天弘永定价值成长股票型证券投资基金2010年年度报告摘要

2010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:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月二十九日

§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二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人兴业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	天弘永定价值成长股票
基金主代码	420003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月2日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	92,840,751.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,为投资人创造超额收益。
投资策略	本基金为主动管理的股票型基金,主要投资于国内A股市场上成长性较好、估值水平具有比较优势的上市公司,以及国内债券市场上的国债、金融债、企业债、可转换债券以及权证、货币市场工具等投资品种。本基金投资坚持“股票为主、精选个股”的投资策略,同时适当运用股票、债券等资产灵活配置的投资策略,以优化基金净值的波动。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为主动投资的股票型基金,属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。本基金的风险与预期收益都高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		天弘基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕传红	张志永
	联系电话	022-83865568	021-62677777*212004
	电子邮箱	lvch@thfund.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		022-83310988、4007109999	95561
传真		022-83865569	021-62159217

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12月2日-2008年12月31日
本期已实现收益	7,252,613.45	18,774,016.48	274,204.24
本期利润	6,254,428.58	24,004,789.19	412,164.24
加权平均基金份额本期利润	0.0914	0.2302	0.0017
本期基金份额净值增长率	11.16%	31.27%	0.34%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配基金份额利润	0.0979	0.0472	0.0030
期末基金资产净值	101,932,493.65	98,879,194.00	84,638,264.53
期末基金份额净值	1.0979	1.1171	1.0034

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表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	9.47%	1.87%	5.31%	1.42%	4.16%	0.45%
过去六个月	33.97%	1.59%	17.68%	1.24%	16.29%	0.35%
过去一年	11.16%	1.58%	-9.12%	1.26%	20.28%	0.32%
自基金合同生效起至今	46.41%	1.62%	54.94%	1.49%	-8.53%	0.13%

注:天弘永定业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。沪深300指数和上证国债指数分别由中证指数有限公司和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60%-95%,债券和短期金融工具的投资比例范围是5%-40%,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沪深指数占80%,上证国债指数占20%,并且比较基准每日按照80%和20%对沪深300指数和上证国债指数进行再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

天弘永定价值成长股票基金
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
(2008年12月2日至2010年12月31日)

注:1、本基金合同于2008年12月2日生效。

2、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 自基金合同生效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

注:本基金合同于2008年12月2日生效。基金合同生效当年2008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,不按整个自然年度进行计算。

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
2010年	1.450	2,912,912.93	4,904,138.90	7,817,051.83	无
2009年	1.900	6,912,417.04	11,265,609.96	18,178,027.00	无
2008年	-	-	-	-	无
合计	3.350	9,825,329.97	16,169,748.86	25,995,078.83	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、上海、广州设有分公司。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六只基金: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、天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)、天弘添利分级债券型证券投资基金。

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		
马志强	本基金基金经理。	2008年12月	—	9年	男,经济学博士。历任东北证券投资银行部项目经理;北京蓝巢投资管理有限公司投资主管。2004年11月加盟本公司,历任研究员、研究部主管助理、天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理。
吕宜振	天弘精选混合型证券投资基金基金经理;天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理;本公司投资总监。	2009年4月	2010年4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年加盟本公司,历任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。

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 管理人对报告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

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、所有投资交易品种、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,严格执行授权审批程序;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永定价值成长股票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法规禁止的同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他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年仍然是中国经济的恢复期,“救市”政策逐步退出。从年初开始,货币收紧的措施开始陆续出台,对地产的调控也是愈加强烈。尽管如此,通货膨胀的发展态势仍然超过了大多数学者的预期。从A股市场的运行看,呈现了结构上的明显分化。资金摒弃了地产相关链条,并对未来可能出现的主导产业进行了充分的挖掘和追逐。全年来看代表着新兴行业和传统行业的个股走势出现了巨大的差异。

在报告期内,本基金重点配置了医药、食品、通信等行业,对于本公司投研团队自下而上挖掘的重点品种给予了重仓持有,取得了不错的效果。本基金在报告期内没有进行债券投资。

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1.0979元,本报告期本基金份额净值增长率11.16%,同期业绩比较基准增长率-9.12%,高于基准20.28%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

危机后的全球经济已经步入了第四个年头,美欧等主要国家经济已经有了一定程度恢复迹象,新兴经济体则面临着流动性泛滥带来的通胀冲击。对于我国而言,货币政策回归常态成为必然,应对通货膨胀是政策的首要选择。值得关注的是,作为十二五规划的开局之年,各部门的详细规划将是各行业未来几年发展的方向指引。

从全年看,A股市场出现全局性机会的概率仍然较小,很难有系统性估值提升,业绩增长会成为股价的主要推动力,结构化配置和波段性操作将是取得超额收益的主要来源。相比去年,2011年里周期性行业的投资机会将会显著的增多,其中我们更倾向于持有那些产能受限的低估值周期类个股。对于存在巨大进口替代空间的中游细分行业,会力求挖掘出优良品种。我们也会密切关注十二五规划所指引的产业政策方向,并给予积极布局。

本基金投资团队将会更加勤勉尽职、规范投资,给投资人创造长期持久的收益,以不辜负投资人对我们的信任。

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决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、基金运营部负责人及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,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还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

根据《基金法》、《天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金进行了一次分红。以2010年12月14日已实现的可分配收益12,133,008.04元为基准计算,2010年12月24日向本基金的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利1.45元。本次分红符合本基金基金合同中利润分配的相关约定。

本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

§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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:天弘永定价值成长股票型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	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	7.4.7.1	14,124,723.98	8,031,847.06
结算备付金		592,751.36	1,441,846.02
存出保证金		439,367.54	622,285.12
交易性金融资产	7.4.7.2	85,993,235.13	87,899,487.66
其中:股票投资		85,993,235.13	87,899,487.66
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	2,114,168.12
应收利息	7.4.7.5	2,327.14	2,197.24
应收股利		-	-
应收申购款		16,340,661.02	76,286.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		117,493,066.17	100,188,117.57
负债和所有者权益	附注号	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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		9,957,033.79	366,358.36
应付赎回款		5,083,356.15	163,177.26
应付管理人报酬		74,730.65	127,591.03
应付托管费		12,455.10	21,265.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	349,378.44	569,918.99
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	83,618.39	60,612.76
负债合计		15,560,572.52	1,308,923.57
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	92,840,751.30	88,511,625.15
未分配利润	7.4.7.10	9,091,742.35	10,367,568.85
所有者权益合计		101,932,493.65	98,879,194.00
负债和所有者权益总计		117,493,066.17	100,188,117.57

注:报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.0979元,基金份额总额92,840,751.30份。

7.2 利润表

会计主体:天弘永定价值成长股票型证券投资基金

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	附注号	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		10,545,725.51	30,284,421.47
1.利息收入		95,381.81	241,462.60
其中:存款利息收入	7.4.7.11	94,277.64	203,463.30
债券利息收入		-	28,729.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,104.17	9,270.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		11,243,995.79	24,548,214.03
其中:股票投资收益	7.4.7.12	10,944,590.30	23,861,430.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	243,703.43
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	299,405.49	443,079.68
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.16	-998,184.87	5,230,772.71
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	204,532.78	263,972.13
减:二、费用		4,291,296.93	6,279,632.28
1.管理人报酬		1,099,893.76	1,706,077.52
2.托管费		183,315.52	284,346.21
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.18	2,621,119.76	3,910,978.72
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	7.4.7.19	386,967.89	378,229.83
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		6,254,428.58	24,004,789.19
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		6,254,428.58	24,004,789.19

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘永定价值成长股票型证券投资基金

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)	88,511,625.15	10,367,568.85	98,879,194.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,254,428.58	6,254,428.58
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)	4,329,126.15	286,796.75	4,615,922.90
其中:1.基金申购款	169,811,109.59	19,636,468.16	189,447,577.75
2.基金赎回款	-165,481,983.44	-19,349,671.41	-184,831,654.85
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)	-	-7,817,051.83	-7,817,051.83
五、期末所有者权益(基金净值)	92,840,751.30	9,091,742.35	101,932,493.65

项目	上年度可比期间 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)	84,353,503.71	284,760.82	84,638,264.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	24,004,789.19	24,004,789.19
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)	4,158,121.44	4,256,045.84	8,414,167.28
其中:1.基金申购款	190,672,418.76	29,392,572.32	220,064,991.08
2.基金赎回款	-186,514,297.32	-25,136,526.48	-211,650,823.80
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)	-	-18,178,027.00	-18,178,027.00
五、期末所有者权益(基金净值)	88,511,625.15	10,367,568.85	98,879,194.00

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、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金代销机构
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

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

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1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,099,893.76	1,706,077.52
其中:支付销售机构的客户维护费	370,214.66	208,257.91

注: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X1.5%/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1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	183,315.52	284,346.21

注:支付基金托管人兴业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X0.25%/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

本基金本期及上年度可比期间无与关联方进行的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1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	10,617,856.81	9,966,111.83
期间申购/买入总份额	-	651,744.98
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	10,617,856.81	-
期末持有的基金份额	-	10,617,856.81
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	12.00%

注:1、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。

2、基金管理人天弘基金管理有限公司在本期赎回本基金的交易委托渤海证券股份有限公司办理,适用费率分别为0.5%和0.25%。

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

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
兵器财务有限责任公司	-	-	23,534,184.24	26.59%

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1月1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
兴业银行	14,124,723.98	85,043.42	8,031,847.06	180,645.97

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,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

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.3.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

截至本报告期末(2010年12月31日)止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。

7.4.4.2 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	
600518	康美药业	2010-12-28	配股发行	19.71	2011-01-06	17.29	70,200	1,522,019.78	1,383,642.00	
601989	中国重工	2010-12-31	公告重大事项	11.79	2011-01-04	12.06	97,473	1,147,974.69	1,149,206.67	

注:本基金截至2010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2010年12月31日止,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.4.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2010年12月31日止,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	85,993,235.13	73.19
	其中:股票	85,993,235.13	73.19
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	-	-
	其中:权证	-	-
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	14,717,475.34	12.53
6	其他各项资产	16,782,355.70	14.28
7	合计	117,493,066.17	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	2,904,950.87	2.85
B	采掘业	5,675,460.00	5.57
C	制造业	55,681,529.01	54.63
C0	食品、饮料	2,511,062.00	2.46
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	-	-
C5	电子	9,177,990.69	9.00
C6	金属、非金属	19,287,375.75	18.92
C7	机械、设备、仪表	21,335,446.57	20.93
C8	医药、生物制品	3,369,654.00	3.31
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,231,051.25	2.19
E	建筑业	5,395,225.29	5.29
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	9,775,904.71	9.59
H	批发和零售贸易	2,893,659.00	2.84
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	1,435,455.00	1.41
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	85,993,235.13	84.36

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	600585	海螺水泥	104,900	3,113,432.00	3.05
2	600395	盘江股份	94,200	3,066,210.00	3.01
3	002410	广联达	42,900	3,045,900.00	2.99
4	002152	广电运通	55,550	3,020,809.00	2.96
5	002106	莱宝高科	44,949	2,977,871.25	2.92
6	000629	*ST钒钛	256,700	2,962,318.00	2.91
7	002132	恒星科技	92,205	2,909,067.75	2.85
8	000998	隆平高科	89,191	2,904,950.87	2.85
9	600970	中材国际	71,199	2,898,511.29	2.84
10	002008	大族激光	128,800	2,885,120.00	2.83

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	002146	荣盛发展	7,299,302.68	7.38
2	000829	天音控股	7,041,645.23	7.12
3	000050	深天马A	6,920,139.80	7.00
4	000559	万向钱潮	6,898,364.18	6.98
5	000061	农产品	6,884,489.35	6.96
6	000998	隆平高科	6,475,569.10	6.55
7	600273	华芳纺织	6,221,572.88	6.29
8	600707	彩虹股份	6,111,081.00	6.18
9	002008	大族激光	6,014,564.25	6.08
10	600239	云南城投	5,989,300.36	6.06
11	002106	莱宝高科	5,919,303.57	5.99
12	600467	好当家	5,899,406.75	5.97
13	600547	山东黄金	5,742,886.71	5.81
14	600518	康美药业	5,722,163.17	5.79
15	600563	法拉电子	5,684,082.84	5.75
16	601989	中国重工	5,629,596.07	5.69
17	002041	登海种业	5,615,035.79	5.68
18	002081	金螳螂	5,194,773.80	5.25
19	000961	中南建设	5,166,927.10	5.23
20	000983	西山煤电	4,959,902.77	5.02
21	600585	海螺水泥	4,947,506.72	5.00
22	002073	软控股份	4,943,779.81	5.00
23	600970	中材国际	4,931,041.81	4.99
24	002438	江苏神通	4,928,991.30	4.98
25	000540	中天城投	4,869,541.40	4.92
26	002410	广联达	4,736,625.50	4.79
27	600100	同方股份	4,713,830.28	4.77
28	600329	中新药业	4,625,720.59	4.68
29	000973	佛塑股份	4,613,544.55	4.67
30	000972	新中基	4,602,045.51	4.65
31	600770	综艺股份	4,597,289.89	4.65
32	600303	曙光股份	4,483,564.40	4.53
33	002091	江苏国泰	4,429,758.91	4.48
34	002437	誉衡药业	4,395,263.50	4.45
35	600499	科达机电	4,376,477.77	4.43
36	000598	兴蓉投资	4,351,490.00	4.40
37	600873	五洲明珠	4,267,907.93	4.32
38	601601	中国太保	4,251,468.49	4.30
39	000969	安泰科技	4,203,417.52	4.25
40	000926	福星股份	4,182,917.11	4.23
41	002384	东山精密	4,085,051.78	4.13
42	002122	天马股份	4,069,137.15	4.12
43	000581	威孚高科	4,022,718.70	4.07
44	002045	广州国光	4,005,396.65	4.05
45	600461	洪城水业	3,999,852.84	4.05
46	002055	得润电子	3,889,826.90	3.93
47	002063	远光软件	3,887,341.98	3.93
48	600079	人福医药	3,785,515.37	3.83
49	600000	浦发银行	3,774,466.17	3.82
50	600824	益民集团	3,759,494.57	3.80
51	601788	光大证券	3,750,120.00	3.79
52	600115	东方航空	3,685,668.23	3.73
53	002129	中环股份	3,680,176.74	3.72
54	600395	盘江股份	3,671,779.00	3.71
55	002262	恩华药业	3,639,227.44	3.68
56	601717	郑煤机	3,588,675.00	3.63
57	600458	时代新材	3,569,058.15	3.61
58	600256	广汇股份	3,566,274.51	3.61
59	600354	敦煌种业	3,555,324.44	3.60
60	600315	上海家化	3,541,169.50	3.58
61	600221	海南航空	3,515,183.02	3.56
62	000001	深发展A	3,504,269.11	3.54
63	000425	徐工机械	3,492,652.20	3.53
64	600693	东百集团	3,465,128.43	3.50
65	600523	贵航股份	3,439,416.70	3.48
66	600261	浙江阳光	3,375,685.26	3.41
67	600588	用友软件	3,336,296.22	3.37
68	000541	佛山照明	3,284,018.79	3.32
69	000811	烟台冰轮	3,252,575.83	3.29
70	000623	吉林敖东	3,213,807.00	3.25
71	600036	招商银行	3,198,827.71	3.24
72	002340	格林美	3,169,724.50	3.21
73	600995	文山电力	3,162,471.21	3.20
74	600406	国电南瑞	3,144,293.84	3.18
75	002118	紫鑫药业	3,129,634.74	3.17
76	600425	青松建化	3,126,819.23	3.16
77	002086	东方海洋	3,075,023.30	3.11
78	600830	香溢融通	3,065,733.06	3.10
79	600641	万业企业	3,050,899.05	3.09
80	000823	超声电子	3,011,587.20	3.05
81	002244	滨江集团	2,996,811.00	3.03
82	002422	科伦药业	2,981,100.00	3.01
83	002051	中工国际	2,973,426.30	3.01
84	600884	杉杉股份	2,971,367.00	3.01
85	600132	重庆啤酒	2,956,331.22	2.99
86	601328	交通银行	2,953,790.00	2.99
87	002214	大立科技	2,920,978.00	2.95
88	600383	金地集团	2,920,967.00	2.95
89	601002	晋亿实业	2,905,694.67	2.94
90	000629	*ST钒钛	2,878,835.35	2.91
91	002123	荣信股份	2,865,794.00	2.90
92	002296	辉煌科技	2,862,094.34	2.89
93	002132	恒星科技	2,859,727.75	2.89
94	600750	江中药业	2,841,030.00	2.87
95	002038	双鹭药业	2,840,090.00	2.87
96	000401	冀东水泥	2,828,256.89	2.86
97	000039	中集集团	2,823,763.01	2.86
98	600376	首开股份	2,782,484.38	2.81
99	002036	宜科科技	2,765,160.78	2.80
100	600828	成商集团	2,753,224.00	2.78
101	600403	欣网视讯	2,744,263.55	2.78
102	000777	中核科技	2,744,248.72	2.78
103	002017	东信和平	2,724,817.50	2.76
104	002161	远望谷	2,723,241.57	2.75
105	002006	精功科技	2,715,109.10	2.75
106	002065	东华软件	2,700,579.20	2.73
107	000596	古井贡酒	2,684,586.00	2.72
108	000727	华东科技	2,664,248.36	2.69
109	600252	中恒集团	2,658,095.00	2.69
110	002152	广电运通	2,639,688.80	2.67
111	300054	鼎龙股份	2,611,586.65	2.64
112	002233	塔牌集团	2,600,801.09	2.63
113	601111	中国国航	2,592,072.26	2.62
114	002001	新和成	2,545,413.20	2.57
115	600555	九龙山	2,530,597.36	2.56
116	600897	厦门空港	2,516,267.89	2.54
117	601699	潞安环能	2,516,042.62	2.54
118	000888	峨眉山A	2,507,415.48	2.54
119	600031	三一重工	2,495,615.76	2.52
120	600631	百联股份	2,493,719.14	2.52
121	600502	安徽水利	2,488,711.54	2.52
122	600146	大元股份	2,468,396.78	2.50
123	300058	蓝色光标	2,461,282.00	2.49
124	002430	杭氧股份	2,456,194.96	2.48
125	601998	中信银行	2,446,885.28	2.47
126	002251	步步高	2,438,656.71	2.47
127	600570	恒生电子	2,436,718.89	2.46
128	600571	信雅达	2,425,094.25	2.45
129	002092	中泰化学	2,415,941.30	2.44
130	002007	华兰生物	2,409,820.50	2.44
131	000715	中兴商业	2,391,009.14	2.42
132	000602	金马集团	2,387,325.90	2.41
133	000848	承德露露	2,376,440.00	2.40
134	600316	洪都航空	2,374,196.42	2.40
135	002029	七匹狼	2,366,521.99	2.39
136	600068	葛洲坝	2,361,280.80	2.39
137	000861	海印股份	2,352,805.01	2.38
138	600507	方大特钢	2,317,128.93	2.34
139	000528	柳工	2,312,290.59	2.34
140	000963	华东医药	2,308,360.00	2.33
141	600489	中金黄金	2,307,931.00	2.33
142	600560	金自天正	2,304,124.00	2.33
143	000024	招商地产	2,294,841.37	2.32
144	600549	厦门钨业	2,288,256.00	2.31
145	600478	科力远	2,278,044.00	2.30
146	000400	许继电气	2,262,730.44	2.29
147	000652	泰达股份	2,253,304.81	2.28
148	600348	国阳新能	2,250,659.58	2.28
149	002022	科华生物	2,219,259.70	2.24
150	600837	海通证券	2,215,456.86	2.24
151	002236	大华股份	2,210,635.95	2.24
152	002261	拓维信息	2,200,490.36	2.23
153	600111	包钢稀土	2,192,460.00	2.22
154	600327	大厦股份	2,177,630.36	2.20
155	600125	铁龙物流	2,171,419.00	2.20
156	600778	友好集团	2,161,078.60	2.19
157	002479	富春环保	2,144,467.45	2.17
158	600481	双良节能	2,127,898.82	2.15
159	002447	壹桥苗业	2,124,000.00	2.15
160	002397	梦洁家纺	2,116,321.80	2.14
161	601318	中国平安	2,104,634.30	2.13
162	002110	三钢闽光	2,085,778.92	2.11
163	000960	锡业股份	2,082,776.00	2.11
164	600455	*ST博通	2,079,654.32	2.10
165	002232	启明信息	2,076,770.44	2.10
166	000418	小天鹅A	2,068,562.26	2.09
167	600420	现代制药	2,062,987.00	2.09
168	000538	云南白药	2,058,582.52	2.08
169	000612	焦作万方	2,053,743.76	2.08
170	000661	长春高新	2,052,573.12	2.08
171	002138	顺络电子	2,048,961.74	2.07
172	600193	创兴置业	2,044,427.78	2.07
173	600482	风帆股份	2,024,235.94	2.05
174	000789	江西水泥	2,022,629.74	2.05
175	600595	中孚实业	2,010,445.00	2.03
176	000708	大冶特钢	1,980,637.90	2.00
177	000878	云南铜业	1,976,320.36	2.00
178	600102	莱钢股份	1,972,773.20	2.00

注:本项“买入金额”均按买入成交金额(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	600707	彩虹股份	7,458,853.17	7.54
2	000559	万向钱潮	7,268,570.47	7.35
3	002146	荣盛发展	7,262,282.15	7.34
4	000829	天音控股	7,021,072.28	7.10
5	000983	西山煤电	6,864,776.34	6.94
6	000050	深天马A	6,755,039.44	6.83
7	000061	农产品	6,677,623.66	6.75
8	000001	深发展A	6,218,045.38	6.29
9	600467	好当家	6,189,889.45	6.26
10	600273	华芳纺织	5,950,133.47	6.02
11	600100	同方股份	5,812,297.51	5.88
12	600547	山东黄金	5,779,681.81	5.85
13	002041	登海种业	5,667,936.43	5.73
14	600239	云南城投	5,639,468.44	5.70
15	002081	金螳螂	5,544,098.25	5.61
16	600563	法拉电子	5,364,670.94	5.43
17	000961	中南建设	5,305,921.73	5.37
18	002437	誉衡药业	5,258,403.24	5.32
19	002086	东方海洋	5,127,351.50	5.19
20	000540	中天城投	4,993,449.09	5.05
21	600329	中新药业	4,922,289.37	4.98
22	002438	江苏神通	4,892,562.39	4.95
23	000973	佛塑股份	4,789,519.59	4.84
24	000969	安泰科技	4,781,099.01	4.84
25	601318	中国平安	4,693,716.92	4.75
26	600221	海南航空	4,596,407.44	4.65
27	600571	信雅达	4,561,566.57	4.61
28	002091	江苏国泰	4,511,323.84	4.56
29	601989	中国重工	4,499,082.53	4.55
30	000623	吉林敖东	4,437,415.78	4.49
31	600518	康美药业	4,423,479.58	4.47
32	000972	新中基	4,400,430.51	4.45
33	600499	科达机电	4,346,019.36	4.40
34	600316	洪都航空	4,290,815.38	4.34
35	002045	广州国光	4,258,455.87	4.31
36	600770	综艺股份	4,218,364.00	4.27
37	000926	福星股份	4,190,519.10	4.24
38	600303	曙光股份	4,189,215.19	4.24
39	000713	丰乐种业	4,177,885.86	4.23
40	000598	兴蓉投资	4,116,528.00	4.16
41	600079	人福医药	4,112,825.16	4.16
42	601601	中国太保	4,076,397.12	4.12
43	600873	五洲明珠	4,032,396.84	4.08
44	000528	柳工	4,012,253.97	4.06
45	000848	承德露露	4,012,233.22	4.06
46	600461	洪城水业	3,991,273.28	4.04
47	000998	隆平高科	3,967,650.56	4.01
48	600458	时代新材	3,961,771.30	4.01
49	002142	宁波银行	3,919,526.16	3.96
50	600354	敦煌种业	3,919,030.66	3.96
51	601169	北京银行	3,909,339.18	3.95
52	002129	中环股份	3,861,842.00	3.91
53	600261	浙江阳光	3,826,943.44	3.87
54	000612	焦作万方	3,803,577.30	3.85
55	600000	浦发银行	3,779,528.43	3.82
56	600380	健康元	3,772,952.40	3.82
57	002122	天马股份	3,748,278.78	3.79
58	600256	广汇股份	3,747,688.05	3.79
59	002063	远光软件	3,711,970.34	3.75
60	601788	光大证券	3,629,684.66	3.67
61	600315	上海家化	3,624,570.25	3.67
62	600824	益民集团	3,583,756.50	3.62
63	000987	广州友谊	3,570,104.30	3.61
64	600693	东百集团	3,556,071.82	3.60
65	002422	科伦药业	3,534,437.92	3.57
66	000777	中核科技	3,496,188.18	3.54
67	600406	国电南瑞	3,453,982.00	3.49
68	600115	东方航空	3,393,866.99	3.43
69	002410	广联达	3,374,990.32	3.41
70	000568	泸州老窖	3,323,556.70	3.36
71	002008	大族激光	3,303,513.32	3.34
72	600425	青松建化	3,280,047.41	3.32
73	000541	佛山照明	3,266,619.66	3.30
74	600523	贵航股份	3,260,231.60	3.30
75	600595	中孚实业	3,258,036.31	3.29
76	600403	欣网视讯	3,249,886.21	3.29
77	600995	文山电力	3,202,622.72	3.24
78	600036	招商银行	3,179,368.35	3.22
79	000811	烟台冰轮	3,178,829.43	3.21
80	600830	香溢融通	3,178,204.92	3.21
81	600549	厦门钨业	3,147,366.20	3.18
82	600132	重庆啤酒	3,143,389.15	3.18
83	000823	超声电子	3,127,723.61	3.16
84	600837	海通证券	3,101,873.77	3.14
85	600309	烟台万华	3,080,126.46	3.12
86	600641	万业企业	3,075,580.00	3.11
87	002244	滨江集团	3,073,431.22	3.11
88	002340	格林美	3,065,766.78	3.10
89	002118	紫鑫药业	3,044,787.60	3.08
90	600146	大元股份	3,042,920.94	3.08
91	002106	莱宝高科	3,032,166.98	3.07
92	600588	用友软件	3,021,771.86	3.06
93	600750	江中药业	3,001,442.62	3.04
94	002038	双鹭药业	2,947,653.41	2.98
95	600828	成商集团	2,922,330.30	2.96
96	000858	五粮液	2,919,614.30	2.95
97	600252	中恒集团	2,906,290.58	2.94
98	600066	宇通客车	2,890,986.08	2.92
99	600884	杉杉股份	2,863,649.20	2.90
100	000039	中集集团	2,854,712.61	2.89
101	002214	大立科技	2,839,331.71	2.87
102	002447	壹桥苗业	2,780,462.00	2.81
103	002123	荣信股份	2,754,598.21	2.79
104	000893	东凌粮油	2,754,222.52	2.79
105	601328	交通银行	2,731,726.43	2.76
106	600383	金地集团	2,712,246.98	2.74
107	600581	八一钢铁	2,699,389.71	2.73
108	600489	中金黄金	2,637,703.21	2.67
109	300058	蓝色光标	2,634,434.37	2.66
110	600376	首开股份	2,612,574.18	2.64
111	002036	宜科科技	2,609,660.20	2.64
112	000715	中兴商业	2,609,097.10	2.64
113	000800	一汽轿车	2,590,440.37	2.62
114	000024	招商地产	2,586,942.02	2.62
115	002262	恩华药业	2,577,511.50	2.61
116	002017	东信和平	2,569,546.13	2.60
117	002001	新和成	2,548,845.27	2.58
118	002065	东华软件	2,545,081.00	2.57
119	002092	中泰化学	2,532,741.50	2.56
120	600502	安徽水利	2,518,505.77	2.55
121	000888	峨眉山A	2,499,402.84	2.53
122	601111	中国国航	2,498,708.06	2.53
123	002110	三钢闽光	2,495,599.70	2.52
124	600555	九龙山	2,476,512.89	2.50
125	600970	中材国际	2,474,386.55	2.50
126	600897	厦门空港	2,468,034.32	2.50
127	002029	七匹狼	2,455,633.69	2.48
128	002073	软控股份	2,450,337.40	2.48
129	601998	中信银行	2,437,756.30	2.47
130	600585	海螺水泥	2,432,232.39	2.46
131	000527	美的电器	2,427,502.58	2.46
132	000727	华东科技	2,426,232.30	2.45
133	002430	杭氧股份	2,415,442.93	2.44
134	300054	鼎龙股份	2,407,318.00	2.43
135	002251	步步高	2,399,454.78	2.43
136	600631	百联股份	2,386,429.00	2.41
137	600507	方大特钢	2,385,542.12	2.41
138	000596	古井贡酒	2,382,511.33	2.41
139	000652	泰达股份	2,380,875.20	2.41
140	600068	葛洲坝	2,378,840.80	2.41
141	002007	华兰生物	2,359,257.20	2.39
142	002344	海宁皮城	2,356,139.70	2.38
143	600806	昆明机床	2,356,107.92	2.38
144	600742	一汽富维	2,348,615.20	2.38
145	002293	罗莱家纺	2,335,227.92	2.36
146	600478	科力远	2,306,489.91	2.33
147	600455	*ST博通	2,297,448.20	2.32
148	600778	友好集团	2,293,101.46	2.32
149	000028	一致药业	2,286,958.81	2.31
150	600584	长电科技	2,242,520.92	2.27
151	000538	云南白药	2,236,614.31	2.26
152	000861	海印股份	2,228,635.48	2.25
153	002022	科华生物	2,201,863.00	2.23
154	000963	华东医药	2,194,757.14	2.22
155	600193	创兴置业	2,187,592.32	2.21
156	600231	凌钢股份	2,179,374.39	2.20
157	600028	中国石化	2,168,290.71	2.19
158	600570	恒生电子	2,154,044.85	2.18
159	000661	长春高新	2,139,144.20	2.16
160	002261	拓维信息	2,129,689.10	2.15
161	002397	梦洁家纺	2,129,675.77	2.15
162	002375	亚厦股份	2,127,473.57	2.15
163	000826	桑德环境	2,119,420.91	2.14
164	002055	得润电子	2,112,197.55	2.14
165	601009	南京银行	2,109,659.96	2.13
166	600546	山煤国际	2,054,384.27	2.08
167	000915	山大华特	2,046,704.25	2.07
168	600112	长征电气	2,025,508.32	2.05
169	000581	威孚高科	2,007,981.16	2.03
170	600511	国药股份	2,006,373.60	2.03
171	002138	顺络电子	1,999,339.21	2.02
172	000978	桂林旅游	1,998,825.17	2.02
173	600481	双良节能	1,998,541.85	2.02
174	000418	小天鹅A	1,996,245.76	2.02
175	600482	风帆股份	1,980,151.00	2.00
176	600887	伊利股份	1,977,121.76	2.00
177	600327	大厦股份	1,975,855.80	2.00

注:本项“卖出金额”均按卖出成交金额(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	857,798,799.25
卖出股票收入(成交)总额	869,506,564.41

注:本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(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(元)	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	可转债	-	-
7	合计	-	-

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

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序的前十名资产支持证券投资明细

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

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 报告期内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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。
8.9.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.9.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	439,367.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,327.14
5	应收申购款	16,340,661.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	16,782,355.70

8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本基金本报告期末前十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

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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
3,739	24,830.37	-	-	92,840,751.30	100.00%

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	份额级别	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		19,800.00	0.02%
	合计	19,800.00	0.02%

§10 开放式基金份额变动

份额单位:份

基金合同生效日(2008年12月2日)基金份额总额	291,108,692.74
报告期期初基金份额总额	88,511,625.15
报告期期间基金总申购份额	169,811,109.59
报告期期间基金总赎回份额	165,481,983.44
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
报告期期末基金份额总额	92,840,751.30

注:总申购份额含红利再投、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

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内没有发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所有限公司支付服务费6万元整。截至本报告期末,普华永道中天会计师事务所有限公司已为天弘永定价值成长股票型证券投资基金提供审计服务2年零2个月。

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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		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	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券股份有限公司	1	902,351,982.43	52.28%	733,166.63	51.15%	无
中银国际证券有限责任公司	2	823,769,792.43	47.72%	700,199.66	48.85%	无

券商名称	交易单元数量	债券交易		债券回购		备注
		债券交易量	占债券交易总量比例	回购交易量	占回购交易总量比例	
渤海证券股份有限公司	1	-	-	-	-	无
中银国际证券有限责任公司	2	-	-	18,000,000.00	100.00%	无

注:1、基金专用交易单元的选择标准为:该证券经营机构财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;经营行为规范,内控制度健全,最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚;研究实力较强,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序:本基金管理人根据上述标准进行考察后,确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、报告期内新租用证券公司交易单元:无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元:无。

天弘基金管理有限公司
二〇一一年三月二十九日