信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

【2010】年度报告摘要

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年3月29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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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2010年1月1日起至12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚盛世蓝筹股票
基金主代码	550003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月4日
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,764,451,553.19份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于较大市值且业绩优良的蓝筹上市公司，追求基金财产的长期稳定增值。
投资策略	本基金投资组合中股票、债券、现金各自的长期均衡比重，依照本基金的特征和风险偏好而确定。本基金定位为股票型基金，其战略性资产配置以股票为主，并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下，本基金允许在一定的范围内作战术性资产配置调整，以规避市场风险。
业绩比较基准	80%×中信标普50指数收益率+20%×中信全债指数收益率
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金，属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。

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		信诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	尹东
	联系电话	021-68649788	010-67595003
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

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.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年	2008年06月04日（基金合同生效日）至2008年12月31日
本期已实现收益	36,082,742.41	247,056,897.80	-6,808,806.27
本期利润	176,190,813.05	286,896,732.82	5,894,663.94
加权平均基金份额本期利润	0.2631	0.7508	0.0130
本期基金份额净值增长率	20.79%	71.03%	1.50%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.6959	0.6185	-0.0159
期末基金资产净值	3,700,137,077.33	599,402,103.34	539,397,584.46
期末基金份额净值	2.097	1.736	1.015
3.1.3 累计期末指标	2010年末	2009年末	2008年末
基金份额累计净值增长率	109.70%	73.60%	1.50%

注：1、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

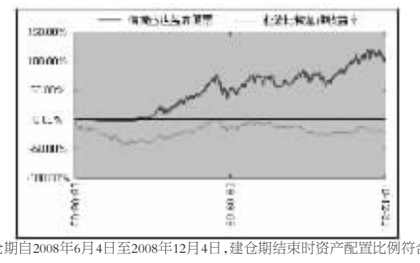
3.2 基金净值表现

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	1.65%	1.72%	1.20%	1.36%	0.45%	0.36%
过去六个月	28.18%	1.51%	7.07%	1.17%	21.11%	0.34%
过去一年	20.79%	1.52%	-18.91%	1.23%	39.70%	0.29%
自基金合同生效起至今	109.70%	1.45%	-22.18%	1.72%	131.88%	-0.27%

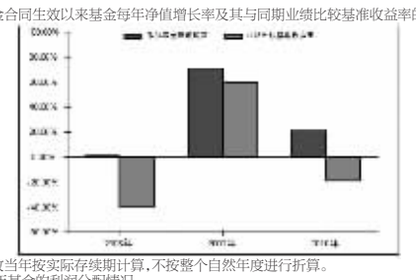
注：本基金的业绩比较基准为80%×中信标普50指数收益率+20%×中信全债指数收益率。

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：本基金建仓期自2008年6月4日至2008年12月4日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

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：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同生效日为2008年6月4日，本基金自基金合同生效以来未进行过利润分配。

§ 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

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准，于2005年9月30日正式成立，注册资本2亿元，注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司，各股东出资比例分别为49%、49%、2%。截至2010年底，本基金管理人共管理10只基金，分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金（LOF）、信诚增强收益债券型证券投资基金和信诚金砖四国积极配置证券投资基金（LOF）。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张锋	本基金基金经理，信诚深度价值股票型证券投资基金基金经理，信诚基金管理有限公司股票投资副总监	2008年6月6日	-	11	复旦大学经济学硕士。历任上海证券有限公司行业研究员、兴业证券股份有限公司行业研究员、上海融昌资产管理有限公司行业研究员。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《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

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

针对中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列行动来落实指导意见中的各项要求。明确了各部门在公平交易执行中的具体责任，在日常交易中，严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定对本基金的日常交易行为进行监控。对于交易所公开竞价交易，在恒生交易系统中执行公平交易程序，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先，比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。对于场外交易，通过业务流程的人为控制执行公平交易程序。

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

本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010年，宏观经济波动和政策调控经历了数度反复，对股市影响较为复杂。年初在宏观紧缩和房地产调控的压力下，经济增长速度见顶回落，出现了环比下滑趋势，至2季度末，多数经济指标显示回落的速度加快。在此情况下，政府的紧缩政策实质放松，宏观经济重新恢复“小复苏”，但由于经济体系中的流动性过于充裕，加上美国QE2带来的国外输入性通胀压力，导致通胀上升的速度明显高于经济回升速度。到了第四季度，CPI已经从年初的2%左右上升到5%左右，超出了调控警戒线，通胀压力显著加大。政策也重新回到紧缩，连续两次加息和三次上调准备金率，并动用行政手段控制信贷和物价。

总体说来，2010年的宏观经济运行在政策相机抉择的影响下显得较为平稳，但通胀和资产价格上升的压力加大则贯穿全年。本轮价格上涨压力有别于以往，是全面的价格上涨。形成的原因既有过去两年来释放的大量流动性，也与国外输入型通胀有关，还包括国内的经济结构调整速度滞后于人口结构变化，潜在自然增长率面临下降的因素。

市场全年表现为成长股的结构性行情，本基金重点配置了消费、TMT等受益于经济结构调整的行业，取得了良好的效果。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

2010年上证指数下跌14.3%，沪深300指数下跌12.5%，中证500指数上涨10%，本基金全年净值增长20.79%，超越业绩基准39.7个百分点。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年，通胀和政策将成为市场主要的博弈点，由于周期性行业已经预先调整了较长时间，而成长股的估值水平相对偏高，因此预计市场仍会维持震荡格局，出现大牛市或大熊市的概率不大。从长期来看，十一五期间的高速经济增长遇到了物价、人口、资产价格等多个瓶颈，未来的增速回落是大概率事件。本基金仍然将主要把精力放在挖掘符合转型趋势，长期增长空间大的行业和个股上。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过建立估值决策委员会来更有效地完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员：首席运营官（会议主席）、副首席运营官、风险控制总监专员、数量研究员、交易总监、运营总监、基金会计主管。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见，确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时，应评价现有估值政策和程序的适用性，并在不适用的情况下，及时召开估值决策委员会。

在每个估值日，本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法，确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人对基金资产进行估值后，将基金份额净值结果发送基金托管人，基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核，复核无误后，由基金管理人对外公布。

2.基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗，所有业务操作需经复核方可生效。

基金份额净值公告需经处理估值的操作人员、复核估值的复核人员和基金运营总监三人确认后，方可对外发布。

3.基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历，具有会计上岗证和基金从业人员资格。

本基金管理人的估值人员平均拥有6年金融从业经验和3年基金管理公司的基金从业和基金估值经验。

4.基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离，基金经理不直接参与或决定估值。

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注，在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时，将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议，通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5.参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6.已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则：

1.本基金的每份基金份额享有同等分配权；

2.收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金登记结算机构可将投资人的现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额。

3.本基金收益每年最多分配12次，每次基金收益分配比例不低于可分配收益的25%；

4.若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

5.本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

6.基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

7.基金当期收益应先弥补上期亏损后，方可进行当期收益分配；

8.法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金于本期间未进行过利润分配，该处理符合基金利润分配原则。

§ 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的真实、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

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告，投资者可通过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：信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：		
银行存款	368,069,180.17	61,303,462.58
结算备付金	20,548,627.18	1,776,118.15
存出保证金	1,328,561.45	1,300,683.59
交易性金融资产	3,385,771,683.18	526,963,001.12
其中：股票投资	3,385,771,683.18	526,963,001.12
基金投资	-	-
债券投资	-	-
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	-	17,089,666.81
应收利息	110,564.91	18,322.55
应收股利	-	-
应收申购款	1,748,723.04	138,033.37
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,777,577,339.93	608,589,288.17
负债和所有者权益	本期末 2010年12月31日	上年度末 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	-	-
应付证券清算款	58,518,858.06	5,130,647.57
应付赎回款	6,905,892.06	1,457,765.30
应付管理人报酬	4,724,589.08	684,870.08
应付托管费	787,431.54	114,144.99
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	5,637,513.85	960,914.68
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	865,978.01	838,842.21
负债合计	77,440,262.60	9,187,184.83
所有者权益：		
实收基金	1,764,451,553.19	345,198,783.33
未分配利润	1,935,685,524.14	254,203,320.01
所有者权益合计	3,700,137,077.33	599,402,103.34
负债和所有者权益总计	3,777,577,339.93	608,589,288.17

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值2.097元，基金份额总额1,764,451,553.19份。

7.2 利润表

会计主体：信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入	215,693,946.59	306,352,756.39
1.利息收入	1,526,265.48	894,421.83
其中：存款利息收入	1,526,265.48	653,924.74
债券利息收入	-	240,497.09
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）	71,903,522.64	264,713,991.00
其中：股票投资收益	68,909,134.99	258,142,521.60
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	3,175,886.47
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	2,994,387.65	3,395,582.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	140,108,070.64	39,839,835.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,156,087.83	904,508.54
减：二、费用	39,503,133.54	19,456,023.57
1.管理人报酬	18,980,905.85	8,059,475.76
2.托管费	3,163,484.42	1,343,245.87
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	16,866,696.66	9,581,454.61
5.利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	492,046.61	471,847.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	176,190,813.05	286,896,732.82

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010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）	345,198,783.33	254,203,320.01	599,402,103.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	176,190,813.05	176,190,813.05
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）	1,419,252,769.86	1,505,291,391.08	2,924,544,160.94
其中：1.基金申购款	2,401,652,476.62	2,424,308,631.64	4,825,961,108.26
2.基金赎回款	-982,399,706.76	-919,017,240.56	-1,901,416,947.32
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）	1,764,451,553.19	1,935,685,524.14	3,700,137,077.33

项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	531,236,226.66	8,161,357.80	539,397,584.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	286,896,732.82	286,896,732.82
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）	-186,037,443.33	-40,854,770.61	-226,892,213.94
其中：1.基金申购款	374,803,119.29	166,177,851.55	540,980,970.84
2.基金赎回款	-560,840,562.62	-207,032,622.16	-767,873,184.78
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）	345,198,783.33	254,203,320.01	599,402,103.34

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：

王俊锋　　桂思毅　　詹朋

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

信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于核准信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可〔2008〕315号文）和《关于信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金备案确认的函》（基金部函〔2008〕226号文）批准，由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于2008年6月4日生效。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信诚基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金于2008年4月10日至2008年5月30日募集，募集资金总额459,436,930.46元，募集期间认购手续费3,811,349.79元，利息转份额186,147.35元，募集规模为455,811,728.02份。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所验证，并出具了KPMG-B（2008）CR No.0044号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》和《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合的比例范围为：股票资产60%-95%；债券、资产证券化产品与固定收益类资产0%-35%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证资产不超过基金资产净值的3%。本基金投资重点为蓝筹类上市公司股票，80%以上的股票基金资产属于上述投资方向所确定的内容。本基金的业绩比较基准为：80%×中信标普50指数收益率+20%×中信全债指数收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》，本基金定期报告在公开披露的第二个工作日，报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则（2006）、中国证券业协会于2007年颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注7.4.4所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）的要求，真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外本财务报表同时符合如财务报表附注7.4.2所列示的其他有关规定的要求。

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

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明会计政策变更事项。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明会计估计变更事项。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本年度末发生重大会计差错。

7.4.5 税项

根据财税字〔1998〕55号文、〔2001〕61号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、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》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字〔2005〕11号文《关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税〔2005〕102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税〔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》、财税〔2005〕107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税〔2007〕84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券（股票）交易印花税税率的通知》、财税〔2008〕1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

（1）以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。

（2）基金买卖股票、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

（3）基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

（4）对基金取得的股票的股息、红利收入，债券的利息收入，由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，自2005年6月13日起，对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按50%计算个人所得税。

（5）自2005年1月24日起，基金买卖A股、B股股权所书立的股权转让书据按照0.1%的税率征收证券（股票）交易印花税。自2007年5月30日起，该税率上调至0.3%。自2008年4月24日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，调整证券（股票）交易印花税税率，由0.3%降至0.1%。自2008年9月19日起，根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定，证券交易印花税改为单边征收，即仅对卖出A股、B股股权按0.1%的税率征收，对受让方不再征税。

（6）对投资者（包括个人和机构投资者）从基金分配中取得的收入，暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的外方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本年度及上年度均未通过关联方交易单元进行交易。

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,980,905.85	8,059,475.76
其中：支付销售机构的客户维护费	985,023.11	389,800.01

注：支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,163,484.42	1,343,245.87

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

本基金在本年度及上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

本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行，本基金的基金管理人在本报告期未投资过本基金。

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

单位：份

关联方名称	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
信诚人寿保险有限公司	52,319,947.71	2.97%	39,999,100.00	11.59%

注：除上表所示外，本基金除基金管理人之外的其它关联方在本期末未持有本基金，除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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
建设银行	368,069,180.17	1,418,268.19	61,303,462.58	614,415.98

注：本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于2010年12月31日的相关余额为人民币20,548,627.18元。（2009年12月31日：人民币1,776,118.15元）。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8 期末（2010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

于2010年12月31日，本基金未持有因认购新发/增发证券的流通受限证券。

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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600518	康美药业	2010-12-28	配股缴款及网上清算	19.71	2011-01-06	17.29	9,106,767	171,547,565.94	179,494,377.57	-
600991	广汽长丰	2010-10-28	重组合并等重大事项	14.07	2011-03-23	15.00	4,798,393	52,513,993.31	67,513,389.51	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于2010年12月31日，本基金未持有正回购交易中作为抵押的债券。

§ 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	3,385,771,683.18	89.63
	其中：股票	3,385,771,683.18	89.63
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	388,617,807.35	10.29
6	其他各项资产	3,187,849.40	0.08
7	合计	3,777,577,339.93	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	134,338,716.64	3.63
C	制造业	2,559,581,640.56	69.18
C0	食品、饮料	443,441,595.30	11.98
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	494,512,339.64	13.36
C6	金属、非金属	665,759,269.71	17.99
C7	机械、设备、仪表	67,513,389.51	1.82
C8	医药、生物制品	888,355,046.40	24.01
C99	其他制造业	-	-
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	36,642,243.82	0.99
G	信息技术业	239,151,114.53	6.46
H	批发和零售贸易	30,991,046.40	0.84
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	300,785,307.93	8.13
K	社会服务业	84,281,613.30	2.28
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	3,385,771,683.18	91.50

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	002106	莱宝高科	4,172,693	276,440,911.25	7.47
2	600585	海螺水泥	7,986,447	237,037,746.96	6.41
3	000538	云南白药	3,851,918	232,655,847.20	6.29
4	600256	广汇股份	4,580,649	192,066,612.57	5.19
5	600276	恒瑞医药	3,108,247	185,127,191.32	5.00
6	600518	康美药业	9,106,767	179,494,377.57	4.85
7	600887	伊利股份	4,102,817	156,973,778.42	4.24
8	600809	山西汾酒	2,201,496	150,868,520.88	4.08
9	000423	东阿阿胶	2,852,922	145,784,314.20	3.94
10	002304	洋河股份	605,354	135,599,296.00	3.66

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www.citicprufunds.com.cn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	000538	云南白药	317,794,173.89	53.02
2	002106	莱宝高科	221,418,380.08	36.94
3	600585	海螺水泥	217,291,503.54	36.25
4