	79,716.00	0.00
128	600219	南山铝业	9,975	77,406.00	0.00
129	000698	沈阳化工	10,329	74,265.51	0.00
130	600642	申能股份	9,570	73,689.00	0.00
131	000619	海螺型材	7,694	72,169.72	0.00
132	000402	金融街	8,146	67,774.72	0.00

133	601898	中煤能源	7,881	66,121.59	0.00
134	600694	大商股份	1,368	57,880.08	0.00
135	601006	大秦铁路	6,487	52,998.79	0.00
136	600761	安徽合力	3,697	41,997.92	0.00
137	002416	爱施德	1,000	39,430.00	0.00
138	600269	赣粤高速	6,434	36,609.46	0.00
139	600123	兰花科创	1,400	35,798.00	0.00
140	000157	中联重科	2,200	35,750.00	0.00
141	300078	中瑞思创	500	34,940.00	0.00
142	600320	振华重工	5,390	32,932.90	0.00
143	000002	万科A	4,817	32,659.26	0.00
144	600718	东软集团	1,800	32,508.00	0.00
145	000807	云铝股份	4,138	32,400.54	0.00
146	300083	劲胜股份	1,000	28,450.00	0.00
147	600050	中国联通	5,211	27,774.63	0.00
148	601699	潞安环能	858	26,838.24	0.00
149	002410	广联达	500	26,075.00	0.00
150	601866	中海集运	7,700	25,949.00	0.00
151	002434	万里扬	1,000	25,660.00	0.00
152	002045	广州国光	1,500	25,140.00	0.00
153	600697	欧亚集团	1,000	24,780.00	0.00
154	000541	佛山照明	2,036	24,187.68	0.00
155	601398	工商银行	5,712	23,190.72	0.00
156	002429	兆驰股份	1,000	22,960.00	0.00
157	000951	中国重汽	1,300	22,230.00	0.00
158	600125	铁龙物流	1,560	21,075.60	0.00
159	002424	贵州百灵	500	20,355.00	0.00
160	002441	众业达	500	19,950.00	0.00
161	600880	博瑞传播	1,184	19,926.72	0.00
162	000423	东阿阿胶	539	18,735.64	0.00
163	000898	鞍钢股份	2,439	17,512.02	0.00
164	601369	陕鼓动力	1,000	17,300.00	0.00
165	600663	陆家嘴	1,000	16,800.00	0.00
166	000900	现代投资	1,000	16,760.00	0.00
167	002436	兴森科技	500	15,300.00	0.00
168	600298	安琪酵母	436	15,242.56	0.00
169	002427	尤夫股份	1,000	15,180.00	0.00
170	600290	华仪电气	1,400	15,008.00	0.00
171	600438	通威股份	2,000	14,440.00	0.00
172	000581	威孚高科	1,042	14,171.20	0.00
173	002433	皮宝制药	500	13,590.00	0.00

174	600631	百联股份	1,000	13,150.00	0.00
175	600177	雅戈尔	1,250	12,875.00	0.00
176	600616	金枫酒业	1,200	12,756.00	0.00
177	000625	长安汽车	1,440	12,513.60	0.00
178	002430	杭氧股份	500	12,425.00	0.00
179	002408	齐翔腾达	500	12,340.00	0.00
180	002420	毅昌股份	1,000	11,500.00	0.00
181	600299	*ST 新材	1,300	10,036.00	0.00
182	000027	深圳能源	1,000	9,520.00	0.00
183	002418	康盛股份	500	8,435.00	0.00
184	002413	常发股份	500	8,175.00	0.00
185	002403	爱仕达	500	8,080.00	0.00
186	600143	金发科技	1,010	7,585.10	0.00
187	002435	长江润发	500	7,320.00	0.00
188	300094	国联水产	500	7,190.00	0.00
189	600118	中国卫星	440	6,886.00	0.00
190	600601	方正科技	1,391	6,635.07	0.00
191	600423	柳化股份	795	6,526.95	0.00
192	000768	西飞国际	660	6,468.00	0.00
193	600750	江中药业	203	6,262.55	0.00
194	002442	龙星化工	500	6,250.00	0.00
195	000400	许继电气	200	5,256.00	0.00
196	600132	重庆啤酒	130	4,680.00	0.00
197	600276	恒瑞医药	118	4,610.26	0.00
198	001696	宗申动力	442	4,455.36	0.00
199	600018	上港集团	1,000	3,810.00	0.00
200	601988	中国银行	1,000	3,390.00	0.00
201	600479	千金药业	242	3,388.00	0.00
202	600100	同方股份	156	3,282.24	0.00
203	600150	中国船舶	58	3,213.78	0.00
204	000839	中信国安	286	3,151.72	0.00
205	000425	徐工机械	100	3,063.00	0.00
206	600316	洪都航空	76	2,514.08	0.00
207	000528	柳 工	120	2,211.60	0.00
208	600456	宝钛股份	100	1,919.00	0.00
209	600809	山西汾酒	46	1,887.38	0.00
210	600685	广船国际	100	1,744.00	0.00
211	000046	泛海建设	200	1,602.00	0.00
212	600064	南京高科	150	1,578.00	0.00
213	000608	阳光股份	182	1,204.84	0.00
214	600835	上海机电	120	1,120.80	0.00

215	600675	中华企业	156	1,120.08	0.00
216	600748	上实发展	148	1,095.20	0.00
217	600330	天通股份	121	975.26	0.00
218	600022	济南钢铁	216	777.60	0.00
219	600797	浙大网新	100	610.00	0.00
220	601766	中国南车	76	366.32	0.00
221	600007	中国国贸	33	329.34	0.00
222	600808	马钢股份	100	317.00	0.00
223	600027	华电国际	51	193.29	0.00
224	000709	河北钢铁	42	155.82	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600028	中国石化	222,073,555.60	4.87
2	600519	贵州茅台	138,232,064.00	3.03
3	002422	科伦药业	117,508,431.36	2.58
4	600208	新湖中宝	114,835,709.39	2.52
5	002336	人人乐	112,343,081.45	2.47
6	002293	罗莱家纺	102,273,817.60	2.24
7	601328	交通银行	100,578,234.85	2.21
8	601166	兴业银行	99,352,569.91	2.18
9	002215	诺普信	97,339,690.61	2.14
10	600068	葛洲坝	95,629,281.68	2.10
11	600795	国电电力	86,899,590.02	1.91
12	601299	中国北车	85,948,850.63	1.89
13	600141	兴发集团	84,779,882.93	1.86
14	601318	中国平安	81,828,021.77	1.80
15	000422	湖北宜化	81,468,917.38	1.79
16	000001	深发展A	77,840,085.75	1.71
17	002029	七匹狼	75,633,254.06	1.66
18	600664	哈药股份	75,485,454.16	1.66
19	002202	金风科技	73,693,354.89	1.62
20	600628	新世界	73,571,304.98	1.61

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600016	民生银行	163,687,597.09	3.59
2	000422	湖北宜化	154,923,618.29	3.40
3	600221	海南航空	113,481,631.01	2.49
4	600028	中国石化	108,857,441.77	2.39
5	601111	中国国航	101,763,447.63	2.23
6	600795	国电电力	100,215,546.59	2.20
7	601318	中国平安	99,692,705.37	2.19
8	600068	葛洲坝	98,656,799.44	2.17
9	600739	辽宁成大	96,474,894.71	2.12
10	000002	万科A	92,542,419.68	2.03
11	601166	兴业银行	88,160,291.90	1.93
12	000726	鲁泰A	86,264,319.34	1.89
13	002202	金风科技	79,630,315.12	1.75
14	601601	中国太保	77,620,038.52	1.70
15	600409	三友化工	76,261,286.93	1.67
16	000338	潍柴动力	75,769,315.88	1.66
17	600628	新世界	73,334,551.23	1.61
18	600519	贵州茅台	69,529,245.19	1.53
19	600031	三一重工	68,774,390.19	1.51
20	601872	招商轮船	66,808,595.04	1.47

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。

7.4.3 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	3,845,202,513.99
卖出股票收入（成交）总额	4,291,827,205.58

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	99,030,000.00	2.74
2	央行票据	98,110,000.00	2.71
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	8,613,082.40	0.24

7	其他	—	—
8	合计	205,753,082.40	5.69

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	020030	10 贴债 04	1,000,000	99,030,000.00	2.74
2	0901048	09 央票 48	1,000,000	98,110,000.00	2.71
3	113001	中行转债	85,160	8,613,082.40	0.24

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

7.9.2 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。

7.9.3 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	2,091,883.82
2	应收证券清算款	81,144,000.00
3	应收股利	341,290.56
4	应收利息	1,532,737.20
5	应收申购款	695,169.36
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	85,805,080.94

7.9.4 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。

7.9.5 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	601318	中国平安	197,865,617.40	5.47	重大事项
2	000001	深发展 A	106,899,513.05	2.96	重大事项
3	002024	苏宁电器	51,300,000.00	1.42	非公开发行股票
4	002422	科伦药业	2,553,517.40	0.07	新股认购

7.9.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
143581	31,315.22	594,639,111.04	13.23	3,901,630,894.01	86.77

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	1,687,110.06	0.0375

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2006年11月15日)基金份额总额	4,481,572,083.59
报告期期初基金份额总额	4,704,755,938.57
本报告期基金总申购份额	363,416,035.00
减：本报告期基金总赎回份额	571,901,968.52

本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	4,496,270,005.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内本基金管理人无重大人事变动。

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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 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。

10.6 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。

10.7 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 (%)	
长城证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
广发证券	2	1,954,222,043.01	24.69	—	—	290,000,000.00	17.35	—	—	1,638,073.59	24.75	—
国金证券	2	246,555,407.65	3.11	—	—	—	—	—	—	207,999.36	3.14	—
国泰君安	1	506,934,310.39	6.40	—	—	134,000,000.00	8.02	—	—	430,891.21	6.51	—
华泰证券	1	471,069,493.20	5.95	—	—	767,000,000.00	45.90	—	—	400,404.86	6.05	—
申银万国	1	563,242,730.53	7.12	—	—	—	—	—	—	457,635.83	6.91	—
中金公司	1	1,028,419,589.49	12.99	—	—	180,000,000.00	10.77	—	—	874,149.93	13.21	—
中投证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
中信建投	1	44,637,009.55	0.56	—	—	—	—	—	—	37,941.72	0.57	—
中信万通	1	—	—	99,243,000.00	100.00	—	—	—	—	—	—	—
中信证券	2	1,957,442,834.90	24.73	—	—	—	—	—	—	1,600,579.57	24.18	—
中银国际	1	1,143,275,928.52	14.44	—	—	300,000,000.00	17.95	—	—	971,777.17	14.68	—

注：我公司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。本基金本期新增国金证券上海 24787 交易单元、深圳 390257 交易单元，新增广发证券上海 42123 交易单元。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金转换业务规则的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2010年03月10日
2	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金持有的相关停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2010年04月23日
3	富国基金管理有限公司关于调整旗下基金持有的相关停牌股票估值方法的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2010年06月30日

§ 11 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国天合稳健优选股票型证券投资基金的文件 2、富国天合稳健优选股票型证券投资基金基金合同 3、富国天合稳健优选股票型证券投资基金托管协议 4、中国证监会批准设立富国基金管理有限公司的文件 5、富国天合稳健优选股票型证券投资基金财务报表及报表附注 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公司网址： http://www.fullgoal.com.cn