诺安股票证券投资基金 2009年年度报告摘要

2009年12月31日

基金管理人:诺安基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2010年3月31日

§1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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。本年度报告已经全体独立董事签字同意,并由董事长签发。

本基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本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。

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2009年1月1日起至12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	诺安股票
基金主代码	320003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年12月19日
基金管理人	诺安基金管理有限公司
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	21,275,937,282.06份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以中国企业的比较优势和全球化发展为视角,发掘最具投资价值的企业,获得稳定的中长期资本投资收益。在主动投资的理念下,本基金的投资目标是取得超额利润,也就是在承担和控制市场风险的情况下,取得稳定的、优于业绩基准的中长期投资回报。
投资策略	本基金实施积极的投资策略。在资产类别配置层面,本基金关注市场资金在各个资本市场间的流动,动态调整股票资产的配置比例;在此基础上本基金注重有中国比较优势和有国际化发展基础的优势行业的研究和投资;在个股选择层面,本基金通过对上市公司主营业务盈利能力和持续性的定量分析,挖掘具有中长期投资价值的股票;在债券投资方面,本基金将运用多种投资策略,力求获取高于市场平均水平的投资回报。
业绩比较基准	80%×新华富时A600指数+20%×新华富时中国国债指数
风险收益特征	本基金属于中高风险的股票型基金,通过合理的资产配置和投资组合的建立,有效地规避风险并相应地获得较高的投资收益。

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		诺安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈勇	蒋松云
	联系电话	0755-83026688	010-66105799
	电子邮箱	info@lionfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-8998	95588
传真		0755-83026677	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.lionfund.com.cn
基金年度报告备置地点	深圳市深南大道4013号兴业银行大厦19-20层诺安基金管理有限公司

§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	2009年	2008年	2007年
本期已实现收益	-614,474,325.17	-4,890,852,361.82	5,565,113,898.94
本期利润	11,197,984,326.79	-20,427,283,916.69	11,439,208,789.37
加权平均基金份额本期利润	0.4773	-0.7728	0.7280
本期基金份额净值增长率(%)	69.63	-53.35	145.27
3.1.2 期末数据和指标	2009年末	2008年末	2007年末
期末可供分配基金份额利润	-0.1273	-0.3388	0.0864
期末基金资产净值	23,862,515,626.09	16,538,859,126.20	41,435,309,267.44
期末基金份额净值	1.1216	0.6612	1.4174

注:①上述基金业绩指标不包括持有人申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。

3.2 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	14.67%	1.50%	15.85%	1.39%	-1.18%	0.11%
过去六个月	10.36%	1.80%	12.02%	1.69%	-1.66%	0.11%
过去一年	69.63%	1.65%	72.91%	1.63%	-3.28%	0.02%
过去三年	94.08%	1.95%	65.16%	2.01%	28.92%	-0.06%
自基金成立起至今	323.23%	1.81%	221.63%	1.83%	101.60%	-0.02%

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

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

提示:本基金基金合同于2005年12月19日生效,2005年本基金净值增长率按本基金实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2009年	-	-	-	-	本期未分红
2008年	-	-	-	-	本期未分红
2007年	8.100	1,205,905,399.71	2,197,412,033.04	3,403,317,432.75	本期分红一次
合计	8.100	1,205,905,399.71	2,197,412,033.04	3,403,317,432.75	-

§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

诺安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]132号文批准,公司股东为中国对外经济贸易信托有限公司、深圳市捷隆投资有限公司、北京中关村科学城建设股份有限公司,公司注册资本为1.5亿元人民币。公司建立了完善的内部风险控制制度、投资管理制度、监察稽核制度、财务管理制度、人力资源管理制度、信息披露制度、信息技术管理制度、基金会计核算制度、基金销售管理制度、保密制度、紧急应变制度、授权管理制度、资料档案管理制度等公司管理制度体系。截至2009年12月31日,公司共管理九只开放式基金;诺安平衡证券投资基金、诺安货币市场基金、诺安股票证券投资基金,诺安优化收益债券型证券投资基金、诺安价值增长股票证券投资基金、诺安灵活配置混合型证券投资基金、诺安成长股票型证券投资基金、诺安增利债券型证券投资基金、诺安中证100指数证券投资基金。

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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
杨谷	副总经理、投资总监、本基金的基金经理。	2006年6月22日	-	11	经济学硕士,CFA,具有基金从业资格。曾任职于平安证券公司综合研究所、西北证券公司资产管理部;2003年10月加入诺安基金管理有限公司,现任公司副总经理、投资总监。曾于2006年11月至2007年11月任诺安价值增长股票证券投资基金基金经理,2006年2月起任诺安股票证券投资基金基金经理。

注:①此处的任职日期为公司作出决定并对外公告之日;

②证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定等。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

2009年8月,诺安股票证券投资基金由于业务人员操作失误,发生"光讯科技"网下申购无效的事件,诺安基金管理有限公司在事件发生后积极应对,及时向监管部门和托管行作出了说明、解释,并对公司新股网下申购的内部流程进行了梳理和完善。

除此之外,报告期内,诺安股票证券投资基金在各方面的运作都严格按照有关法律法规、基金合同的规定进行,未出现违法违规行为。

基金管理人将不断完善各项规章制度和业务流程,坚持合法合规经营,防止违规问题的发生。

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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合,并根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》制定了《诺安基金管理有限公司公平交易制度》以及相应的流程,并通过系统和人工等方式在各环节严格控制,保证了公平交易的严格执行,本报告期内未出现任何违反公平交易制度的行为。

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

本基金与诺安价值增长股票证券投资基金(简称"诺安价值增长股票")为投资风格相似的投资组合。报告期内,本基金的净值增长率为69.63%,诺安价值增长股票的净值增长率为78.89%,两者相差9.26个百分点。

对两只基金进行业绩归因分析表明:1、本基金的行业选择效用比诺安价值增长股票的行业选择效用低3.85%;2、本基金的个股选择效用比诺安价值增长股票的个股选择效用低3.36%。因此行业选择效用和个股选择效用是造成净值增长率差异的主要原因。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内,本基金不存在异常交易情况。

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

2009年上半年,市场见底上涨,本基金仓位低于基准水平,由于组合中配置的周期类股票高于基准配置,业绩表现基本达到基准的水平。下半年,由于非周期股票表现较好,本基金表现弱于基准。从全年来看,本基金落后基准3.28%,其中仓位因素落后3.95%。

4.4.2 报告期内基金业绩的表现

截至报告期末,本基金份额净值为1.1216元,本报告期基金份额净值增长率为69.63%,同期业绩比较基准收益率为72.91%。

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2010年,宏观经济尽管存在通胀超预期、经济二次探底的风险,但是我们估计宏观经济并不是市场主要的压制因素。尽管发达国家经济不排除出现第二次回落的可能,但是中国的内需市场足以支持经济稳定。市场的主要压制因素在于宏观政策退出带来的流动性紧缩、再融资以及大小非减持压力带来的估值中枢下降。市场需要经过一个业绩修复以及消化流动性压力的时间,经历了这段时间之后,市场可能迎来一轮新的上涨。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内,本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《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》与《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定,日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行,基金份额净值由本基金管理人完成估值后,经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

报告期内,公司制定了证券投资基金的估值政策和程序,并由研究部、财务综合部、监察稽核部和风险管理人员、固定收益人员及基金经理等组成了估值小组,负责研究、指导基金估值业务。估值小组成员均为公司各部门人员,均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历,且之间不存在任何重大利益冲突。基金经理作为公司估值小组的成员,不介入基金日常估值业务,但应参加估值小组会议,可以提议测算某一投资品种的估值调整影响,并有权表决有关议案但仅享有一票表决权,从而将其影响程度进行适当限制,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。

报告期内,本基金未签约与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金合同约定,在符合有关基金分红条件的前提下,本基金每年收益分配次数最少一次,最多为六次;基金投资当期出现净亏损,则不进行收益分配;基金当年收益应先弥补上一年度亏损后,才可进行当年收益分配。

本基金2009年收益弥补上一年度亏损后的可分配收益为负值,根据基金合同规定,本基金本期不进行利润分配。

§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

2009年,本托管人在对诺安股票证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同,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

2009年,诺安股票证券投资基金的管理人——诺安基金管理有限公司在诺安股票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基本按照有关法律法规、基金合同的规定进行。本报告期内,诺安股票证券投资基金未进行利润分配。

2009年,诺安股票证券投资基金出现过新股申购无效的情况,我行及时向诺安基金管理有限公司发送提示函件,诺安基金管理有限公司在规定时间内及时对投资组合进行披露或调整,未给基金持有人造成损失。

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

本托管人依法对诺安基金管理有限公司编制和披露的诺安股票证券投资基金2009年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

利安达会计师事务所及其经办注册会计师门嘉、陈静于2010年3月15日出具了利安达审字[2010]第1007号"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:诺安股票证券投资基金

报告截止日:2009年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2009年12月31日	上年度末 2008年12月31日
资产:		
银行存款	2,401,748,269.79	5,676,566,625.97
结算备付金	20,091,472.15	17,703,211.14
存出保证金	3,214,226.21	2,115,634.44
交易性金融资产	21,576,765,064.95	10,877,633,298.52
其中:股票投资	21,576,765,064.95	10,875,592,355.92
债券投资	-	2,040,942.60
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	-	-
应收利息	449,922.92	1,156,314.36
应收股利	-	-
应收申购款	51,925,823.37	1,587,669.72
其他资产	-	-
资产总计	24,054,194,779.39	16,576,762,754.15
负债和所有者权益	**本期末 2009年12月31日**	**上年度末 2008年12月31日**
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	102,732,738.28	-
应付赎回款	43,791,558.10	7,977,753.38
应付管理人报酬	30,020,803.14	21,954,515.12
应付托管费	5,003,467.18	3,659,085.85
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	8,654,054.03	2,907,403.60
应交税费	25,000.00	25,000.00
应付利息	-	-
应付利润	-	-
其他负债	1,451,532.57	1,379,870.00
负债合计	191,679,153.30	37,903,627.95
所有者权益:		
实收基金	21,275,937,282.06	25,013,103,204.20
未分配利润	2,586,578,344.03	-8,474,244,078.00
所有者权益合计	23,862,515,626.09	16,538,859,126.20
负债和所有者权益总计	24,054,194,779.39	16,576,762,754.15

注:报告截止日2009年12月31日,基金份额净值1.1216元,基金份额总额21,275,937,282.06份。

7.2 利润表

会计主体:诺安股票证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
一、收入	11,638,266,610.39	-19,924,944,447.13
1.利息收入	25,265,834.63	62,815,692.53
其中:存款利息收入	25,259,204.33	59,913,296.41
债券利息收入	6,630.30	11,440.12
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	2,890,956.00
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-205,455,067.20	-4,462,991,024.61
其中:股票投资收益	-398,254,794.74	-4,337,998,483.84
债券投资收益	1,608,506.58	27,353.48
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-323,506,348.23
股利收益	191,191,220.96	198,486,453.98
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	11,812,458,651.96	-15,536,431,554.87
4.其他收入(损失以"-"号填列)	5,997,191.00	11,662,439.82
减:二、费用	440,282,283.60	502,339,469.56
1.管理人报酬	330,941,227.33	378,009,276.50
2.托管费	55,156,871.11	63,001,546.13
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	53,763,574.47	60,903,400.27
5.利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6.其他费用	420,610.69	425,246.66
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	11,197,984,326.79	-20,427,283,916.69

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:诺安股票证券投资基金

本报告期:2009年1月1日至2009年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 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)	25,013,103,204.20	-8,474,244,078.00	16,538,859,126.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,197,984,326.79	11,197,984,326.79
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)	-3,737,165,922.14	-137,161,904.76	-3,874,327,826.90
其中:1.基金申购款	2,365,537,205.17	-54,462,731.12	2,311,074,474.05
2.基金赎回款	-6,102,703,127.31	-82,699,173.64	-6,185,402,300.95
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)	21,275,937,282.06	2,586,578,344.03	23,862,515,626.09
项目	**上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日**		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	29,232,318,526.44	12,202,990,741.00	41,435,309,267.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-20,427,283,916.69	-20,427,283,916.69
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)	-4,219,215,322.24	-249,950,902.31	-4,469,166,224.55
其中:1.基金申购款	4,089,921,560.79	655,996,747.85	4,745,918,308.64
2.基金赎回款	-8,309,136,883.03	-905,947,650.16	-9,215,084,533.19
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)	25,013,103,204.20	-8,474,244,078.00	16,538,859,126.20

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:

奥成文 薛有为 薛有为

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

7.4.1.1 会计政策变更的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.2 会计估计变更的说明

根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》有关规定,本基金自2008年9月16日起采用《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法对本基金持有的长期停牌股票进行估值。因上述估值事项而进行的会计估计变更,本基金采用未来适用法进行核算。

本基金所持有的股票济南钢铁(600022)自2009年11月17日起,采用指数收益法进行估值,此项会计估计变更对本基金当日净利润和资产净值的影响为增加人民币3,422,786.49元。对本年度净利润和资产净值的影响为增加5,197,564.67元。

本基金所持有的股票莱钢股份(600102)自2009年11月23日起,采用指数收益法进行估值,此项会计估计变更对本基金当日净利润和资产净值的影响为增加人民币1,307,936.16元。对本年度净利润和资产净值的影响为增加1,198,941.48元。

7.4.2 差错更正的说明

本基金本报告期无差错更正。

7.4.3 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国对外经济贸易信托有限公司	管理人股东
深圳市捷隆投资有限公司	管理人股东
北京中关村科学城建设股份有限公司	管理人股东
诺安基金管理有限公司	发起人、管理人
中国工商银行股份有限公司	托管人
中国中化集团公司	管理人股东母公司

7.4.4 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.4.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.4.1.1 股票交易

本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.4.1.2 权证交易

本基金本报告期及其上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.4.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及其上年度可比期间不存在应支付关联方的佣金。

7.4.4.2 关联方报酬

7.4.4.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	330,941,227.33	378,009,276.50
其中:支付给销售机构的客户维护费	50,720,326.69	86,006,549.74

注:A. 基金管理费按前一日的基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如下:

H=E×1.5%/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

B. 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.4.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	55,156,871.11	63,001,546.13

注:A. 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×0.25%/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

B. 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月底,按月支付;由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.4.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本期与基金托管人无银行间同业市场的债券(含回购)交易。(上年度可比期间与基金托管人无银行间同业市场的债券(含回购)交易。)

7.4.4.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.4.4.1 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 2009年1月1日至2009年12月31日	上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日
基金合同生效日(2005年12月19日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	149,317,687.04	149,317,687.04
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动的份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	149,317,687.04	149,317,687.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例(%)	0.70	0.60

注:基金管理人运用固有资金投资本基金相关费率按照基金合同规定执行。

7.4.4.4.2 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

份额单位:份

关联方名称	本期末 2009年12月31日		上年度末 2008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(%)
中国中化集团公司	-	-	184,236,997.79	0.74
深圳市捷隆投资有限公司	-	-	12,900,000.00	0.05

注:投资本基金费率按照本基金合同的规定执行。

7.4.4.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2009年1月1日至2009年12月31日		上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	2,401,748,269.79	25,045,514.29	5,676,566,625.97	59,687,971.71

7.4.4.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内无参与关联方承销证券的情况。

7.4.4.7 其它关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项。

7.4.5 期末(2009年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.5.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.5.1.1 受限证券类别:股票									
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
601117	中国化学	2009-12-29	2010-01-07	新发流通受限	5.43	5.43	14,000	76,020.00	76,020.00	-
601139	深圳燃气	2009-12-15	2010-03-25	新发流通受限	6.95	16.78	113,609	789,582.55	1,906,359.02	-
601299	中国北车	2009-12-23	2010-03-29	新发流通受限	5.56	6.13	3,218,544	17,895,104.64	19,729,674.72	-
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	新发流通受限	11.78	20.94	131,060	1,543,886.80	2,744,396.40	-
600229	青岛碱业	2009-06-19	2010-06-20	非公开增发流通受限	4.84	6.02	10,000,000	48,400,000.00	60,200,000.00	-
002320	海峡股份	2009-12-09	2010-03-16	新发流通受限	33.60	51.18	52,529	1,764,974.40	2,688,434.22	-
002329	皇氏乳业	2009-12-25	2010-01-06	新发流通受限	20.10	20.10	500	10,050.00	10,050.00	-
002330	得利斯	2009-12-25	2010-01-06	新发流通受限	13.18	13.18	500	6,590.00	6,590.00	-
002332	仙琚制药	2009-12-30	2010-01-12	新发流通受限	8.20	8.20	500	4,100.00	4,100.00	-
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-01-08	新发流通受限	28.99	28.99	500	14,495.00	14,495.00	-
300040	九洲电气	2009-12-28	2010-01-08	新发流通受限	33.00	33.00	500	16,500.00	16,500.00	-
300042	朗科科技	2009-12-28	2010-01-08	新发流通受限	39.00	39.00	500	19,500.00	19,500.00	-

注:①可流通日以公告为准。

②本基金本报告期未不存在因认购新发或增发而于期末持有的流通受限债券和权证。

7.4.5.2 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
600100	同方股份	2009-12-29	重大资产重组	18.73	2010-01-04	18.70	13,758,323	237,120,136.74	257,693,389.79	-
600739	辽宁成大	2009-12-28	重大事项	38.09	2010-01-11	41.90	11,322,019	557,544,501.84	431,255,703.71	-
000159	国际实业	2009-12-10	重大资产重组	18.77	2010-01-08	20.00	952,700	17,587,368.84	17,882,179.00	-
000623	吉林敖东	2009-12-28	重大事项	49.19	2010-01-11	54.11	309,959	15,389,825.98	15,246,883.21	-
600022	济南钢铁	2009-11-09	重大资产重组	5.68	2010-02-24	5.00	12,676,987	66,314,570.26	72,005,286.16	-
600102	莱钢股份	2009-11-09	重大资产重组	14.06	2010-02-24	11.88	1,211,052	20,764,248.46	17,027,391.12	-

注:济南钢铁(600022)自2009年11月17日起、莱钢股份(600102)自2009年11月23日起采用指数收益法进行估值。

7.4.5.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2009年12月31日止,本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为0.00元,无债券作为抵押。

7.4.5.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年12月31日止,本基金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0.00元。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。

§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	21,576,765,064.95	89.70
	其中:股票	21,576,765,064.95	89.70
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	2,421,839,741.94	10.07
6	其他各项资产	55,589,972.50	0.23
7	合计	24,054,194,779.39	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	84,030,015.12	0.35
B	采掘业	2,576,392,104.37	10.80
C	制造业	7,755,775,382.09	32.50
C0	食品、饮料	2,043,533,146.10	8.56
C1	纺织、服装、皮毛	113,620,324.23	0.48
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	167,762,423.84	0.70
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,507,245,085.21	6.32
C5	电子	23,923,864.55	0.10
C6	金属、非金属	1,816,229,497.65	7.61
C7	机械、设备、仪表	1,598,422,613.33	6.70
C8	医药、生物制品	464,359,163.44	1.95
C99	其他制造业	20,679,263.74	0.09
D	电力、煤气及水的生产和供应业	282,708,636.97	1.18
E	建筑业	1,150,796,734.72	4.82
F	交通运输、仓储业	707,624,994.10	2.97
G	信息技术业	652,477,232.29	2.73
H	批发和零售贸易	862,969,927.65	3.62
I	金融、保险业	6,332,123,777.94	26.54
J	房地产业	793,753,078.68	3.33
K	社会服务业	177,356,207.73	0.74
L	传播与文化产业	79,576,495.11	0.33
M	综合类	121,180,478.18	0.51
	合计	21,576,765,064.95	90.42

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	601939	建设银行	182,543,936	1,129,946,963.84	4.74
2	600519	贵州茅台	6,529,172	1,108,783,989.04	4.65
3	601390	中国中铁	153,064,115	964,303,924.50	4.04
4	600036	招商银行	51,403,276	927,829,131.80	3.89
5	600547	山东黄金	9,898,425	794,843,527.50	3.33
6	601601	中国太保	30,449,238	780,109,477.56	3.27
7	601318	中国平安	12,571,231	692,549,115.79	2.90
8	600309	烟台万华	27,580,918	662,217,841.18	2.78
9	601628	中国人寿	20,475,516	648,869,102.04	2.72
10	000402	金融街	51,917,481	629,759,044.53	2.64

提示: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.lionfund.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	601390	中国中铁	1,035,323,991.02	6.26
2	600030	中信证券	825,992,280.32	4.99
3	601939	建设银行	727,920,692.94	4.40
4	601857	中国石油	720,128,370.40	4.35
5	601601	中国太保	600,551,794.73	3.63
6	600050	中国联通	596,791,889.03	3.61
7	600519	贵州茅台	570,440,093.33	3.45
8	600309	烟台万华	487,233,491.75	2.95
9	600019	宝钢股份	433,376,046.97	2.62
10