国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）2010年年度报告摘要

2010年12月31日

基金管理人：国泰基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一一年三月二十六日

§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21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。

本报告的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所有限公司为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

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	国泰中小盘成长股票（LOF）
基金主代码	160211
交易代码	160211
基金运作方式	上市契约型开放式
基金合同生效日	2009年10月19日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
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	1,408,987,747.19份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年1月7日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票。在有效控制风险的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金的大类资产配置主要通过对宏观经济发展趋势的预测分析，评价未来一段时间股票、债券市场相对收益率、主动调整股票、债券及现金类资产的配置比例。其中，股票资产投资主要以具有较好的成长性和基本面良好的中小盘股票为投资对象，采取自下而上、三重过滤的精选个股策略。
业绩比较基准	本基金的业绩基准=35%×天相中盘成长指数+45%×天相小盘成长指数+20%×中证全债指数
风险收益特征	本基金是股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于具有良好成长性的上市公司，属于高风险的证券投资基金品种。

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		国泰基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李峰	尹东
	联系电话	021-38561600转	010-67595003
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	yindong@ccb.cn
客户服务电话		021 38569000,400-888-8688	010-67595096
传真		021-38561800	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	http://www.gtfund.com
基金年度报告备置地点	上海市世纪大道100号上海环球金融中心39楼 北京市西城区阜市口大街1号院1号楼

§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10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日
本期已实现收益	166,755,855.92	3,313,410.58
本期利润	227,313,645.20	108,394,876.71
加权平均基金份额本期利润	0.0729	0.0386
本期基金份额净值增长率	8.20%	9.84%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配基金份额利润	0.1108	0.0142
期末基金资产净值	1,543,224,550.67	5,172,690,478.54
期末基金份额净值	1.095	1.012

注：(1)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；

(2)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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	5.09%	1.80%	6.66%	1.53%	-1.57%	0.27%
过去六个月	27.18%	1.52%	29.22%	1.37%	-2.04%	0.15%
过去一年	8.20%	1.34%	8.44%	1.38%	-0.24%	-0.04%
自基金合同生效起至今	18.85%	1.24%	21.49%	1.39%	-2.64%	-0.15%

3.2.2 自基金转型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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2009年10月19日至2010年12月31日）

注：本基金的转型日为2009年10月19日。本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金转型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

国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

自基金转型以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

注：2009年图示的指标计算期间为基金转型日2009年10月19日至2009年12月31日。

3.3 自基金转型以来基金的利润分配情况

本基金自转型日（2009年10月19日）至2010年12月31日，未进行利润分配。

§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

国泰基金管理有限公司成立于1998年3月5日，是经中国证监会证监基字［1998］5号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为1.1亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至2010年12月31日，本基金管理人共管理3只封闭式证券投资基金：金泰证券投资基金、金鑫证券投资基金、国泰估值优势可分离交易股票型证券投资基金（创新型封闭式基金），以及14只开放式证券投资基金：国泰金鹰增长证券投资基金、国泰金龙系列证券投资基金（包括2只子基金，分别为国泰金龙行业精选证券投资基金、国泰金龙债券证券投资基金）、国泰金马稳健回报证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、国泰金鹿保本增值混合证券投资基金、国泰金鹏蓝筹价值混合型证券投资基金、国泰金鼎价值精选混合型证券投资基金（由金鼎证券投资基金转型而来）、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、国泰沪深300指数证券投资基金（由国泰金象保本增值混合证券投资基金转型而来）、国泰双利债券证券投资基金、国泰区位优势股票型证券投资基金、国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）（由金盛证券投资基金转型而来）、国泰纳斯达克100指数证券投资基金、国泰价值经典股票型证券投资基金（LOF）。另外，本基金管理人于2004年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007年11月19日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008年2月14日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于3月24日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，成为目前业内少数拥有"全牌照"的基金公司之一，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和QDII等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
张玮	本基金的基金经理、国泰金鹰增长股票的基金经理	2009-10-19	-	10	硕士研究生。2000年11月至2004年6月就职于中银万国证券研究所，任行业研究员。2004年7月至2007年3月就职于银河基金管理有限公司，历任高级研究员、基金经理。2007年3月加入国泰基金管理有限公司，任国泰金鹰增长股票的基金经理助理，2008年5月起担任国泰金鹰增长股票的基金经理，2009年4月至2009年10月兼任国泰金鑫封闭的基金经理，2009年10月起兼任国泰中小盘成长股票的基金经理。2010年7月任研究部副总监。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金未发生损害基金份额持有人利益的行为，投资运作符合法律法规和基金合同的规定，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人所管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

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

本基金与本基金管理人管理的国泰金鹰增长股票、国泰区位优势股票、国泰金牛创新股票、国泰价值经典股票均为股票型基金。其中，本基金与国泰金鹰增长股票的业绩表现差异为2.87%，主要由于资产配置差异所致；本基金与国泰区位优势股票的业绩表现差异为5.50%，主要由于行业配置差异所致；本基金与国泰金牛创新股票的业绩表现差异为7.86%，主要由于行业配置差异所致；鉴于国泰价值经典股票运作期不满一年，不适合与本基金进行比较。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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年中国政府继续实行积极的财政政策和适度宽松的货币政策，国内经济延续了复苏势头，经济增长表现出较强的"韧性"，但下半年通胀压力逐渐显现。A股市场则呈现出结构分化的突出特征，上证指数和沪深300指数跌幅均超过10%，在全球股市中排名落后，但中小板指数涨幅超过20%，在全球市场中并不逊色（特别是在该指数2009年已经取得113%涨幅的情况下）。中小市值股票与大市值股票估值差不断创出历史新高，强烈体现了投资人对消费品、战略新兴产业等的青睐和对投资品、周期性行业的担心。

出于对经济复苏的谨慎判断和中小盘股票估值风险的担忧，本基金资产配置并不激进，股票仓位中等水平。基于对内需消费领域的看好，我们重点配置了食品饮料、医药、家电、传播文化等泛消费品行业，基于估值安全与成长性的综合考虑，还重点配置了机械、建筑建材、化工等投资品行业，减配了金融、房地产等行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金2010年度净值增长率为8.2%，同期业绩比较基准为8.44%。

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2011年，虽然货币政策已由"适度宽松"转为"稳健"，但并不至于过度紧缩，经济恢复性增长的势头不会逆转，如果通胀压力得到合理控制，我们对国内经济的稳健增长仍充满信心。目前A股市场整体估值水平处于历史低位，相对海外市场也不高，全年来看可能呈现震荡攀升的走势。未来市场结构变化更值得关注，在均值回归的规律下，中小盘股票估值风险释放和大盘股估值修复，可能是一定时期市场风格的主要特征。

作为投资中小盘股票为主的基金，虽然对估值风险的担心一定程度上影响了我们2010年的业绩表现，但也为我们2011年的投资回报提供了安全边际。2011年我们将重点布局三条投资主线：一是渐显国际竞争力的行业龙头企业；二是受益内需消费、战略新兴产业和节能减排等经济结构调整方向的行业；三是受益通胀及要素价格市场化的资源品等行业。在中小盘股票估值风险的释放过程中，我们将择机加大对其中优质成长股的中长线布局。在追求收益的同时，更加注重风险评估和风险控制，为持有人创造稳健良好的中长期业绩回报将是我们不变的目标。

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，本基金管理人按照相关法律法规规定，成立了估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由普华永道会计师事务所进行审核并出具报告，由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营副总经理负责，成员包括基金核算、金融工程、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

§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，发现个别监督指标受市场影响被动超出监督比例，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

本基金2010年年度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，注册会计师签字出具了无保留意见的审计报告。投资者可通过登载于本管理人网站的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：国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

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	110,819,794.34	2,021,471,976.97
结算备付金	404,689.98	12,049,770.84
存出保证金	890,741.00	422,304.52
交易性金融资产	1,442,046,879.64	2,326,540,730.30
其中：股票投资	1,369,146,879.64	2,235,271,730.30
基金投资	-	-
债券投资	72,900,000.00	91,269,000.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	2,405,800,000.00
应收证券清算款	15,134,246.93	134,275.35
应收利息	1,058,371.86	1,237,725.56
应收股利	-	-
应收申购款	485,551.43	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	8,183.80
资产总计	1,570,840,275.18	6,767,664,967.34
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	2,073,028.72	1,584,740,044.71
应付赎回款	21,088,399.48	-
应付管理人报酬	2,068,584.34	6,506,160.58
应付托管费	344,764.06	1,084,360.11
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,023,159.49	1,671,617.74
应交税费	287,030.48	287,030.48
应付利息	-	-
应付利润	279,108.68	283,104.68
递延所得税负债	-	-
其他负债	451,649.26	402,170.50
负债合计	27,615,724.51	1,594,974,488.80
所有者权益：		
实收基金	1,180,170,451.86	4,281,385,316.74
未分配利润	363,054,098.81	891,305,161.80
所有者权益合计	1,543,224,550.67	5,172,690,478.54
负债和所有者权益总计	1,570,840,275.18	6,767,664,967.34

注：1. 报告截止日2010年12月31日，基金份额净值1.095元，基金份额总额1,408,987,747.19份。

2. 比较财务报表的实际编制期间为2009年10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

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10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日
一、收入	290,472,604.76	120,674,425.48
1.利息收入	10,228,035.71	3,544,046.03
其中：存款利息收入	3,228,821.53	2,143,714.91
债券利息收入	3,953,163.70	667,341.08
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	3,046,050.48	732,990.04
其他利息收入	-	-
2.投资收益（损失以"-"填列）	214,495,754.92	12,038,108.01
其中：股票投资收益	199,142,521.81	12,365,074.01
基金投资收益	-	-
债券投资收益	115,754.16	-353,750.00
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	15,237,478.95	26,784.00
3.公允价值变动收益（损失以"-"号填列）	60,557,789.28	105,081,466.13
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）	-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	5,191,024.85	10,805.31
减：二、费用	63,158,959.56	12,279,548.77
1.管理人报酬	46,827,016.03	8,629,071.90
2.托管费	7,804,502.60	1,438,178.68
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	7,926,416.64	2,042,633.19
5.利息支出	54,564.65	1,552.88
其中：卖出回购金融资产支出	54,564.65	1,552.88
6.其他费用	546,459.64	168,112.12
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）	227,313,645.20	108,394,876.71
减：所得税费用	-	-
四、净利润（亏损以"-"号填列）	227,313,645.20	108,394,876.71

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国泰中小盘成长股票型证券投资基金（LOF）

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）	4,281,385,316.74	891,305,161.80	5,172,690,478.54
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	227,313,645.20	227,313,645.20
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）	-3,101,214,864.88	-755,564,708.19	-3,856,779,573.07
其中：1.基金申购款	242,234,499.39	53,757,735.94	295,992,235.33
2.基金赎回款	-3,343,449,364.27	-809,322,444.13	-4,152,771,808.40
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）	1,180,170,451.86	363,054,098.81	1,543,224,550.67
项目	上年度可比期间 2009年10月19日（基金合同生效日）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）	500,000,000.00	49,926,313.74	549,926,313.74
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	108,394,876.71	108,394,876.71
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）	3,781,385,316.74	732,983,971.35	4,514,369,288.09
其中：1.基金申购款	3,781,385,316.74	732,983,971.35	4,514,369,288.09
2.基金赎回款	-	-	-
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）	4,281,385,316.74	891,305,161.80	5,172,690,478.54

报告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：

基金管理公司负责人：金旭，主管会计工作负责人：巴立康，会计机构负责人：王骏

7.4 报表附注

7.4.1 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.1.3 差错更正的说明

本基金本报告期不存在重大会计差错。

7.4.2 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（"中国建设银行"）	基金托管人、基金代销机构
中国建银投资有限责任公司（"中国建投"）	基金管理人的控股股东
中国电力财务有限公司（"中电财务"）	基金管理人的股东
万联证券有限责任公司	基金代销机构、基金管理人的原股东（2010年6月21日以前）
中国国际金融有限公司（"中金公司"）	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司
中信建投证券有限责任公司（"中信建投"）	基金代销机构、受中国建投重大影响的公司
意大利忠利集团（Assicurazioni Generali S.p.A.）	基金管理人的股东（自2010年6月21日起）

注：根据国泰基金管理有限公司于2010年6月21日发布的公告，经公司股东会审议通过，并报经中国证监会证监许可［2009］1163号文批准，公司股东中国建银投资有限责任公司、原股东万联证券有限责任公司将其所持有的国泰基金管理有限公司合计30%的股权转让给意大利忠利集团。

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

7.4.3.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.3.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.3.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	46,827,016.03	8,629,071.90
其中：支付销售机构的客户维护费	10,604,310.91	1,349,236.70

注：支付基金管理人国泰基金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。

7.4.3.2.2 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10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,804,502.60	1,438,178.68

注：支付基金托管人中国建设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（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.3.4 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 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日
基金合同生效日（2009年10月19日）持有的基金份额	-	22,267,084.00
期初持有的基金份额	56,611,737.00	-
期间申购/买入总份额	-	30,028,400.00
期间因拆分变动份额	-	4,316,253.00
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	56,611,737.00	56,611,737.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.02%	1.11%

注：关联方投资本基金的费率是公允的，均遵照本基金公告的费率执行。

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

份额单位：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
中电财务	-	-	10,000,400.00	0.20%

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年10月19日（基金合同生效日）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
中国建设银行	110,819,794.34	2,898,656.64	2,021,471,976.97	2,130,345.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.3.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中金公司	600036	招商银行	配股	1,283,078	11,355,240.30
中信建投	002405	四维图新	新股网下发行	42,399	1,085,414.40
上年度可比期间 2009年10月19日（基金合同生效日）至2009年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.4 期末（2010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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002092	中泰化学	2010-04-19	2011-04-20	非公开发行	16.33	13.40	3,000,000	48,990,000.00	40,200,000.00	-
002092	中泰化学	2010-09-20	2011-04-20	非公开发行-送股	-	13.40	1,500,000	-	20,100,000.00	-
600157	永泰能源	2010-07-15	2011-07-13	非公开发行	16.05	19.47	1,200,000	19,260,000.00	23,364,000.00	-
600219	南山铝业	2010-03-29	2011-03-29	非公开发行	8.82	9.48	1,000,000	8,820,000.00	9,480,000.00	-
300134	大富科技	2010-10-14	2011-01-26	网下申购	49.50	66.00	46,728	2,313,036.00	3,084,048.00	-
300133	华策影视	2010-10-14	2011-01-26	网下申购	68.00	116.00	17,357	1,180,276.00	2,013,412.00	-
300128	锦富新材	2010-09-27	2011-01-13	网下申购	35.00	47.19	31,026	1,085,910.00	1,464,116.94	-
300125	易世达	2010-09-27	2011-01-13	网下申购	55.00	83.49	12,557	690,635.00	1,048,383.93	-

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。此外，基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.4.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.5 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

于2010年12月31日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为1,309,552,879.64元，属于第二层级的余额为132,494,000.00元，无属于第三层级的余额（2009年12月31日：第一层级2,203,583,301.21元，第二层级122,957,429.09元，无第三层级）。

对于持有的重大事项停牌股票，本基金将相关股票公允价值所属层级于停牌期间从第一层级转入第二层级，并于复牌后从第二层级转回第一层级（2009会计期间：同）。对于持有的非公开发行股票，本基金于限售期内将相关股票公允价值所属层级列入第二层级，并于限售期满后从第二层级转入第一层级（2009会计期间：同）。

(2)除公允价值外，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	1,369,146,879.64	87.16
	其中：股票	1,369,146,879.64	87.16
2	固定收益投资	72,900,000.00	4.64
	其中：债券	72,900,000.00	4.64
	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	111,224,484.32	7.08
6	其他各项资产	17,568,911.22	1.12
7	合计	1,570,840,275.18	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	4,852,453.62	0.31
B	采掘业	51,165,516.35	3.32
C	制造业	819,074,353.51	53.08
C0	食品、饮料	92,381,225.68	5.99
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	46,838,485.10	3.04
C4	石油、化学、塑胶、塑料	145,497,989.68	9.43
C5	电子	23,728,309.14	1.54
C6	金属、非金属	175,438,428.81	11.37
C7	机械、设备、仪表	202,466,958.55	13.12
C8	医药、生物制品	132,722,956.55	8.60
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	103,180,650.93	6.69
F	交通运输、仓储业	2,676,889.60	0.17
G	信息技术业	22,145,048.00	1.43
H	批发和零售贸易	109,497,376.28	7.10
I	金融、保险业	85,438,175.94	5.54
J	房地产业	14,481,749.58	0.94
K	社会服务业	48,527,467.83	3.14
L	传播与文化产业	84,743,198.00	5.49
M	综合类	23,364,000.00	1.51
	合计	1,369,146,879.64	88.72

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	600660	福耀玻璃	12,585,546	129,127,701.96	8.37
2	600970	中材国际	2,100,000	85,491,000.00	5.54
3	300058	蓝色光标	2,343,620	82,729,786.00	5.36
4	600535	天士力	1,600,000	65,216,000.00	4.23
5	002092	中泰化学	4,500,000	60,300,000.00	3.91
6	002050	三花股份	1,721,764	57,679,094.00	3.74
7	000893	东凌粮油	1,857,588	48,037,225.68	3.11
8	600547	山东黄金	909,925	47,962,146.75	3.11
9	300043	星辉车模	1,276,253