富国天益价值证券投资基金 2010年半年度报告摘要

2010年06月30日

基金管理人：富国基金管理有限公司
基金托管人：交通银行股份有限公司
送出日期：2010年08月24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。本半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。

基金托管人交通银行股份有限公司(简称：交通银行)根据本基金合同规定，于2010年8月20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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2010年1月1日起至2010年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国天益价值股票
基金主代码	100020
交易代码	前端交易代码:100020 后端交易代码:100021
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2004年06月15日
基金管理人	富国基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,108,149,450.16份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金属价值型基金，主要投资于内在价值被低估的上市公司的股票，或与同类型上市公司相比具有更高相对价值的上市公司的股票。本基金通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金采取积极的投资策略。本基金在大类资产配置和行业配置层面，遵循自上而下的积极策略，个股选择层面，遵循自下而上的积极策略。根据基金经理对股票市场变动的趋势的判断，决定基金资产在股票、债券、现金等金融资产上的分布，并进行动态配比以规避系统性风险的影响，最大限度地确保基金资产的安全。本基金的股票选择，主要采取价值型选股策略。以公司行业研究员的基本分析为基础，同时结合数量化的系统选股方法，精选价值被低估的投资品种，并确保基金的股票组合满足以下条件： ①市净率PB低于市场平均水平； ②组合中70%以上的个股的动态市盈率低于市场平均水平。
业绩比较基准	95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数
风险收益特征	本基金为价值型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种。

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		富国基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李长伟	张咏东
	联系电话	021-68597788	021-32169999
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		95105686，4008880688	95559
传真		021-68597799	021-62701216

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fullgoal.com.cn
基金半年度报告备置地点	富国基金管理有限公司 上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦5.6层 交通银行 上海市浦东新区银城中路188号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2010年01月01日至2010年06月30日)
本期已实现收益	-397,167,586.64
本期利润	-2,077,051,624.37
加权平均基金份额本期利润	-0.1681
本期基金份额净值增长率	-17.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2010年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.2104
期末基金资产净值	9,560,578,000.88
期末基金份额净值	0.7896

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，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
过去一个月	-3.50%	1.29%	-7.26%	1.56%	3.76%	-0.27%
过去三个月	-13.86%	1.37%	-21.90%	1.71%	8.04%	-0.34%
过去六个月	-17.56%	1.24%	-26.08%	1.50%	8.52%	-0.26%
过去一年	-4.90%	1.41%	-16.34%	1.79%	11.44%	-0.38%
过去三年	-5.17%	1.60%	-27.06%	2.25%	21.89%	-0.65%
自基金合同生效日起至今	393.38%	1.49%	147.27%	1.90%	246.11%	-0.41%

注：本基金合同于2004年6月15日生效。

根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金的业绩比较基准=95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数。本基金股票投资部分的业绩比较基准采用中信标普300指数，债券投资部分的业绩比较基准采用中信国债指数。中信标普300指数由深沪两市具有行业代表性的公司构成，样本股经过流动性和财务稳定性的审慎检查，能较全面地描述中国A股市场地总体趋势。中信标普国债指数反映了交易所国债整体走势，是目前市场上较有影响力的债券投资业绩比较基准。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1日收益率(benchmark t)按下列公式计算：

benchmark t =95% *[中信标普300指数t/(中信标普300指数t-1)-1] +5% * [中信国债指数t/(中信国债指数t-1)-1]；

其中，t=1,2,3,…，T，T表示时间截至日；

期间T日收益率(benchmarkT)按下列公式计算：

benchmarkT =[∏Tt=1(1+benchmark t)]-1

其中，T=2,3,4,…；∏Tt=1(1+benchmark t)表示t日至T日的(1+benchmark t)数学连乘。

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：截止日期为2010年6月30日。

本基金于2004年6月15日成立，建仓期6个月，从2004年6月15日至2004年12月14日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。本基金于2007年11月6日大比例分红规模急剧扩大，建仓期3个月，从2007年11月5日至2008年2月4日，建仓期结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

§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2010年6月30日，本基金管理人管理汉盛证券投资基金、汉兴证券投资基金、富国天丰强化收益债券型证券投资基金三只封闭式证券投资基金和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增强证券投资基金和富国通胀通缩主题轮动股票型证券投资基金十三只开放式证券投资基金。

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		
陈戈	本基金基金经理兼任公司副总经理、权益投资部总经理。	2005-04-13	-	14年	硕士，曾任君安证券(深圳)资深研究员；2000年10月任富国基金管理有限公司研究员、行业研究主管，研究策划部经理，总经理助理。2003年4月至今任富国天益基金经理，兼任公司副总经理、权益投资部总经理。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富国天益价值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》、《富国天益价值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

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

2010年上半年A股市场整体呈现振荡下跌走势，对投资者对未来经济前景的担忧是下跌主因。上半年本基金在基本保持仓位的稳定的同时，对组合结构进行了较大幅度的调整，取得了一定的效果。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2010年6月30日，本基金份额净值为0.7896元，份额累计净值为3.8009元。报告期内，本基金份额净值增长率为-17.56%，同期业绩比较基准收益率为-26.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

尽管市场处于弱势，本基金对中国经济的未来增长前景仍然充满信心，未来我们将始终以中国经济结构转型和产业升级两大趋势为主要线索积极寻找投资机会。下半年本基金将保持投资风格和仓位基本稳定的同时，积极寻找新的投资品种，不断优化组合，争取为投资者创造更好的投资回报。

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决策。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

本基金本报告期未进行利润分配。

本基金将严格按照法律法规及基金合同约定进行收益分配。

§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

2010年上半年度，基金托管人在富国天益价值证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2010年上半年度，富国基金管理有限公司在富国天益价值证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2010年上半年度，由富国基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关富国天益价值证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务报表(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：富国天益价值证券投资基金

报告截止日：2010年06月30日

单位：人民币元

资产	本期末(2010年06月30日)	上年度末(2009年12月31日)
资产：		
银行存款	480,765,700.14	450,097.01
结算备付金	32,891,151.22	416,468,229.66
存出保证金	2,782,518.98	1,750,872.42
交易性金融资产	8,776,639,505.72	11,962,206,573.82
其中：股票投资	8,010,459,825.72	11,372,823,156.22
基金投资	-	-
债券投资	766,179,680.00	589,383,417.60
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	198,000,497.00	-
应收证券清算款	92,736,000.00	414,631,758.31
应收利息	2,748,445.86	6,788,545.36
应收股利	225,559.73	-
应收申购款	4,139,179.71	2,524,171.71
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	9,590,928,558.36	12,804,820,248.29
负债和所有者权益	本期末(2010年06月30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	-	300,000,000.00
应付证券清算款	7,073,488.83	-
应付赎回款	5,001,533.04	25,458,205.88
应付管理人报酬	12,282,902.01	15,686,948.43
应付托管费	2,047,150.32	2,614,491.40
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	3,014,968.64	5,386,280.95
应交税费	434,180.80	434,180.80
应付利息	-	11,501.38
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	496,333.84	421,041.53
负债合计	30,350,557.48	350,012,650.37
所有者权益：		
实收基金	12,108,149,450.16	13,003,464,161.44
未分配利润	-2,547,571,449.28	-548,656,563.52
所有者权益合计	9,560,578,000.88	12,454,807,597.92
负债和所有者权益总计	9,590,928,558.36	12,804,820,248.29

注：报告截止日2010年06月30日，基金份额净值0.7896元，基金份额总额12,108,149,450.16份。

6.2 利润表

会计主体：富国天益价值证券投资基金

本报告期：2010年01月01日至2010年06月30日

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)	上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30日)
一、收入	-1,969,985,313.50	3,106,348,543.46
1.利息收入	11,148,205.18	33,546,281.48
其中：存款利息收入	3,471,440.81	3,805,750.97
债券利息收入	6,908,161.41	29,740,530.51
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	768,602.96	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)	-301,839,873.38	-1,323,971,889.27
其中：股票投资收益	-329,735,838.76	-1,484,078,877.91
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-3,157,443.53	105,291,651.71
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具投资收益	-	-
股利收益	31,053,408.91	54,815,336.93
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	-1,679,884,037.73	4,395,583,602.18
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	590,392.43	1,190,549.07
减：二、费用	107,066,310.87	106,471,360.09
1.管理人报酬	80,903,787.57	83,964,576.41
2.托管费	13,483,964.65	13,994,096.03
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	11,353,145.17	8,294,580.42
5.利息支出	1,093,028.91	-
其中：卖出回购金融资产支出	1,093,028.91	-
6.其他费用	232,384.57	218,107.23
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-2,077,051,624.37	2,999,877,183.37
减：所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-2,077,051,624.37	2,999,877,183.37

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：富国天益价值证券投资基金

本报告期：2010年01月01日至2010年06月30日

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年06月30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)	13,003,464,161.44	-548,656,563.52	12,454,807,597.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-2,077,051,624.37	-2,077,051,624.37
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)	-895,314,711.28	78,136,738.61	-817,177,972.67
其中：1.基金申购款	304,356,965.51	-38,638,185.96	265,718,779.55
2.基金赎回款	-1,199,671,676.79	116,774,924.57	-1,082,896,752.22
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)	12,108,149,450.16	-2,547,571,449.28	9,560,578,000.88
项目	上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30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)	16,947,064,110.93	-6,106,575,380.06	10,840,488,730.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,999,877,183.37	2,999,877,183.37
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)	-1,403,547,255.60	469,650,822.34	-933,896,433.26
其中：1.基金申购款	2,092,525,475.51	-531,942,472.38	1,560,583,003.13
2.基金赎回款	-3,496,072,731.11	1,001,593,294.72	-2,494,479,436.39
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)	15,543,516,855.33	-2,637,047,374.35	12,906,469,480.98

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1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

本报告期内本基金所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致

6.4.2会计差错更正的说明

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.3税项

1.印花税

根据财政部、国家税务总局财税字[2007]84号文《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》的规定，自2007年5月30日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的1‰调整为3‰；

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。

6.4.4关联方关系

6.4.4.1本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.4.2本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
申银万国证券股份有限公司(“申银万国证券”)	基金管理人的股东、基金代销机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.5本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1通过关联方交易单元进行的交易

6.4.5.1.1股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30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	773,662,486.13	11.08	685,212,998.38	11.88
申银万国	2,127,021,366.76	30.47	1,112,452,701.50	19.28

6.4.5.1.2权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.5.1.3债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30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	419,622,174.30	99.55	228,601,978.70	18.85
申银万国	-	-	208,213,472.75	17.17

6.4.5.1.4回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30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(%)
申银万国	200,000,000.00	3.41	-	-

注：本基金上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的回购交易。

6.4.5.1.5应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2010年01月01日至2010年06月30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	657,619.60	11.31	505,987.91	16.83
申银万国	1,747,044.36	30.03	965,011.28	32.11
关联方名称	上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30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	582,430.33	11.99	190,828.38	7.03
申银万国	926,200.86	19.07	476,827.60	17.57

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上海证券交易所买(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。

6.4.5.2关联方报酬

6.4.5.2.1基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)	上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30日)
当期发生的基金应支付的管理费	80,903,787.57	83,964,576.41
其中：支付销售机构的客户维护费	16,597,938.90	16,331,741.94

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%/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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.5.2.2基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2010年01月01日至2010年06月30日)	上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30日)
当期发生的基金应支付的托管费	13,483,964.65	13,994,096.03

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，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.5.3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

本期(2010年01月01日至2010年06月30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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30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
交通银行	-	158,871,491.10	-	-	-	-

注：本基金本报告期未发生关联方银行间债券(含回购)的交易。

6.4.5.4各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金的基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.5.4.2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

注：本报告期末及上年度可比期间末本基金除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.5.5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(2010年01月01日至2010年06月30日)		上年度可比期间(2009年01月01日至2009年06月30日)	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	480,765,700.14	1,340,890.20	569,561,618.05	678,492.00

注：本基金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户的证券交易结算资金余额2010年上半年末为32,891,151.22元，2009年上半年末为147,643,194.93元。

6.4.5.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间内本基金均未参与关联方承销证券。

6.4.5.7其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间内本基金均无其他关联方交易事项。

6.4.6期末(2010年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

6.4.6.1.1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
002383	合众思壮	2010-03-26	2010-07-02	新股认购	37.00	48.45	35,640	1,318,680.00	1,726,758.00	-
002384	东山精密	2010-03-31	2010-07-09	新股认购	26.00	57.67	51,729	1,344,954.00	2,983,211.43	-
002386	天原集团	2010-03-31	2010-07-09	新股认购	15.36	16.53	401,163	6,161,863.68	6,631,224.39	-
002391	长青股份	2010-04-08	2010-07-16	新股认购	51.00	45.39	46,228	2,357,628.00	2,098,288.92	-
002392	北京利尔	2010-04-15	2010-07-23	新股认购	42.00	36.38	102,261	4,294,962.00	3,720,255.18	-
002405	四维图新	2010-05-06	2010-08-18	新股认购	25.60	33.18	60,570	1,550,592.00	2,009,712.60	-
002407	多氟多	2010-05-06	2010-08-18	新股认购	39.39	41.65	37,099	1,461,329.61	1,545,173.35	-
002409	雅克科技	2010-05-13	2010-08-25	新股认购	30.00	24.77	71,321	2,139,630.00	1,766,621.17	-
002410	广联达	2010-05-13	2010-08-25	新股认购	58.00	52.15	46,766	2,712,428.00	2,438,846.90	-
002412	汉森制药	2010-05-13	2010-08-25	新股认购	35.80	32.50	30,052	1,075,861.60	976,690.00	-
002415	海康威视	2010-05-19	2010-08-30	新股认购	68.00	69.30	157,865	10,734,820.00	10,940,044.50	-
002422	科伦药业	2010-05-26	2010-09-03	新股认购	83.36	93.80	108,892	9,077,237.12	10,214,069.60	-
002431	棕榈园林	2010-06-02	2010-09-10	新股认购	45.00	54.89	76,958	3,463,110.00	4,224,224.62	-
002434	万里扬	2010-06-04	2010-09-20	新股认购	30.00	25.66	73,553	2,206,590.00	1,887,369.98	-
002437	誉衡药业	2010-06-09	2010-09-27	新股认购	50.00	61.80	130,335	6,516,750.00	8,054,703.00	-
002441	众业达	2010-06-25	2010-07-06	新股认购	39.90	39.90	500	19,950.00	19,950.00	-
002442	龙星化工	2010-06-25	2010-07-06	新股认购	12.50	12.50	500	6,250.00	6,250.00	-
300070	碧水源	2010-04-12	2010-07-21	新股认购	69.00	93.20	27,103	1,870,107.00	2,525,999.60	-
300072	三聚环保	2010-04-16	2010-07-27	新股认购	32.00	40.82	40,489	1,295,648.00	1,652,760.98	-
300077	国民技术	2010-04-23	2010-08-02	新股认购	87.50	116.75	25,559	2,236,412.50	2,984,013.25	-
300078	中瑞思创	2010-04-23	2010-07-30	新股认购	58.00	69.88	32,369	1,877,402.00	2,261,945.72	-
300082	奥克股份	2010-05-10	2010-08-20	新股认购	85.00	67.55	16,919	1,438,115.00	1,142,878.45	-
300085	银之杰	2010-05-17	2010-08-26	新股认购	28.00	27.80	38,135	1,067,780.00	1,060,153.00	-
300092	科新机电	2010-06-30	2010-07-08	新股认购	16.00	16.00	500	8,000.00	8,000.00	-
300094	国联水产	2010-06-30	2010-07-08	新股认购	14.38	14.38	500	7,190.00	7,190.00	-
601369	陕鼓动力	2010-04-19	2010-07-28	新股认购	15.50	17.30	219,065	3,395,507.50	3,789,824.50	-
002024	苏宁电器	2009-12-30	2010-12-31	非公开发行股票	17.20	11.40	6,200,000	106,640,000.00	70,680,000.00	-
002024	苏宁电器	2010-04-16	2010-12-31	非公开发行股票-转增	-	11.40	3,100,000	-	35,340,000.00	-

6.4.6.2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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000001	深发展A	2010-06-30	筹划重大事项	17.51	-	-	15,592,133	335,886,022.33	273,018,248.83	-
601989	中国重工	2010-05-06	筹划重大事项	7.50	2010-07-16	6.71	13,000	95,940.00	97,500.00	-
601318	中国平安	2010-06-