汉盛证券投资基金

2011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:中国农业银行股份有限公司
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。

基金托管人中国农业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	富国汉盛封闭
基金主代码	500005
交易代码	500005
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年05月10日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,000,000,000.00份
基金合同存续期	15年
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	1999年5月18日

2.2 基金产品说明

投资目标	为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定的投资收益。
投资策略	“精选品种、组合投资、长线持有、波段操作”,通过研究和发掘具有良好发展前景的上市公司进行组合投资。以长期投资为主轴,同时依据“顺势而为”的原则进行一些短线操作。
业绩比较基准	无
风险收益特征	无

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李长伟	李芳菲
	联系电话	021-20361818	010—68424199
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	lifangfei@abchina.com
客户服务电话		95105686,4008880688	95599
传真		021-20361616	010—68424181

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楼 中国农业银行 北京市海淀区西三环北路100号金玉大厦 上海证券交易所 上海市浦东南路528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
本期已实现收益	76,277,430.57	765,434,411.93	591,619,212.33
本期利润	-414,094,002.81	132,763,716.56	1,567,228,465.15
加权平均基金份额本期利润	-0.2070	0.0664	0.7836
本期基金份额净值增长率	-16.01%	4.39%	64.49%
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	0.0411	0.4151	0.3324
期末基金资产净值	2,082,201,256.46	3,246,295,261.24	3,713,531,544.68
期末基金份额净值	1.0411	1.6231	1.8568

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,封闭式基金交易佣金、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。

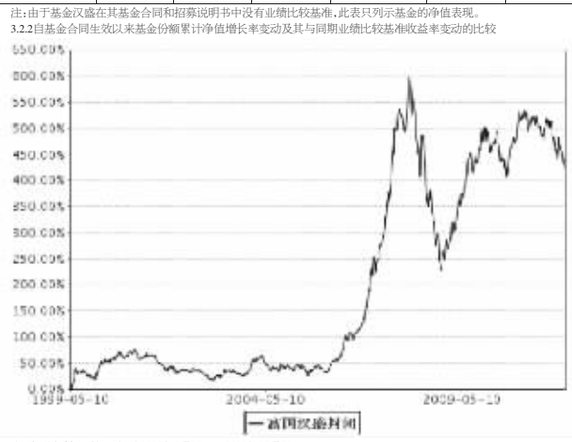
3.2 基金净值表现

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	-5.03%	2.34%	-	-	-	-
过去六个月	-12.71%	1.96%	-	-	-	-
过去一年	-16.01%	1.78%	-	-	-	-
过去三年	44.23%	2.10%	-	-	-	-
过去五年	80.38%	3.03%	-	-	-	-
自基金合同生效日起至今	425.73%	2.64%	-	-	-	-

注:由于基金汉盛在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此表只列示基金的净值表现。

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

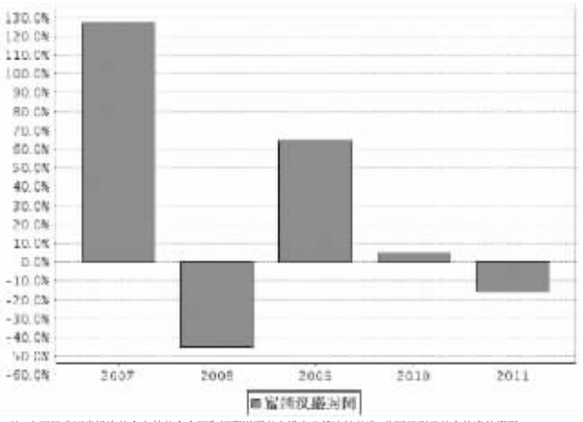


注:本图中所示时间区间为1999年5月10日至2011年12月31日。

由于本基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此图只列示基金的净值表现。

本基金于1999年5月10日成立,建仓期6个月,从1999年5月10日至1999年11月9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过去五年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:由于汉盛证券投资基金在其基金合同和招募说明书中没有业绩比较基准,此图只列示基金的净值表现。

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	3.750	750,000,001.97	-	750,000,001.97	1次分红
2010年	3.000	600,000,000.00	-	600,000,000.00	1次分红
2009年	3.330	665,999,999.41	-	665,999,999.41	1次分红
合计	10.080	2,016,000,001.38	-	2,016,000,001.38	-

§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		
贺轶	本基金基金经理	2010-01-13	-	10年	硕士,曾任中国银行云南省分行国际业务部银行职员;中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员;中银基金管理有限公司投资部助理副总裁;汇丰晋信基金管理公司投资管理部投资经理、基金经理;富国基金管理有限公司营销策划与产品部高级营销策划经理、权益投资部策略分析师;2010年1月至今任汉盛基金基金经理。具有基金从业资格,中国国籍。

注: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。

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,富国基金管理有限公司作为汉盛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》、《汉盛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,无损害基金份额持有人利益的行为,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,严格执行交易系统中的公平交易程序,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

[illegible]

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

2011年A股市场在国内经济和企业盈利增速下滑、通胀高企、流动性未现实质性改善和海外债务危机冲击等因素的影响下向下调整。

2011年,本基金根据宏观经济和市场状况对权益类资产的配置比例进行了动态调整,行业配置以业绩增长稳定和具有相对估值优势的行业为主。

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1.0411元,份额累计净值为4.1667元。报告期内,本基金份额净值增长率为-16.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,随着对经济基本面、企业盈利预期和流动性的逐步改善,市场有望震荡回升。本基金将继续以城镇化和经济结构转型等作为未来的投资主线。

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评估。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

本基金于2011年4月20日公告对2010年报告期内利润进行收益分配,每10份基金份额派发现金红利3.75元,共计派发现金红利750,000,001.97元。

根据本基金《基金合同》约定:“1、基金收益分配采用现金方式,在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次;2、基金年度收益分配比例不得低于基金年度可分配收益的90%;”。本基金将严格按基金合同规定对2011年度可分配收益进行分配。

§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

在托管汉盛证券投资基金的过程中,本基金托管人——中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及《汉盛证券投资基金基金合同》、《汉盛证券投资基金托管协议》的约定,对汉盛证券投资基金管理人—富国基金管理有限公司2011年1月1日至2011年12月31日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害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

本托管人认为,富国基金管理有限公司在汉盛证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金费用开支、利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;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

本托管人认为,富国基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的汉盛证券投资基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

中国农业银行股份有限公司托管业务部

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:汉盛证券投资基金

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	134,911,786.69	374,551,546.16
结算备付金	3,518,592.62	8,844,205.30
存出保证金	1,250,918.42	694,613.15
交易性金融资产	1,862,084,269.17	3,022,249,368.31
其中:股票投资	1,381,687,861.60	2,339,360,456.54
基金投资	-	-
债券投资	480,396,407.57	682,888,911.77
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	99,500,349.25	29,400,164.10
应收证券清算款	-	15,420,000.00
应收利息	7,646,266.47	6,133,861.09
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	24.36	24.36
资产总计	2,108,912,206.98	3,457,293,782.47
负债和所有者权益	本期末(2011年12月31日)	上年度末(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	-	180,000,000.00
应付证券清算款	19,723,757.15	21,040,523.61
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	2,723,529.19	4,116,950.87
应付托管费	453,921.55	686,158.46
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	1,881,923.51	3,474,339.58
应交税费	1,467,819.12	1,465,048.72
应付利息	-	15,499.99
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	460,000.00	200,000.00
负债合计	26,710,950.52	210,998,521.23
所有者权益:		
实收基金	2,000,000,000.00	2,000,000,000.00
未分配利润	82,201,256.46	1,246,295,261.24
所有者权益合计	2,082,201,256.46	3,246,295,261.24
负债和所有者权益总计	2,108,912,206.98	3,457,293,782.47

注:报告截止日2011年12月31日,基金份额净值1.0411元,基金份额总额2,000,000,000.00份。

7.2 利润表

会计主体:汉盛证券投资基金

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	-349,903,751.93	204,898,130.44
1.利息收入	19,947,368.09	19,189,726.22
其中:存款利息收入	1,524,801.04	1,840,610.35
债券利息收入	17,750,074.19	16,984,172.44
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	672,492.86	364,943.43
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	120,520,313.36	818,371,096.78
其中:股票投资收益	108,205,920.53	801,077,777.05
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-779,198.58	6,020,240.76
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	13,093,591.41	11,273,078.97
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-490,371,433.38	-632,670,695.37
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	-	8,002.81
减:二、费用	64,190,250.88	72,134,413.88
1.管理人报酬	38,716,854.83	45,144,135.60
2.托管费	6,457,734.05	7,524,022.61
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	15,562,427.20	15,117,781.57
5.利息支出	712,162.80	2,060,060.12
其中:卖出回购金融资产支出	712,162.80	2,060,060.12
6.其他费用	2,741,072.00	2,288,413.98
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-414,094,002.81	132,763,716.56
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-414,094,002.81	132,763,716.56

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:汉盛证券投资基金

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)	2,000,000,000.00	1,246,295,261.24	3,246,295,261.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-414,094,002.81	-414,094,002.81
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
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)	-	-750,000,001.97	-750,000,001.97
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	82,201,256.46	2,082,201,256.46
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)	2,000,000,000.00	1,713,531,544.68	3,713,531,544.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	132,763,716.56	132,763,716.56
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
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)	-	-600,000,000.00	-600,000,000.00
五、期末所有者权益(基金净值)	2,000,000,000.00	1,246,295,261.24	3,246,295,261.24

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、基金发起人
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东
申银万国证券股份有限公司(“申银万国”)	基金管理人的股东
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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人

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	873,447,007.25	8.73	507,932,491.66	5.25
申银万国	519,877,354.35	5.19	356,381,728.73	3.68

7.4.5.1.2 权证交易

注:本基金本年度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。

7.4.5.1.3 债券交易

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(%)
海通证券	253,468,385.27	50.75	-	-

7.4.5.1.4 回购交易

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	占当期回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期回购成交总额的比例(%)
海通证券	72,000,000.00	5.81	260,000,000.00	6.23
申银万国	100,000,000.00	8.06	-	-

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	725,107.95	8.70	373,096.73	19.85
申银万国	433,031.51	5.19	38,416.64	2.04
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	422,319.18	5.23	179,478.84	5.17
申银万国	294,816.17	3.65	69,029.62	1.99

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	38,716,854.83	45,144,135.60
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:该项费用按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提,基金成立三个月后如持有现金比例高于基金资产净值的20%,超出部分不计提管理费。计算方法如下:

H=E*1.50%/当年天数

H 为每日应支付的管理人管理费

E 为前一日的基金资产净值(扣除超过规定比例现金后的资产净值)

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,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	6,457,734.05	7,524,022.61

注: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

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付。

7.4.5.2.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期(2011年01月01日至2011年12月31日)					
	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
中国农业银行	-	-	-	-	-	-
	上年度可比期间(2010年01月01日至2010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
中国农业银行	-	-	-	-	177,000,000.00	66,364.82

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(1999年05月10日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
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	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.50%	0.50%

注:本基金管理人作为本基金发起人之一在本基金发行期间认购1000万份基金份额,其认购费率是公允的。

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

份额单位:份

关联方名称	本期末(2011年12月31日)		上期末(2010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(%)
海通证券股份有限公司	5,000,000.00	0.25	5,000,000.00	0.25
申银万国证券股份有限公司	10,000,000.00	0.50	10,000,000.00	0.50
山东省国际信托有限公司	5,000,000.00	0.25	5,000,000.00	0.25

注:表中关联方持有基金份额是其作为本基金发起人在本基金发行期间认购的,其认购费率是公允的。

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
中国农业银行股份有限公司	134,911,786.69	1,446,020.69	374,551,546.16	1,763,039.44

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:本基金本报告期及上年度可比期间均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

本基金本期及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

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

金额单位:人民币元

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
600546	山煤国际	2011-12-05	2012-12-03	非公开发行股票	22.80	22.92	1,000,000	22,800,000.00	22,920,000.00	注1
601669	中国水电	2011-09-29	2012-01-18	新股认购	4.50	4.09	10,313,610	46,411,245.00	42,182,664.90	-
000521	美菱电器	2011-01-07	2012-01-11	认购非公开发行证券	10.28	4.43	1,500,000	15,420,000.00	6,645,000.00	-
000521	美菱电器	2011-08-10	2012-01-11	非公开发行证券送股	-	4.43	300,000	-	1,329,000.00	注2

注:注1:该可流通日系本基金根据上市公司公告暂估确定,最终日期以上市公司公告为准。

注2:本基金持有的非公开发行股票美菱电器,于2011年8月10日实施2010年度利润分配方案,向全体股东每10股送2股并派发现金红利0.5元(含税),本基金新增300,000股。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注:本基金本期末未持有的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:截至本报告期末,本基金无因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。

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末,本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	1,381,687,861.60	65.52
	其中:股票	1,381,687,861.60	65.52
2	固定收益投资	480,396,407.57	22.78
	其中:债券	480,396,407.57	22.78
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	99,500,349.25	4.72
	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	138,430,379.31	6.56
6	其他各项资产	8,897,209.25	0.42
7	合计	2,108,912,206.98	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	18,276,300.30	0.88
B	采掘业	29,768,020.00	1.43
C	制造业	641,484,576.55	30.81
C0	食品、饮料	127,244,953.15	6.11
C1	纺织、服装、皮毛	48,002,106.30	2.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	36,973,598.52	1.78
C5	电子	58,552,926.25	2.81
C6	金属、非金属	21,478,811.20	1.03
C7	机械、设备、仪表	220,872,799.26	10.61
C8	医药、生物制品	128,359,381.87	6.16
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	9,970,813.93	0.48
E	建筑业	59,838,754.05	2.87
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	113,582,884.16	5.45
H	批发和零售贸易	55,302,008.93	2.66
I	金融、保险业	277,361,541.18	13.32
J	房地产业	151,718,784.21	7.29
K	社会服务业	16,951,588.29	0.81
L	传播与文化产业	7,432,590.00	0.36
M	综合类	-	-
	合计	1,381,687,861.60	66.36

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	343,600	66,417,880.00	3.19
2	600016	民生银行	10,930,000	64,377,700.00	3.09
3	600036	招商银行	4,183,924	49,663,177.88