富国天利增长债券投资基金

【2010】年度报告摘要

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：	２０１１年０３月３１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。

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2010年1月1日起至2010年12月31日止。

§２ 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天利增长债券
基金主代码	100018
交易代码	前端交易代码：100018 后端交易代码：100019
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2003年12月02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	2,453,506,743.69份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，投资目标是在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益。
投资策略	久期控制下的主动性投资策略。
业绩比较基准	中国债券总指数
风险收益特征	本基金为主要投资于高信用等级固定收益证券的投资基金，属于低风险的基金品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		富国基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李长伟	赵会军
	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

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	281,279,012.99	278,387,087.29	163,217,918.77
本期利润	276,581,733.82	235,507,928.98	94,081,658.88
加权平均基金份额本期利润	0.0974	0.1062	0.0294
本期基金份额净值增长率	7.99%	8.94%	3.65%
3.1.2期末数据和指标	2010年12月31日	2009年12月31日	2008年12月31日
期末可供分配基金份额利润	0.0312	0.0571	0.0333
期末基金资产净值	3,048,899,292.71	2,967,158,881.47	2,753,870,684.75
期末基金份额净值	1.2427	1.2714	1.2632

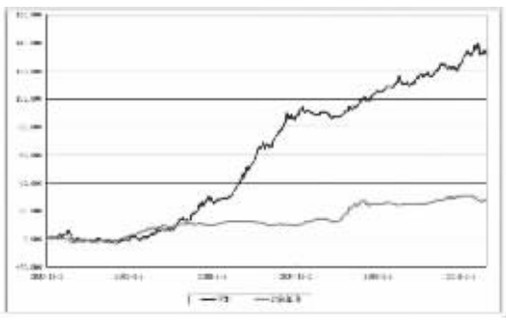
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

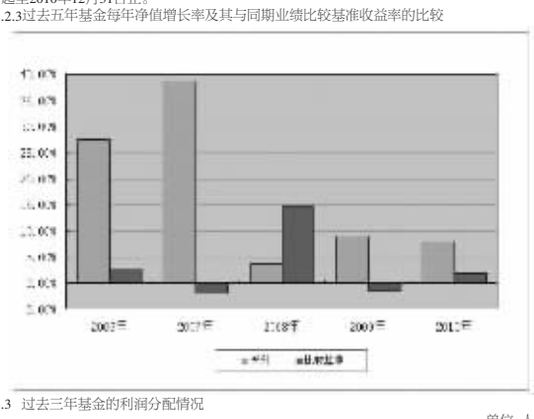
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.11%	0.46%	-2.25%	0.16%	3.36%	0.30%
过去六个月	6.32%	0.36%	-1.45%	0.12%	7.77%	0.24%
过去一年	7.99%	0.30%	1.92%	0.10%	6.07%	0.20%
过去三年	21.94%	0.24%	15.64%	0.15%	6.30%	0.09%
过去五年	115.74%	0.32%	16.83%	0.13%	98.91%	0.19%
自基金合同生效起至今	134.72%	0.31%	27.87%	0.19%	106.85%	0.12%

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2010年12月31日。本基金于2003年12月2日成立，建仓期6个月，从2003年12月2日至2004年6月1日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本图所示时间区间为2003年12月2日起至2010年12月31日止。

3.2.3过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



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
2010年	1.250	169,600,273.52	160,126,154.29	329,726,427.81	5次分红
2009年	1.000	105,143,831.00	102,248,137.30	207,391,968.30	4次分红
2008年	0.350	64,981,057.26	61,743,096.26	126,724,153.52	2次分红
合计	2.600	339,725,161.78	324,117,387.85	663,842,549.63	-

§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、富国汇利分级债券型证券投资基金四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、富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金和富国可转换债券证券投资基金十五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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
饶刚	本基金基金经理兼任固定收益部总经理、富国天丰强化收益债券型证券投资基金基金经理、富国汇利分级债券型证券投资基金基金经理	2006-01-12	-	12年	硕士，曾任职兴业证券股份有限公司研究部职员、投资银行部职员；2003年7月任富国基金管理有限公司债券研究员，2006年1月至今任富国天利基金经理，2008年10月起兼任富国天丰基金经理，2010年9月起兼任富国汇利分级债券基金经理。兼任公司固定收益部总经理。具有基金从业资格，中国国籍。
杨贵宾	本基金基金经理兼任富国可转换债券证券投资基金基金经理	2009-09-01	-	6年	博士，2005年9月任富国基金管理有限公司债券研究员、策略分析师；2009年3月至2010年6月任富国天时基金经理；2009年9月起任富国天利基金经理；2010年12月起任富国可转债基金经理。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利增长债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》、《富国天利增长债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

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

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

2010年经济形势异常复杂，外冷内热。欧债危机和美国无就业复苏，导致新一轮量化宽松政策，引发全球纸币贬值风险。国内房地产价格和物价都在持续上涨，两难抉择后政府被迫收紧银根，两次加息并数次提高准备金率。由于主流媒体将国内通胀压力归咎于央行近几年来的货币超发，央行在加息的同时更加收紧了流动性，在6月末、11月底和12月底，市场资金面持续趋紧，紧张程度为近6年来罕见。这种经济和金融市场格局对股市和债市均出现压制。

随着基金规模的扩大和对持有人利益取向的分析，天利基金近两年来将目标更多的向绝对收益目标倾斜，因此在操作策略上更多的考虑持有期收益而减少了选时操作。2010年天利基金一直维持了较高的信用债比例，获取了相对稳定的票息收益。可转债方面，天利基金在6月份增加了对低价可转债的配置比例，为基金净值贡献不少。但4季度加息和股市下跌，导致基金净值受到一定损失。全年来看，天利基金坚持了自己的投资风格，并给持有人创造了相对稳定的收益。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日，本基金份额净值为1.2427元，份额累计净值为1.9927元。报告期内，本基金份额净值增长率为7.99%，同期业绩比较基准收益率为1.92%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2011年经济增速逐季向上，通胀率整体较高但会逐季回落，为股市和债市都营造了较好的氛围，但最大的困扰来自于流动性。预期全年流动性都将较为紧张，因此市场整体难以出现较大的投资机会，更多的是阶段性机会。我们认为，转债目前已经处于底部区域，安全性较高，信用债从持有期收益仍然不差，二者都具有较好的投资价值。利率产品基本可以忽略，难以给基金提供明显收益。

在未来的操作中，我们依然将可转债和信用债作为天利基金的主要盈利来源。对转债我们的策略是稳定的金字塔策略，即越跌越买，在较低价格获得较多仓位；对信用债我们仍将维持较高的比例——信用债的高票息符合天利基金绝对收益目标优先的需求。此外，我们对于申购新股将保持适度谨慎的态度，有选择的申购。

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

本基金于2010年1月5日公告对2009年报告期内利润进行收益分配，每10份基金份额0.40元，共计派发红利95,840,196.54元。

本基金对2010年报告期内利润共进行五次收益分配。分别于2010年4月6日公告派发红利每10份基金份额0.20元；2010年7月5日公告派发红利每10份基金份额0.20元；2010年10月12日公告派发红利每10份基金份额0.20元；2010年12月21日公告派发红利每10份基金份额0.25元；2011年1月7日公告派发红利每10份基金份额0.10元。本基金2010年年度已实现收益为281,279,012.99元，本基金共计派发2010年度红利259,224,854.34元，占年度已实现收益的92.16%。

根据本基金《基金合同》约定：“基金收益分配比例不低于基金净收益的90%；”（基金净收益即为财务指标中的本期已实现收益）。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

2010年，本基金托管人在对富国天利增长债券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年，富国天利增长债券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国天利增长债券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，富国天利增长债券投资基金对基金份额持有人进行了五次利润分配，分配金额为329,726,427.81元。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对富国基金管理有限公司编制和披露的富国天利增长债券投资基金2010年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。

二○一一年三月二十九日

§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：富国天利增长债券投资基金

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	13,325,591.49	313,833,470.95
结算备付金	25,828,507.45	27,495,291.45
存出保证金	598,976.76	598,780.49
交易性金融资产	3,725,240,589.38	3,131,456,402.36
其中：股票投资	350,110,511.64	201,348,683.93
基金投资	-	-
债券投资	3,375,130,077.74	2,916,743,718.43
资产支持证券投资	-	13,364,000.00
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	69,702,016.24	500,186,330.56
应收利息	59,986,657.27	51,276,691.68
应收股利	-	-
应收申购款	15,047,036.29	4,243,662.55
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,909,729,374.88	4,029,090,630.04
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	850,000,000.00	1,053,999,993.00
应付证券清算款	106,701.93	-
应付赎回款	4,610,417.09	3,394,519.73
应付管理人报酬	2,101,861.20	1,936,974.56
应付托管费	525,465.29	484,243.61
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	542,272.53	302,616.07
应交税费	1,891,325.29	1,204,515.62
应付利息	399,939.73	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	652,099.11	608,885.98
负债合计	860,830,082.17	1,061,931,748.57
所有者权益：		
实收基金	2,453,506,743.69	2,333,851,902.41
未分配利润	595,392,549.02	633,306,979.06
所有者权益合计	3,048,899,292.71	2,967,158,881.47
负债和所有者权益总计	3,909,729,374.88	4,029,090,630.04

注：报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.2427元，基金份额总额2,453,506,743.69份。

7.2利润表

会计主体：富国天利增长债券投资基金

本报告期：2010年01月01日至2010年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期（2010年01月01日至2010年12月31日）	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年12月31日）
一、收入	339,888,205.52	274,264,246.70
1.利息收入	137,099,072.48	107,358,405.67
其中：存款利息收入	2,848,619.42	2,087,058.06
债券利息收入	133,940,441.85	104,230,289.80
资产支持证券利息收入	94,303.21	1,030,442.16
买入返售金融资产收入	215,708.00	10,615.65
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）	205,131,080.65	207,662,891.25
其中：股票投资收益	130,129,543.57	19,031,010.24
基金投资收益	-	-
债券投资收益	74,209,018.89	187,064,385.04
资产支持证券投资收益	3,800.55	214,369.87
衍生工具投资收益	-	914,549.03
股利收益	788,717.64	438,577.07
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-4,697,279.17	-42,879,158.31
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	2,355,331.56	2,122,108.09
减：二、费用	63,306,471.70	38,756,317.72
1.管理人报酬	28,540,297.09	22,457,759.74
2.托管费	7,135,074.30	5,614,439.87
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	2,970,882.55	1,315,516.00
5.利息支出	24,411,673.05	9,125,935.05
其中：卖出回购金融资产支出	24,411,673.05	9,125,935.05
6.其他费用	248,544.71	242,667.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	276,581,733.82	235,507,928.98
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	276,581,733.82	235,507,928.98

7.3所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国天利增长债券投资基金

本报告期：2010年01月01日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01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）	2,333,851,902.41	633,306,979.06	2,967,158,881.47
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	276,581,733.82	276,581,733.82
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）	119,654,841.28	15,230,263.95	134,885,105.23
其中：1.基金申购款	3,062,192,578.66	779,359,939.99	3,841,552,518.65
2.基金赎回款	-2,942,537,737.38	-764,129,676.04	-3,706,667,413.42
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）	-	-329,726,427.81	-329,726,427.81
五、期末所有者权益（基金净值）	2,453,506,743.69	595,392,549.02	3,048,899,292.71
项目	上年度可比期间（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）	2,180,056,270.83	573,814,413.92	2,753,870,684.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	235,507,928.98	235,507,928.98
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）	153,795,631.58	31,376,604.46	185,172,236.04
其中：1.基金申购款	3,010,320,228.11	809,824,754.67	3,820,144,982.78
2.基金赎回款	-2,856,524,596.53	-778,448,150.21	-3,634,972,746.74
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）	-	-207,391,968.30	-207,391,968.30
五、期末所有者权益（基金净值）	2,333,851,902.41	633,306,979.06	2,967,158,881.47

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。

7.4.2会计差错更正的说明

本基金本期未发生重大会计差错，无需更正。

7.4.3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。

7.4.4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、注册登记人、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。

7.4.5本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1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12月31日）		上年度可比期间（2009年01月01日至2009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	520,519,107.64	47.34	193,366,519.09	59.33
申银万国	578,947,598.31	52.66	132,574,452.26	40.67

7.4.5.1.2 权证交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2010年01月01日至2010年12月31日）		上年度可比期间（2009年01月01日至2009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（%）
申银万国	-	-	2,411,714.59	100.00

7.4.5.1.3 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12月31日）		上年度可比期间（2009年01月01日至2009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	4,138,737,891.16	59.26	4,336,697,918.06	69.18
申银万国	2,845,403,586.44	40.74	1,931,790,184.95	30.82

7.4.5.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（2010年01月01日至2010年12月31日）		上年度可比期间（2009年01月01日至2009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	25,895,448,000.00	44.34	24,226,600,000.00	71.31
申银万国	32,512,630,000.00	55.66	9,747,300,000.00	28.69

7.4.5.1.5 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	806,926.78	52.75	370,877.49	69.93
申银万国	722,817.79	47.25	159,477.87	30.07
关联方名称	上年度可比期间（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	551,898.63	66.35	278,691.31	95.58
申银万国	279,935.56	33.65	12,873.05	4.42

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。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年12月31日）	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年12月31日）
当期发生的基金应支付的管理费	28,540,297.09	22,457,759.74
其中：支付销售机构的客户维护费	889,005.57	949,988.68

注：（1）基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.80%/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。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2010年01月01日至2010年12月31日）	上年度可比期间（2009年01月01日至2009年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	7,135,074.30	5,614,439.87

注：（1）基金托管费按前一日的基金资产净值的0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%/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。

7.4.5.3 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2010年度及2009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。

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 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2010年度及2009年度均未运用固有资金投资本基金。

7.4.5.4.2 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2010年度及2009年度均未投资本基金。

7.4.5.5 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12月31日）		上年度可比期间（2009年01月01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
中国工商银行	13,325,591.49	2,435,489.32	313,833,470.95	1,861,880.64

7.4.5.6 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2010年度及2009年度未在承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期未无其他关联交易事项的说明。

7.4.6 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.6.1.1 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
002530	丰东股份	2010-12-24	2011-03-31	新股认购	12.00	22.00	2,250,000	27,000,000.00	49,500,000.00	-
002536	西泵股份	2010-12-31	2011-01-11	新股认购	36.00	36.00	1,000	36,000.00	36,000.00	-
601118	海南橡胶	2010-12-30	2011-04-07	新股认购	5.99	5.99	1,847,318	11,065,434.82	11,065,434.82	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	新股认购	23.00	31.11	88,502	2,035,546.00	2,753,297.22	-
601777	力帆股份	2010-11-17	2011-02-28	新股认购	14.50	14.06	347,931	5,044,999.50	4,891,909.86	-
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	新股认购	23.98	31.24	108,825	2,609,623.50	3,399,693.00	-

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票注：截至本报告期末（2010年12月31日）止，本基金期末无持有暂时停牌股票。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末2010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。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币850,000,000.00元，于2011年1月4日、1月5日、1月6日及1月7日先后到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.7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	350,110,511.64	8.95
	其中：股票	350,110,511.64	8.95
2	固定收益投资	3,375,130,077.74	86.33
	其中：债券	3,375,130,077.74	86.33
	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	39,154,098.94	1.00
6	其他各项资产	145,334,686.56	3.72
7	合计	3,909,729,374.88	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	14,418,115.12	0.47
B	采掘业	-	-
C	制造业	163,602,059.80	5.37
C0	食品、饮料	1,499,465.00	0.05
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	13,166,420.72	0.43
C5	电子	14,862,942.58	0.49
C6	金属、非金属	19,161,670.11	0.63
C7	机械、设备、仪表	110,308,457.15	3.62
C8	医药、生物制品	4,603,104.24	0.15
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,624,083.32	0.12
F	交通运输、仓储业	71,760,000.00	2.35
G	信息技术业	13,959,900.00	0.46
H	批发和零售贸易	82,746,353.40	2.71