

富国沪深 300 增强证券投资基金

二〇一一年年度报告

(摘要)

2011 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： 2012 年 03 月 28 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 2012 年 3 月 26 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 2011 年 1 月 1 日起至 2011 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国沪深 300 指数增强
基金主代码	100038
交易代码	前端交易代码：100038 后端交易代码：—
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 12 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	5,325,691,669.25 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在复制目标指数的基础上一定程度地调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越目标指数。
业绩比较基准	95%×沪深 300 指数收益率+1.5%（指年收益率，评价时按期间折算）
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	021-20361858	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		021-20361634	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世纪大道 8 号上海 国金中心二期 16-17 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	2011年	2010年	2009年12月16日 (基金合同生效日) 起至2009年12月 31日)
本期已实现收益	-323,021,879.11	50,298,696.77	4,774,004.01
本期利润	-763,934,907.09	-206,272,008.30	155,687,801.73
加权平均基金份额本期利润	-0.2239	-0.0677	0.0446
本期基金份额净值增长率	-17.67%	-9.00%	4.50%
3.1.2 期末数据和指标	2011年12月31日	2010年12月31日	2009年12月31日
期末可供分配基金份额利润	-0.2172	-0.0492	0.0014
期末基金资产净值	4,168,891,645.10	2,469,589,320.60	3,645,597,104.75
期末基金份额净值	0.783	0.951	1.045

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

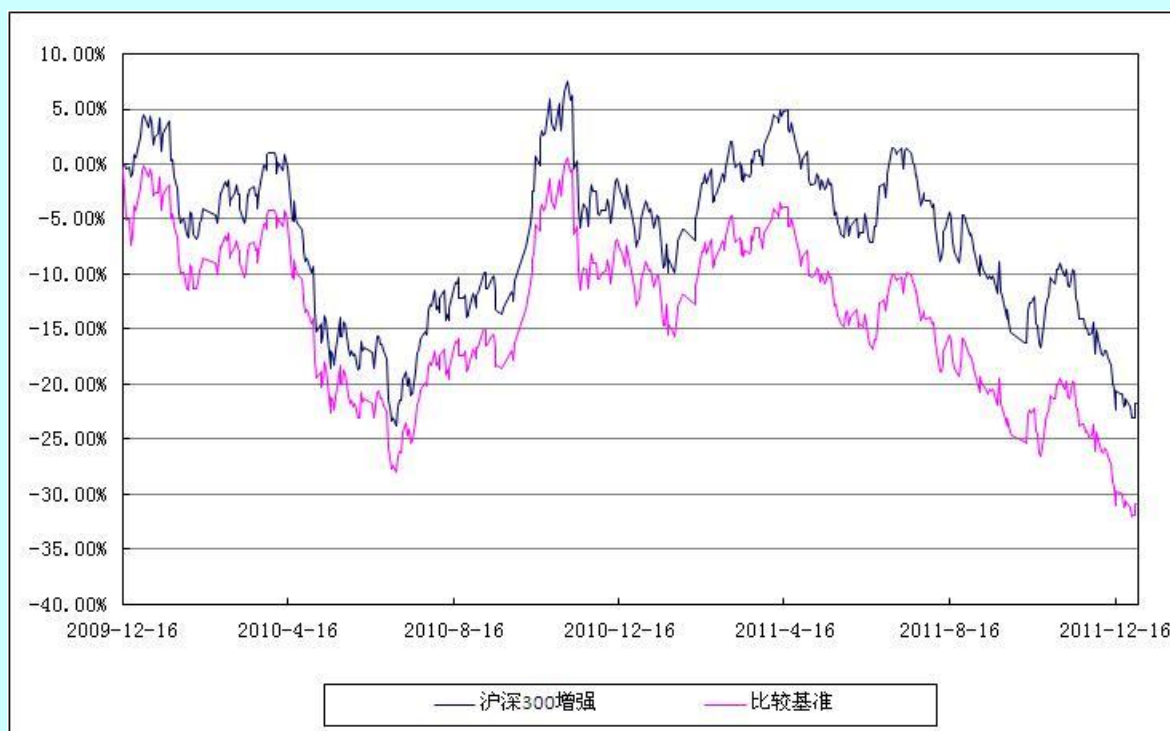
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-7.56%	1.35%	-8.32%	1.34%	0.76%	0.01%
过去六个月	-20.67%	1.32%	-21.29%	1.29%	0.62%	0.03%
过去一年	-17.67%	1.25%	-22.70%	1.23%	5.03%	0.02%
自基金合同生效日起至今	-21.70%	1.39%	-30.88%	1.38%	9.18%	0.01%

注：

本基金根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定,本基金业绩比较基准=95%×沪深300指数收益率+1.5% (指年收益率,评价时按期间折算)。沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权,由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票,能够反映A股市场总体发展趋势。

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: $benchmark_t = 95\% * [沪深300指数_t / (沪深300指数_{t-1}) - 1] + [(1+0.015)^{(1/250)} - 1]$; 其中, $t=1,2,3,\dots, T$, T 表示时间截至日; 期间T日收(benchmark_T)按下列公式计算: $benchmark_T = [\prod_{t=1}^T (1+benchmark_t)] - 1$ 其中, $T=2,3,4,\dots$; $\prod_{t=1}^T (1+benchmark_t)$ 表示t日至T日的(1+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:截至日期为2011年12月31日。本基金于2009年12月16日成立,建仓期6个月,从2009年12月16日至2010年6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：1. 本基金合同生效日为 2009 年 12 月 16 日。

2. 本图所示时间区间为 2009 年 12 月 16 日至 2011 年 12 月 31 日。

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
2011年	—	—	—	—	—
2010年	—	—	—	—	—
2009年	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—

注：1 本基金未进行利润分配。

2 本基金于 2009 年 12 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2011年12月31日，本基金管理人共管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、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、富国天丰强化收益债券型证券投资基金、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、富国汇利分级债券型证券投资基金、富国全球债券证券投资基金、富国可转换债券证券投资基金、上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天盈分级债券型证券投资基金、富国全球顶级消费品股票型证券投资基金、富国低碳环保股票型证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金（LOF）、富国产业债债券型证券投资基金二十六只证券投资基金。

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		
李笑薇	本基金基金经理兼任公司总经理助理、另类投资部总经理、上证综指交易型开放式指数证券投资基金基金经理、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、富国中证500指数增强型证券投资基金基金经理	2009-12-23	—	9年	博士，曾任摩根士丹利资本国际Barra公司(MSCIBARRA)，BARRA股票风险评估部高级研究员；巴克莱国际投资管理公司(BarclaysGlobal Investors)，大中华主动股票投资总监、高级基金经理及高级研究员；2009年12月起任富国沪深300增强证券投资基金基金经理，2011年1月起任上证综指交易型开放式指数证券投资基金、富国上证综指交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理，2011年10月起任富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)基金经理；兼任富国基金公司总经理助理、另类投资部总经理；具有中国基金从业资格，美国国籍。
常松	前任基金	2009-12-16	2011-05-13	11年	博士，2001年任富国基金管理有限

	经理				公司数量研究分析师、数量研究组主管、金融数量工程部经理，2008年11月至今任富国天鼎基金经理，2009年12月起兼任富国沪深300增强证券投资基金基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
--	----	--	--	--	---

注：1、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。

2、本公司于2011年5月13日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上做公告，聘任李笑薇女士担任本基金基金经理职务，免去常松先生本基金基金经理职务。

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沪深300增强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》、《富国沪深300增强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

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

在本报告期内，本基金遇到了较多申购赎回，较大地增加了本基金的交易成本。

值得欣慰的是本基金采取了量化增强策略获得了较好的效果，在种种不利的因素下，最后本基金在报告期内仍然获得了8.15%累积超额收益（相对于95%*沪深300指数）。而且从稳定性来看，全年的12个月中，9个月都战胜了基准，量化增强策略的整体效果符合我们预期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2011 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.783 元，份额累计净值为 0.783 元。报告期内，本基金份额净值增长率为-17.67%，同期业绩比较基准收益率为-22.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2011 年，宏观调控政策持续收紧，欧美主权债务危机使得外围经济复苏的不确定性增加，国内经济增长放缓，使得整个市场全年处于单边下行走势，沪深 300 指数下跌 25.01%。相对而言，估值较安全的大盘蓝筹和价值股下跌幅度较少。

展望 2012 年，宏观政策放松可期，欧美主权债务危机可能引发新的国际金融风险也得到了很大程度的缓解，虽然经济增长面临一定的下行压力，但鉴于目前市场点位已经体现了对经济悲观的预期，市场继续下行的空间已非常小，部分低估值大盘蓝筹股和前期跌幅较深的成长股已经具有了相当的安全边际。预计 2012 年上半年，随着宏观政策有所放松，市场出现反弹行情的概率在增加。整体来看，2012 年市场表现好于 2011 年为大概率事件。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规、本基金《基金合同》的约定以及基金的实际运作情况，2011 年报告期末本基金未满足收益分配条件，故不进行收益分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年，本基金托管人在对富国沪深 300 增强证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

2011年,富国沪深300增强证券投资基金的管理人——富国基金管理有限公司在富国沪深300增强证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,富国沪深300增强证券投资基金未进行利润分配。

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沪深300增强证券投资基金2011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。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2012年3月26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:富国沪深300增强证券投资基金

报告截止日:2011年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 (2011年12月31日)	上年度末 (2010年12月31日)
资产:		
银行存款	221,501,807.28	118,845,424.87
结算备付金	13,021,011.07	9,416,074.34
存出保证金	3,231,498.41	1,516,542.43
交易性金融资产	3,940,929,446.00	2,340,787,886.83
其中:股票投资	3,940,929,446.00	2,331,718,136.83
基金投资	—	—
债券投资	—	9,069,750.00
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	—	7,906,417.56

应收利息	48,064.39	43,666.96
应收股利	—	—
应收申购款	1,002,306.01	597,839.12
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	4,179,734,133.16	2,479,113,852.11
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	(2011年12月31日)	(2010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	—	—
应付赎回款	1,627,242.27	1,422,469.63
应付管理人报酬	3,474,066.05	2,234,925.83
应付托管费	625,331.89	402,286.64
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	4,672,317.00	5,211,349.40
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	443,530.85	253,500.01
负债合计	10,842,488.06	9,524,531.51
所有者权益:		
实收基金	5,325,691,669.25	2,597,394,413.17
未分配利润	-1,156,800,024.15	-127,805,092.57
所有者权益合计	4,168,891,645.10	2,469,589,320.60
负债和所有者权益总计	4,179,734,133.16	2,479,113,852.11

注：报告截止日 2011 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.783 元，基金份额总额 5,325,691,669.25 份。

7.2 利润表

会计主体：富国沪深 300 增强证券投资基金

本报告期：2011 年 01 月 01 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2011年01月01日至 2011年12月31日)	上年度可比期间 (2010年01月01日至 2010年12月31日)
一、收入	-688,384,889.51	-149,044,718.04

1. 利息收入	1,414,059.65	1,234,966.17
其中：存款利息收入	1,410,279.46	1,229,515.89
债券利息收入	3,780.19	5,450.28
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）	-251,999,640.56	102,657,815.12
其中：股票投资收益	-295,867,170.58	67,624,763.91
基金投资收益	—	—
债券投资收益	427,171.86	306,769.17
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	—	—
股利收益	43,440,358.16	34,726,282.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-440,913,027.98	-256,570,705.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	3,113,719.38	3,633,205.74
减：二、费用	75,550,017.58	57,227,290.26
1. 管理人报酬	31,167,000.24	28,471,203.18
2. 托管费	5,610,060.02	5,124,816.55
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	38,054,996.98	22,962,398.48
5. 利息支出	—	—
其中：卖出回购金融资产支出	—	—
6. 其他费用	717,960.34	668,872.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-763,934,907.09	-206,272,008.30
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-763,934,907.09	-206,272,008.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：富国沪深300增强证券投资基金

本报告期：2011年01月01日至2011年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2011年01月01日至2011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）	2,597,394,413.17	-127,805,092.57	2,469,589,320.60
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-763,934,907.09	-763,934,907.09
三、本期基金份额交易产生的基金净值	2,728,297,256.08	-265,060,024.49	2,463,237,231.59

变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	5,313,983,416.15	-359,792,124.89	4,954,191,291.26
2. 基金赎回款	-2,585,686,160.07	94,732,100.40	-2,490,954,059.67
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）	5,325,691,669.25	-1,156,800,024.15	4,168,891,645.10
项目	上年度可比期间 (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）	3,489,909,303.02	155,687,801.73	3,645,597,104.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-206,272,008.30	-206,272,008.30
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）	-892,514,889.85	-77,220,886.00	-969,735,775.85
其中：1. 基金申购款	2,118,286,732.26	-181,478,331.89	1,936,808,400.37
2. 基金赎回款	-3,010,801,622.11	104,257,445.89	-2,906,544,176.22
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）	2,597,394,413.17	-127,805,092.57	2,469,589,320.60

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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、注册登记机构、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(2011年01月01日至2011年12月31日)		上年度可比期间 (2010年01月01日至2010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	7,417,876,370.48	29.03	3,082,610,178.77	21.06
申银万国	6,339,316,396.15	24.81	4,841,552,827.67	33.08

7.4.5.1.2 权证交易

注：本基金本期及其上期可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.5.1.3 债券交易

注：本基金本期及其上期可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.5.1.4 回购交易

注：本基金本期及其上期可比期间未通过关联方交易单元进行回购交易。

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(2011年01月01日至2011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	6,305,187.16	29.42	1,668,452.68	35.71
申银万国	5,245,813.43	24.47	241,591.65	5.17
关联方名称	上年度可比期间 (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	2,620,215.86	21.32	985,354.55	18.91
申银万国	4,024,725.18	32.74	1,796,168.87	34.47

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(2011年01月01日至2011年12月31日)	上年度可比期间 (2010年01月01日至2010年12月)

		31日)
当期发生的基金应支付的管理费	31,167,000.24	28,471,203.18
其中：支付销售机构的客户维护费	3,191,192.35	4,880,409.70

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.00%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期（2011年01月01日至2011年12月31日）	上年度可比期间（2010年01月01日至2010年12月31日）
当期发生的基金应支付的托管费	5,610,060.02	5,124,816.55

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的0.18%的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.18\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

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2011年度及2010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

份额单位：份

项目	本期(2011年01月01日至2011年12月31日)	上年度可比期间(2010年01月01日至2010年12月31日)
基金合同生效日(2009年12月16日)持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	20,002,200.00	20,002,200.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	20,002,200.00	20,002,200.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.38%	0.77%

注：本基金管理人认购/申购本基金份额的费率按照本基金发售公告的条款执行，不存在费率优惠的情况。本基金管理人投资本基金按照公告的费率条款执行，不存在费率优惠的情况。

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于 2011 年年末和 2010 年年末均未投资本基金。

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（2011 年 01 月 01 日至 2011 年 12 月 31 日）		上年度可比期间（2010 年 01 月 01 日至 2010 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
中国工商银行股份有限公司	221,501,807.28	1,134,476.52	118,845,424.87	1,083,549.34

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 2011 年度及 2010 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 2011 年度及 2010 年度均无其他关联方交易事项。

7.4.6 期末（2011 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

注：本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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：至本报告期末 2011 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 2011 年 12 月 31 日止，本基金无证券交易所债券正回购，未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.7 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	3,940,929,446.00	94.29
	其中：股票	3,940,929,446.00	94.29
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	234,522,818.35	5.61
6	其他各项资产	4,281,868.81	0.10
7	合计	4,179,734,133.16	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

积极投资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	6,104,839.28	0.15
B	采掘业	1,524,186.00	0.04
C	制造业	258,014,706.44	6.19
C0	食品、饮料	2,106,510.00	0.05
C1	纺织、服装、皮毛	3,048,325.34	0.07
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	1,525,680.00	0.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	38,147,262.07	0.92
C5	电子	106,621,669.85	2.56
C6	金属、非金属	53,732,629.81	1.29
C7	机械、设备、仪表	50,102,110.37	1.20
C8	医药、生物制品	2,730,519.00	0.07
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	13,742,776.00	0.33
F	交通运输、仓储业	6,997,517.50	0.17
G	信息技术业	5,584,324.97	0.13
H	批发和零售贸易	8,974,157.22	0.22
I	金融、保险业	14,142,459.10	0.34
J	房地产业	12,329,956.47	0.30
K	社会服务业	37,041,991.60	0.89
L	传播与文化产业	—	—
M	综合类	6,245,778.00	0.15
	合计	370,702,692.58	8.89

指数投资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	464,181,238.87	11.13
C	制造业	1,199,708,954.06	28.78
C0	食品、饮料	282,496,555.72	6.78
C1	纺织、服装、皮毛	40,660,911.76	0.98
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	—	—
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,553,795.57	0.06
C5	电子	17,627,612.18	0.42
C6	金属、非金属	135,305,617.60	3.25
C7	机械、设备、仪表	560,702,362.95	13.45
C8	医药、生物制品	160,362,098.28	3.85
C99	其他制造业	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	115,141,328.91	2.76
E	建筑业	108,288,403.96	2.60
F	交通运输、仓储业	177,816,529.81	4.27
G	信息技术业	13,559,882.40	0.33
H	批发和零售贸易	168,125,868.69	4.03
I	金融、保险业	1,046,706,845.93	25.11
J	房地产业	247,998,210.71	5.95
K	社会服务业	6,039,822.60	0.14
L	传播与文化产业	1,396,472.08	0.03
M	综合类	21,263,195.40	0.51
	合计	3,570,226,753.42	85.64

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

8.3.1 期末指数投资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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	13,909,164	165,101,776.68	3.96
2	600016	民生银行	26,768,298	157,665,275.22	3.78
3	601166	兴业银行	9,489,397	118,807,250.44	2.85

4	601318	中国平安	3,396,178	116,964,370.32	2.81
5	601088	中国神华	4,530,838	114,766,126.54	2.75
6	000002	万科A	12,809,213	95,684,821.11	2.30
7	601668	中国建筑	27,649,896	80,461,197.36	1.93
8	601328	交通银行	17,067,882	76,464,111.36	1.83
9	000001	深发展A	4,880,551	76,087,790.09	1.83
10	600000	浦发银行	8,655,207	73,482,707.43	1.76

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

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600060	海信电器	3,555,529	42,239,684.52	1.01
2	000598	兴蓉投资	4,479,080	37,041,991.60	0.89
3	600160	巨化股份	1,579,569	31,670,358.45	0.76
4	000970	中科三环	1,230,101	24,589,718.99	0.59
5	600366	宁波韵升	1,641,378	24,341,635.74	0.58

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	600036	招商银行	297,557,501.18	12.05
2	600000	浦发银行	265,875,938.41	10.77
3	601166	兴业银行	263,267,475.40	10.66
4	601601	中国太保	250,853,965.73	10.16
5	601318	中国平安	233,065,865.22	9.44
6	601668	中国建筑	223,203,915.56	9.04
7	600030	中信证券	215,507,012.54	8.73

8	601088	中国神华	207,894,137.61	8.42
9	000001	深发展A	204,945,967.89	8.30
10	600028	中国石化	196,678,800.24	7.96
11	600739	辽宁成大	195,604,886.08	7.92
12	600196	复星医药	192,340,629.76	7.79
13	000157	中联重科	189,391,481.80	7.67
14	600160	巨化股份	187,246,848.73	7.58
15	600362	江西铜业	182,987,198.74	7.41
16	601288	农业银行	179,763,303.58	7.28
17	000858	五粮液	179,531,391.57	7.27
18	600016	民生银行	176,512,795.88	7.15
19	600547	山东黄金	169,261,126.37	6.85
20	601006	大秦铁路	159,912,590.47	6.48
21	600015	华夏银行	155,631,327.39	6.30
22	000002	万科A	155,124,066.34	6.28
23	600519	贵州茅台	154,230,625.00	6.25
24	000402	金融街	151,557,437.18	6.14
25	600585	海螺水泥	148,835,267.22	6.03
26	600383	金地集团	146,292,786.71	5.92
27	600875	东方电气	145,376,521.98	5.89
28	002304	洋河股份	142,068,585.31	5.75
29	600060	海信电器	135,800,887.95	5.50
30	600795	国电电力	132,450,925.91	5.36
31	600741	华域汽车	127,926,636.12	5.18
32	601899	紫金矿业	124,291,975.75	5.03
33	000623	吉林敖东	120,760,793.91	4.89
34	600111	包钢稀土	118,802,229.50	4.81
35	601998	中信银行	117,011,242.57	4.74
36	600690	青岛海尔	116,410,728.30	4.71
37	600900	长江电力	110,954,883.85	4.49
38	600177	雅戈尔	102,962,630.38	4.17
39	000666	经纬纺机	102,916,277.90	4.17
40	600009	上海机场	101,430,619.65	4.11
41	600048	保利地产	100,532,649.98	4.07
42	600029	南方航空	99,390,243.81	4.02
43	000792	盐湖股份	98,779,289.44	4.00
44	000651	格力电器	95,211,836.93	3.86
45	600369	西南证券	93,463,546.71	3.78
46	002465	海格通信	93,373,439.52	3.78
47	601328	交通银行	92,830,573.56	3.76
48	000876	新希望	90,501,073.08	3.66

49	601333	广深铁路	88,993,348.01	3.60
50	601727	上海电气	88,193,286.47	3.57
51	600717	天津港	86,059,084.20	3.48
52	600031	三一重工	84,118,347.67	3.41
53	000685	中山公用	81,000,479.00	3.28
54	600549	厦门钨业	76,983,848.07	3.12
55	000039	中集集团	76,201,341.26	3.09
56	002155	辰州矿业	74,874,575.59	3.03
57	600631	百联股份	74,304,092.66	3.01
58	600307	酒钢宏兴	74,185,007.58	3.00
59	600827	友谊股份	73,197,358.11	2.96
60	601101	昊华能源	72,748,140.72	2.95
61	600320	振华重工	71,450,995.39	2.89
62	002422	科伦药业	71,285,099.37	2.89
63	000726	鲁泰A	71,163,630.60	2.88
64	600172	黄河旋风	68,565,913.95	2.78
65	000568	泸州老窖	68,437,995.47	2.77
66	600153	建发股份	68,132,420.44	2.76
67	600325	华发股份	67,892,119.33	2.75
68	600816	安信信托	67,791,557.41	2.75
69	000043	中航地产	66,896,351.17	2.71
70	000778	新兴铸管	65,319,081.57	2.64
71	600104	上海汽车	64,321,698.55	2.60
72	601989	中国重工	63,765,734.32	2.58
73	000598	兴蓉投资	63,656,034.91	2.58
74	600508	上海能源	63,536,981.11	2.57
75	601699	潞安环能	63,293,455.99	2.56
76	600489	中金黄金	61,229,107.79	2.48
77	600221	海南航空	60,560,622.11	2.45
78	600138	中青旅	58,055,830.39	2.35
79	000960	锡业股份	58,020,976.34	2.35
80	600742	一汽富维	56,909,978.66	2.30
81	600019	宝钢股份	56,725,799.12	2.30
82	600704	物产中大	56,658,505.84	2.29
83	601898	中煤能源	56,580,856.90	2.29
84	000755	山西三维	56,351,239.10	2.28
85	601369	陕鼓动力	55,506,108.50	2.25
86	600219	南山铝业	55,208,516.65	2.24
87	600887	伊利股份	54,674,416.45	2.21
88	600694	大商股份	53,749,049.91	2.18
89	600635	大众公用	53,405,945.03	2.16

90	600655	豫园商城	53,214,741.92	2.15
91	000962	东方钨业	53,202,826.88	2.15
92	000630	铜陵有色	52,888,562.85	2.14
93	600018	上港集团	52,805,617.84	2.14
94	600376	首开股份	52,269,822.87	2.12
95	600409	三友化工	51,311,144.24	2.08
96	600723	首商股份	51,115,523.58	2.07
97	002024	苏宁电器	49,948,801.50	2.02
98	600518	康美药业	49,920,432.85	2.02

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	234,142,112.09	9.48
2	600000	浦发银行	224,323,664.38	9.08
3	601166	兴业银行	210,062,447.85	8.51
4	601601	中国太保	205,325,712.17	8.31
5	600028	中国石化	191,211,312.72	7.74
6	601318	中国平安	163,466,417.52	6.62
7	601288	农业银行	162,539,126.36	6.58
8	600585	海螺水泥	162,470,138.87	6.58
9	601006	大秦铁路	161,859,997.15	6.55
10	601088	中国神华	160,700,136.41	6.51
11	600016	民生银行	157,190,916.95	6.37
12	600160	巨化股份	153,807,064.35	6.23
13	600519	贵州茅台	149,326,969.86	6.05
14	600036	招商银行	147,107,402.04	5.96
15	600362	江西铜业	142,935,945.55	5.79
16	600900	长江电力	141,501,573.45	5.73
17	601668	中国建筑	141,077,097.86	5.71
18	000858	五粮液	140,374,394.32	5.68
19	600019	宝钢股份	135,821,243.88	5.50
20	600015	华夏银行	125,518,886.35	5.08
21	600111	包钢稀土	124,181,549.37	5.03
22	600739	辽宁成大	123,828,017.50	5.01
23	000002	万科A	118,017,870.29	4.78
24	600196	复星医药	117,337,539.52	4.75
25	000001	深发展A	111,874,872.95	4.53
26	600383	金地集团	108,959,202.80	4.41

27	600547	山东黄金	106,403,258.05	4.31
28	000402	金融街	104,184,622.75	4.22
29	000726	鲁泰A	102,849,965.48	4.16
30	600875	东方电气	102,497,654.30	4.15
31	600031	三一重工	99,333,824.06	4.02
32	000666	经纬纺机	99,104,609.98	4.01
33	600631	百联股份	98,953,137.19	4.01
34	000157	中联重科	97,498,112.98	3.95
35	000651	格力电器	95,917,284.55	3.88
36	601899	紫金矿业	95,515,909.41	3.87
37	000039	中集集团	93,705,449.41	3.79
38	000792	盐湖股份	91,202,979.96	3.69
39	002304	洋河股份	89,395,101.69	3.62
40	600690	青岛海尔	88,932,023.04	3.60
41	600741	华域汽车	87,777,816.84	3.55
42	600009	上海机场	87,526,051.52	3.54
43	002465	海格通信	86,773,878.54	3.51
44	600060	海信电器	84,529,789.52	3.42
45	601699	潞安环能	78,841,446.04	3.19
46	601866	中海集运	77,830,047.55	3.15
47	600369	西南证券	77,639,084.09	3.14
48	600172	黄河旋风	76,991,784.80	3.12
49	600795	国电电力	76,638,714.35	3.10
50	000623	吉林敖东	75,622,231.80	3.06
51	002422	科伦药业	74,115,068.50	3.00
52	601101	昊华能源	70,263,372.76	2.85
53	000488	晨鸣纸业	67,058,805.41	2.72
54	000338	潍柴动力	65,246,348.36	2.64
55	600325	华发股份	65,047,049.79	2.63
56	600153	建发股份	64,952,183.37	2.63
57	600138	中青旅	63,015,643.69	2.55
58	600029	南方航空	62,297,127.17	2.52
59	000755	山西三维	62,097,781.57	2.51
60	000527	美的电器	60,241,735.05	2.44
61	600549	厦门钨业	60,212,429.41	2.44
62	600704	物产中大	58,674,902.78	2.38
63	000043	中航地产	56,417,909.38	2.28
64	600508	上海能源	56,287,269.26	2.28
65	000960	锡业股份	56,270,197.56	2.28
66	000562	宏源证券	55,484,617.24	2.25
67	600816	安信信托	55,374,169.55	2.24

68	601939	建设银行	55,300,054.56	2.24
69	601998	中信银行	53,417,993.92	2.16
70	600177	雅戈尔	53,376,233.28	2.16
71	002024	苏宁电器	52,898,318.04	2.14
72	000069	华侨城A	52,709,225.49	2.13
73	600409	三友化工	51,810,779.88	2.10
74	600018	上港集团	51,687,845.99	2.09
75	600827	友谊股份	51,317,472.32	2.08
76	600375	星马汽车	51,192,081.48	2.07
77	600742	一汽富维	50,012,875.32	2.03
78	000630	铜陵有色	49,800,052.48	2.02
79	600219	南山铝业	49,773,365.18	2.02
80	600810	神马股份	49,684,834.90	2.01
81	600048	保利地产	49,506,061.48	2.00
82	600221	海南航空	49,482,996.65	2.00
83	000895	双汇发展	49,450,869.58	2.00

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	13,953,264,984.74
卖出股票收入（成交）总额	11,613,900,954.39

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	—	—
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	中期票据	—	—
7	可转债	—	—
8	其他	—	—
9	合计	—	—

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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。

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

8.9.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

本报告期本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定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	3,231,498.41
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	48,064.39
5	应收申购款	1,002,306.01
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,281,868.81

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

8.9.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.9.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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(%)
33942	156,905.65	3,964,456,067.18	74.44	1,361,235,602.07	25.56

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	6,776,820.43	0.1272

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年12月16日)基金份额总额	3,489,909,303.02
报告期期初基金份额总额	2,597,394,413.17
本报告期基金总申购份额	5,313,983,416.15
减：本报告期基金总赎回份额	2,585,686,160.07
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	5,325,691,669.25

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 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

本报告期内本基金基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所，本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 10 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 9 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和基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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 (%)	
长江证券	2	2,490,472,905.27	9.75	—	—	—	—	—	—	2,097,617.00	9.79	—
方正证券	1	40,874,267.06	0.16	—	—	—	—	—	—	33,210.81	0.15	—
国都证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
国海证券	2	2,286,799,753.43	8.95	—	—	—	—	—	—	1,940,048.11	9.05	—
国泰君安	2	1,999,874,500.31	7.83	7,550,756.00	30.75	—	—	—	—	1,629,856.71	7.60	—
海通证券	1	7,417,876,370.48	29.03	—	—	—	—	—	—	6,305,187.16	29.42	—
宏源证券	2	792,485,435.94	3.10	—	—	—	—	—	—	668,649.45	3.12	—
江海证券	2	1,386,890,599.91	5.43	—	—	—	—	—	—	1,138,424.50	5.31	—
上海证券	2	127,488,034.82	0.50	—	—	—	—	—	—	108,363.62	0.51	—
申银万国	2	6,339,316,396.15	24.81	—	—	—	—	—	—	5,245,813.43	24.47	—
西部证券	2	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
英大证券	1	93,558,674.95	0.37	—	—	—	—	—	—	79,525.94	0.37	—
招商证券	1	1,995,025,389.12	7.81	17,002,522.30	69.25	—	—	—	—	1,695,760.96	7.91	—
中信证券	2	583,915,828.17	2.28	—	—	—	—	—	—	492,739.81	2.30	—

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。本期内本基金租用券商交易单元的变更情况：

新增租用交易单元：国都证券深圳 390250、国海证券深圳 233306、宏源证券深圳 243801、长江证券上海：25796，深圳：391278、方正证券深圳 391273、上海证券上海：22034，深圳：255400、西部证券上海：44031，深圳：255000、中信证券上海：25616，深圳：391163。

