天弘精选混合型证券投资基金 2009年年度报告摘要

2009年12月31日

基金管理人：天弘基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一〇年三月三十一日

§1 重要提示及目录

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一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2009年1月1日起至2009年12月31日止。

1.2 目录

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘精选混合
基金主代码	420001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年10月8日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
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	5,827,494,230.54份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	以资产配置为导向，在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择，在控制风险的前提下追求基金财产的长期稳健增值
投资策略	在资产配置层次上，本基金以资产配置为导向，力图通过对股票、债券和短期金融工具进行灵活资产配置，在控制风险基础上，获取收益；在行业配置层次上，根据各个行业的景气程度，进行行业资产配置；在股票选择上，本基金将挖掘行业龙头，投资于有投资价值的行业龙头企业；本基金债券投资坚持以人期管理和主性分析为核心，以稳健的主动投资为主导，选取价值被低估的券种，以获得更高的收益
业绩比较基准	上证180指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型基金，其长期平均风险程度低于股票型基金，高于货币市场型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳定增长

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		天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕传红	蒋松云
	联系电话	022-83865568	010-66105799
	电子邮箱	lvchh@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		022-83310988，4007109999	95588
传真		022-83865569	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.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据及财务指标

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	722,578,458.07	-3,298,971,784.54	-181,629,142.79
本期利润	1,044,781,447.51	-3,278,477,077.40	-313,980,122.68
加权平均基金份额本期利润	0.1673	-0.4769	-0.2162
本期基金份额净值增长率	34.85%	-50.30%	93.62%
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	-0.0917	-0.2058	0.2720
期末基金资产净值	3,634,812,121.67	3,061,777,943.39	5,996,471,302.85
期末基金份额净值	0.6237	0.4625	0.9305

注：1、所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等）。

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、期末可供分配利润为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	14.06%	1.47%	9.86%	0.97%	4.20%	0.50%
过去六个月	2.21%	2.06%	6.42%	1.17%	-4.21%	0.89%
过去一年	34.85%	1.87%	45.55%	1.13%	-10.70%	0.74%
过去三年	29.78%	2.00%	44.53%	1.39%	-14.75%	0.61%
自基金合同生效起至今	95.09%	1.76%	126.89%	1.24%	-31.80%	0.52%

注：天弘精选混合基金业绩比较基准：上证180指数收益率*55%+上证国债指数收益率*45%。上证180指数和上证国债指数由上海证券交易所编制发布，分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况，具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是30%-85%，债券和短期金融工具的投资比例范围是15%-70%，分别参考上述投资比例范围的中值，确定本基金业绩比较基准中，上证180指数占55%，上证国债指数占45%。

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

天弘精选混合基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

（2005年10月8日至2009年12月31日）

注：本基金合同于2005年10月8日生效。基金合同生效当年2005年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算。

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
2007年	2.600	20,071,268.73	11,225,347.43	31,296,616.16	无
合计	2.600	20,071,268.73	11,225,347.43	31,296,616.16	无

§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

天弘基金管理有限公司经中国证监会证监基金字［2004］164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为1亿元人民币，总部设在天津，在北京设有分公司，公司股东为天津信托有限责任公司（持股比例48%）、兵器财务有限责任公司（持股比例26%）、内蒙古君正能源化工股份有限公司（持股比例26%）。本基金管理人目前管理四只开放式基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金。

4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

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		
吕宜振	本基金基金经理；天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理；基金管理人投资总监。	2009年3月	—	9年	男，工学博士。历任易方达基金管理有限公司研究主管；信诚基金管理有限公司研究总监；信诚精粹成长股票型证券投资基金基金经理。2008年10月起担任天弘基金管理有限公司投资总监。
徐正国	本基金基金经理。	2009年3月	—	6年	男，管理学硕士，2004年加盟天弘基金管理有限公司。历任天弘基金管理有限公司交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。
许利明	本基金基金经理；基金管理人投资部副总经理。	2007年7月	2009年3月	10年	男，经济学硕士，历任北京国际信托投资公司投资银行总部固话经理；湘财证券有限责任公司资产管理总部总经理助理；北京鹏苑天网投资顾问公司首席投资顾问。2007年6月加盟天弘基金管理有限公司，历任投资部研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、上述任职日期、离任日期均为本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对投资期内公平交易情况的说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司制定并执行了公平交易管理办法。公平交易管理办法的范围包括各类投资组合、开放式基金、封闭式基金、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动。

公平交易的执行情况包括：公平对待不同投资组合，严禁进行以各投资组合之间利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行投权审批程序；建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；实行集中交易制度和公平的交易分配制度；加强对投资交易行为的监察稽核力度等。

本报告期内，基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。

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

本基金管理人旗下没有与天弘精选混合型证券投资基金投资风格相似的基金。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生异常交易。

4.4 管理人对投资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

2009年，为了应对百年一遇的金融危机、全球都不同程度的财政和货币政策应对。中国在财政政策上推出了4万亿的“铁公机”基础设施建设计划，同时放松货币政策，全年放款新增近10万亿，中国经济率先复苏。全球经济在以中国为首的“金砖四国”引擎的带动下也从谷底开始转向复苏。

回顾全年，证券市场超出预期出现“V”型反转，机会主要在于：①）随着4万亿的推出，年初投资机会主要是工程机械和水泥；②）随着地产和汽车耐用品销售的复苏，地产、汽车出现大的投资机会，同时周期品煤炭有色金属也出现估值修复行情；③）在地产和基建带动下，钢铁行业也现阶段性投资机会；④）下半年在货币政策微调的放大效应下，周期性行业出现大幅调整，而消费和医药由于对中国经济结构转型的预期而出现一波较大的投资机会。

2009年，本基金立足于宏观分析，通过资产配置来获取超额收益。由于判断宏观经济能够在宽松的货币政策带动下进入强劲复苏阶段，对证券市场保持相对乐观态度，采取了高仓位的策略，并积极通过行业轮动的配置方法捕住市场的投资机会，在行业配置上由2008年底的防御性行业向进攻性行业转换。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2009年12月31日，本基金份额净值为0.6237元，本报告期份额净值增长率34.85%，同期业绩比较基准增长率45.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

全球宏观经济已经进入复苏通道，但是发达国家由于结构性（去杠杆化和储蓄率上升）的问题，将在较长时间保持在低位态势，而中国今年需要消化去年过度宽松政策的负面效应，所以在这种状况下股市的估值水平很难出现大的抬升，估值过高的周期性行业甚至还有估值重心下移的风险，而市场可以依靠的驱动因素只有业绩增长。同时中国的经济结构面临转型，新兴产业具有较大的发展机遇。在这种市场状况下，精选个股对超额收益的贡献就尤为重要，本基金将努力通过个股挑选争取为基金持有人创造超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方法包括本基金托管银行和会计师事务所，托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§5 托管人报告

5.1 报告期内基金托管人遵规守信情况声明

2009年，本基金托管人在对天弘精选混合型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

2009年，天弘精选混合型证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘精选混合型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，天弘精选混合型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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘精选混合型证券投资基金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

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所有限公司审计，该所出具了“无保留意见的审计报告”，且在审计报告中无强调事项。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：天弘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2009年12月31日

单位：人民币元

资 产：	附注号	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	7.4.7.1	641,352,525.32	178,915,222.65
结算备付金		16,155,239.70	8,586,487.94
存出保证金		9,037,551.41	1,944,795.81
交易性金融资产	7.4.7.2	3,360,216,077.18	2,925,650,317.38
其中：股票投资		2,828,847,077.18	1,973,921,317.38
基金投资		-	-
债券投资		531,369,000.00	951,729,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	4,997,681.97	15,141,181.46
应收股利		-	-
应收申购款		54,612.15	162,923.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	24,657.96	-
资产总计		4,031,838,345.69	3,130,400,928.83
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		378,599,232.10	-
应付证券清算款		-	58,647,691.35
应付赎回款		3,774,284.59	956,243.92
应付管理人报酬		4,645,958.60	3,987,026.98
应付托管费		774,326.42	664,504.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	7,562,125.65	3,415,339.31
应交税费		574,800.00	-
应付利息		57,487.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	1,038,009.52	952,179.38
负债合计		397,026,224.02	68,622,985.44
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,598,382,815.21	2,951,829,587.65
未分配利润	7.4.7.10	1,036,429,306.46	109,948,355.74
所有者权益合计		3,634,812,121.67	3,061,777,943.39
负债和所有者权益总计		4,031,838,345.69	3,130,400,928.83

注：报告截止日2009年12月31日，基金份额净值0.6237元，基金份额总额5，827，494，230.54份。

7.2 利润表

会计主体：天弘精选混合型证券投资基金

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	附注号	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		1,178,180,373.73	-3,159,844,627.28
1. 利息收入		20,792,498.79	34,589,394.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,384,944.22	3,831,741.24
债券利息收入		19,378,429.59	30,495,554.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		29,124.98	262,098.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		834,862,934.47	-3,215,748,070.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	807,526,225.47	-3,246,746,930.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	8,425,425.49	2,942,093.53
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	394,556.73
股利收益	7.4.7.15	18,911,283.51	27,662,209.63
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	322,202,989.44	20,494,707.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	321,951.03	819,341.44
减：二、费用		133,398,926.22	118,632,450.12
1. 管理人报酬		53,531,304.72	64,304,507.13
2. 托管费		8,921,884.14	10,717,417.82
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	69,073,593.00	36,149,459.71
5. 利息支出		1,445,213.45	7,113,693.16
其中：卖出回购金融资产支出		1,445,213.45	7,113,693.16
6. 其他费用	7.4.7.19	426,930.91	347,372.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,044,781,447.51	-3,278,477,077.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（亏损以“-”号填列）		1,044,781,447.51	-3,278,477,077.40

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘精选混合型证券投资基金

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）	2,951,829,587.65	109,948,355.74	3,061,777,943.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,044,781,447.51	1,044,781,447.51
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）	-353,446,772.44	-118,300,496.79	-471,747,269.23
其中：1.基金申购款	51,504,816.91	16,530,494.72	68,035,311.63
2.基金赎回款	-404,951,589.35	-134,830,991.51	-539,782,580.86
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）	2,598,382,815.21	1,036,429,306.46	3,634,812,121.67

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）	2,873,413,702.96	3,123,057,599.89	5,996,471,302.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,278,477,077.40	-3,278,477,077.40
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）	78,415,884.69	265,367,833.25	343,783,717.94
其中：1.基金申购款	546,070,794.66	501,170,472.13	1,047,241,266.79
2.基金赎回款	-467,654,909.97	-235,802,638.88	-703,457,548.85
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）	2,951,829,587.65	109,948,355.74	3,061,777,943.39

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：

胡 敏 胡 敏 田 中 甲

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
兵器财务有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易（2008年；同）。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 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	53,531,304.72	64,304,507.13
其中：支付销售机构的客户维护费	9,656,650.60	11,455,344.38

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%／当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.3.2.2 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	8,921,884.14	10,717,417.82

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.25%／当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（包回购）交易

单位：人民币元

本期 2009年1月1日至2009年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	85,355,662.88	-	-	351,200,000.00	42,284.06

上年度可比期间 2008年1月1日至2008年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	98,216,569.34	-	-	-	-	-

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 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
期初持有的基金份额	-	61,972,843.65
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	-	61,972,843.65
期末持有的基金份额	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1、基金管理人天弘基金管理有限公司在2008年度赎回本基金的交易委托渤海证券办理，其申募集期间获得的份额赎回时适用费率为0.00%，2007年度获得的份额赎回时适用费率为0.25%。

2、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.3.4.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额（2008年；同）。

7.4.3.5 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	641,352,525.32	1,156,881.99	178,915,222.65	3,696,104.46

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在本销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未通过关联方购买其承销期内的证券（2008年；同）。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项（2008年；同）。

7.4.4 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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

7.4.4.1.1 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（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601117	中国化学	09/12/29	1001/07	新股网上申购	5.43	5.43	13,000	70,590.00	70,590.00	
601299	中国北车	09/12/23	10/03/29	新股网下申购	5.56	6.13	756,358	4,205,350.48	4,636,474.54	
002299	圣农发展	09/10/13	10/01/21	新股网下申购	19.75	25.03	64,239	1,268,720.25	1,607,902.17	
002306	湘鄂情	09/11/05	10/02/09	新股网下申购	18.90	33.36	46,639	881,477.10	1,555,877.04	
002315	焦点科技	09/12/01	10/03/09	新股网下申购	42.00	69.18	21,354	896,868.00	1,477,269.72	
002317	众生药业	09/12/03	10/03/11	新股网下申购	55.00	70.77	21,426	1,178,430.00	1,516,318.02	
002322	理工监测	09/12/11	10/03/18	新股网下申购	40.00	61.88	14,995	599,800.00	927,890.60	
002324	普利特	09/12/11	10/03/18	新股网下申购	22.50	34.62	42,716	961,110.00	1,478,827.92	
002332	仙琚制药	09/12/30	10/01/12	新股网下申购	8.20	8.20	500	4,100.00	4,100.00	
300012	华测检测	09/10/15	10/02/01	新股网下申购	25.78	43.14	9,482	244,445.96	409,053.48	
300017	网宿科技	09/10/15	10/02/01	新股网下申购	24.00	42.71	16,323	391,752.00	697,155.33	
300021	大禹节水	09/10/19	10/02/03	新股网下申购	14.00	41.20	110,204	1,542,856.00	4,540,404.80	
300036	超图软件	09/12/18	10/03/25	新股网下申购	19.60	38.31	24,330	476,868.00	932,082.30	

7.4.4.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
122042	09金丰债	09/12/30	1001/27	新债网下申购	100.00	100.00	300,000	30,000,000.00	30,000,000.00	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.4.2 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
600739	辽宁成大	09/12/28	公告重大事项	38.09	10/01/11	41.90	1,999,868	78,523,201.94	76,174,972.12	

注：本基金截至2009年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.4.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.3.1 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378，599，232.10元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
070228	07国开28	2010-1-8	101.15	300,000	30,345,000.00
080413	08农发13	2010-1-8	100.73	1,000,000	100,730,000.00
090404	09农发04	2010-1-8	99.89	500,000	49,945,000.00
090407	09农发07	2010-1-8	100.10	100,000	10,010,000.00
0801044	08央行票据44	2010-1-8	102.88	500,000	51,440,000.00
0901038	09央行票据38	2010-1-8	98.28	600,000	58,968,000.00
0901044	09央行票据44	2010-1-8	98.25	900,000	88,425,000.00
合计				3,900,000	389,863,000.00

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2009年12月31日止，本基金未发生从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

§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	2,828,847,077.18	70.16
	其中：股票	2,828,847,077.18	70.16
2	固定收益投资	531,369,000.00	13.18
	其中：债券	531,369,000.00	13.18
	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	657,507,765.02	16.31
6	其他各项资产	14,114,503.49	0.35
7	合计	4,031,838,345.69	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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	58,987,902.17	1.62
B	采掘业	-	-
C	制造业	1,509,527,332.34	41.53
C0	食品、饮料	160,473,370.32	4.41
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	344,028,263.03	9.46
C5	电子	116,869,818.55	3.22
C6	金属、非金属	330,409,144.30	9.09
C7	机械、设备、仪表	450,303,160.70	12.39
C8	医药、生物制品	107,443,575.44	2.96
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	87,388,650.31	2.40
G	信息技术业	86,838,846.71	2.39
H	批发和零售贸易	303,321,854.62	8.34
I	金融、保险业	549,088,766.21	15.11
J	房地产业	75,291,347.88	2.07
K	社会服务业	31,485,520.52	0.87
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	126,916,856.42	3.49
	合计	2,828,847,077.18	77.83

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600809	山西汾酒	3,738,024	160,473,370.32	4.41
2	600036	招商银行	8,000,000	144,400,000.00	3.97
3	601169	北京银行	6,000,000	116,040,000.00	3.19
4