

# 富国天益价值证券投资基金

## 二 00 九年年度报告

2009 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： 交通银行股份有限公司

送出日期： 2010 年 03 月 27 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。

本报告期自2009年1月1日起至2009年12月31日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录.....	2
1.1	重要提示.....	2
1.2	目录.....	3
§2	基金简介.....	5
2.1	基金基本情况.....	5
2.2	基金产品说明.....	5
2.3	基金管理人和基金托管人.....	5
2.4	信息披露方式.....	6
2.5	其他相关资料.....	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1	主要会计数据和财务指标.....	6
3.2	基金净值表现.....	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况.....	9
§4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核报告.....	11
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
§6	审计报告.....	13
§7	年度财务报表.....	14
7.1	资产负债表.....	14
7.2	利润表.....	16
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	17
7.4	报表附注.....	18
§8	投资组合报告.....	37
8.1	期末基金资产组合情况.....	37
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	37
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	43
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.....	43
8.9	投资组合报告附注.....	43

§9	基金份额持有人信息.....	44
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
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.....	44
§10	开放式基金份额变动.....	44
§11	重大事件揭示.....	45
11.1	基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
11.4	基金投资策略的改变.....	45
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
11.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
11.8	其他重大事件.....	47
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	47
§13	备查文件目录.....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	富国天益价值证券投资基金
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	13,003,464,161.44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 P/B 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
	联系电话	021-68597788
	电子邮箱	public@fullgoal.com.cn
客户服务电话	95105686、4008880688	95559
传真	021-68597799	021-62701216
注册地址	上海市浦东新区花园石桥	上海市浦东新区银城中路

	路 33 号花旗集团大厦 5、6 层	188 号
办公地址	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层	上海市浦东新区银城中路 188 号
邮政编码	200120	200120
法定代表人	陈敏	胡怀邦

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所	上海市南京西路 1601 号越洋广场 29 楼
注册登记机构	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

## § 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

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	-1,488,672,397.33	-1,324,628,832.10	5,067,993,465.01
本期利润	4,827,775,996.71	-8,746,230,697.72	5,490,223,771.13
加权平均基金份额本期利润	0.3212	-0.5119	1.3527
本期加权平均净值利润率	40.35%	-62.57%	74.02%
本期基金份额净值增长率	49.73%	-43.83%	118.41%
3.1.2 期末数据和指标	2009 年 12 月 31 日	2008 年 12 月 31 日	2007 年 12 月 31 日
期末可供分配利润	-2,121,643,885.85	-6,106,575,380.06	66,086,206.25
期末可供分配基金份额利润	-0.1632	-0.3603	0.0056
期末基金资产净值	12,454,807,597.92	10,840,488,730.87	13,384,602,270.11

期末基金份额净值	0.9578	0.6397	1.1388
3.1.3 累计期末指标	2009年12月31日	2008年12月31日	2007年12月31日
基金份额累计净值增长率	498.48%	299.72%	611.58%

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。

期末可供分配利润，采用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（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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	13.82%	1.44%	18.45%	1.66%	-4.63%	-0.22%
过去六个月	15.36%	1.56%	13.17%	2.01%	2.19%	-0.45%
过去一年	49.73%	1.42%	89.15%	1.93%	-39.42%	-0.51%
过去三年	83.70%	1.76%	77.55%	2.37%	6.15%	-0.61%
过去五年	464.47%	1.57%	257.68%	2.01%	206.79%	-0.44%
自基金合同生效日起至今	498.48%	1.50%	234.50%	1.93%	263.98%	-0.43%

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<sub>t</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_t = 95\% * [\text{中信标普300指数}_t / (\text{中信标普300指数}_{t-1}) - 1] + 5\% * [\text{中信国债指数}_t / (\text{中信国债指数}_{t-1}) - 1];$$

其中，t=1, 2, 3, ..., T, T表示时间截至日；

期间T日收益率（benchmark<sub>T</sub>）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = [\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)] - 1$$

其中，T=2, 3, 4, ...； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$ 表示t日至T日的(1+benchmark<sub>t</sub>)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

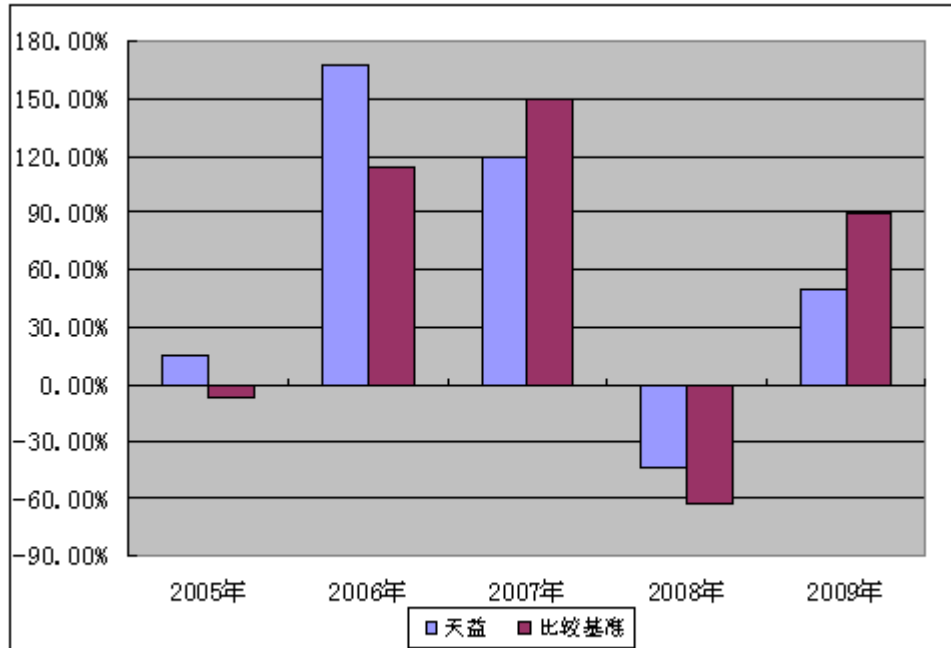


注：截止日期为 2009 年 12 月 31 日。

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。



### 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



### 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
2009年	—	—	—	—	—
2008年	—	—	—	—	—
2007年	20.548	3,359,130,963.43	3,000,304,131.46	6,359,435,094.89	1次分红
合计	20.548	3,359,130,963.43	3,000,304,131.46	6,359,435,094.89	1次分红

## § 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2009年12月31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和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及富国沪深 300 增强证券投资基金十二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	—	13 年	硕士，曾任君安证券（深圳）资深研究员；2000.10 至今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。现任公司副总经理兼任权益投资部总经理、富国天益基金经理。具有基金从业资格，中国国籍。
许友胜	本基金前任基金经理助理	2008-03-01	2009-07-31	8 年	硕士，曾任安徽省建筑设计研究院工程师，东方证券股份有限公司研究员，曾任富国基金管理有限公司研究部行业研究员，富国天益基金基金经理助理。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合规守信情况的说明

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《基金法》、《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，以在充分重视本金长期安全的前提下，力争为基金持有人创造较高的当期收益为目标，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

公司旗下相似投资风格的开放式基金业绩比较：

项目	净值增长率	业绩比较基准收益率
富国天益价值证券投资基金	49.73%	89.15%
富国天合稳健优选股票型证券投资基金	71.05%	72.36%
富国天博创新主题股票型证券投资基金	66.88%	72.36%

注：根据经托管行审定的基金年报数据，本公司旗下相似投资风格的富国天益价值证券投资基金分别与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之间在本报告期的净值增长率之差超过 5%。其原因主要是基金合同约定及投资策略不同所致。日常监控和公平性交易分析结果表明，没有证据显示两者之间的投资行为存在利益输送的情况。

#### 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

2009 年 A 股市场在政策刺激和充裕流动性推动下，整体呈现单边上扬走势，期间周期性行业表现抢眼，各类主题性投资盛行。本基金由于策略调整较慢以及风格与市场有所差异，总体表现落后。

##### 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 0.9578 元，份额累计净值为 3.9691 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 49.73%，同期业绩比较基准收益率为 89.15%。

#### 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 2010 年，我们认为，在国内外宏观经济形势复苏向好的大背景下，绝大部分行业的基本面将持续好转，部分上市公司业绩改善程度可能超出预期，这将是支撑市场向上的主要力量。与此同时，政府宏观经济刺激政策也将逐步退出，但我们认为这不会改变市场趋势，但会加剧市场振荡。市场风格可能由此逐步切换，从自上而下逐步向自下而上转移。另外 IPO 和再融资将会压制市场的上行空间。

2010 年本基金将保持精选个股，长期持有的投资风格。在行业配置方面，我们仍将以中国经济结构转型和产业升级两大趋势为主要线索，重点关注消费服务类行业，包括金融服务、零售、食品饮料、餐饮旅游、交通运输、消费电子、医药及医疗服务等行业；科技与创新产业，装备制造业；以及具有产业整合和购并机会的上游行业等。同时我们仍将继续加大结构调整的力度，不断优化组合，争取为投资者创造更好的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核报告

2009 年，本基金管理人在总结去年基金运作的基础上，继续坚持“事前防范，事中监

控，事后评估及反馈”为主的内部控制策略，坚持规范经营、合规运作，重视公司和基金运作的风险管理，内部监察工作坚持一切从防范风险，保障基金持有人利益出发，内部风险管理部门和各业务部门紧密配合，继续通过进一步完善规章制度和业务流程、加强基金投资限制的系统控制功能和日常监控、合规培训和定期、不定期内控检查等方式，对公司各项工作进行全方位、实时的监察稽核，并对基金投资决策与执行情况重点专项监察稽核。

在本报告期内，管理人对本基金运作实施内部控制措施如下：

#### 1、整合投研团队，完善内控制度。

以建设多风格、多策略投资为目标，公司对基金投资部、金融工程部、资产管理部、海外投资部进行了整合，按国际通行分类方法分为权益、固定收益和另类投资三个投资部门，并根据法规要求、组织结构调整、业务发展的需要，对投资管理的相关制度进行了修订。在此基础上，公司对研究、投资决策、组合管理、交易执行和确认反馈的有关流程进行了全面梳理，从事前、事中、事后三个环节进一步加强对投资风险、运作风险和合规风险的控制。与此同时，公司通过部门协调会的形式，定期不定期地讨论投资过程中涉及其他部门的运作风险和合规风险，提出解决方案，制定防范措施，确保了基金投资运作的正常、顺利地进行。

#### 2、细化后台工作流程，加强运营风险管理。

2009年，公司以后台运作协调小组为依托，定期和不定期对公司运营中出现的问题进行磋商并提出解决方案，学习研究新业务、新流程，把握业务本质，提高服务质量。后台运营部门为前台提供支持和服务的意识在2009年得到进一步提高，后台部门在协助前台对相关风险进行管理的能力和效率显著提高，通过积极主动的风险提示、协调沟通等形式，公司前后台部门间的配合更加顺畅。

#### 3、提高公司员工法律意识、强调有效风险管理下的基金投资。

公司组织相关人员对不时公布的法律法规进行学习、培训，并通过考试检查学习效果。2009年，公司监察稽核部共组织了11次合规培训，培训人员包括投资、交易、研究、清算登记、销售、营销宣传、信息技术等与基金运作密切相关的业务人员。

#### 4、继续加强风险管理，做好风险绩效报告工作

2009年，公司通过定期报告的形式，运用科学方法对基金投资的流动性风险、市场风险、公平性交易等方面进行定量分析评估，为管理投资风险提供科学、客观的决策依据。

我们认为，建立并切实运行科学严密的内部控制体系，对揭示和防范风险，保障基金投资的科学、高效，提高公司管理水平至关重要。我们将继续高度重视防范各种风险，不断完善和优化操作流程，充实和改进内控技术方法与手段，提高内部监察工作的科学性和效率性，切实保障基金运作的安全。

### 4.7 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投资基金行业从业经验。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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金《基金合同》约定：“如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配”，本基金本期已实现收益、期末可供分配利润均为负数，则本基金本期不进行收益分配。

### § 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

2009 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

2009 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的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。个别工作日，托管人发现个别监督指标不符合基金合同的约定，托管人及时通知了基金管理人，基金管理人根据规定进行了调整。本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 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

2009 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。

交通银行股份有限公司资产托管部  
2009 年 3 月 25 日

### § 6 审计报告

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	富国天益价值证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的富国天益价值证券投资基金（以下简称“富国天益基金”）财务报表，包括 2009 年 12 月 31 日的资产负债表和 2009 年度的利润表及所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	按照企业会计准则的规定编制财务报表

	是富国天益基金的基金管理人富国基金管理有限公司的责任。这种责任包括：(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；(2) 选择和运用恰当的会计政策；(3) 作出合理的会计估计。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，富国天益基金财务报表已经按照企业会计准则的规定编制，在所有重大方面公允反映了富国天益基金 2009 年 12 月 31 日的财务状况以及 2009 年度的经营成果和净值变动情况。
注册会计师的姓名	严盛炜   戴维维
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所
会计师事务所的地址	中国 北京
审计报告日期	2010 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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：2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
<b>资 产:</b>		
银行存款	450,097.01	26,834,041.48
结算备付金	416,468,229.66	900,398,025.73
存出保证金	1,750,872.42	601,282.05
交易性金融资产	11,962,206,573.82	9,878,864,286.98
其中: 股票投资	11,372,823,156.22	6,925,813,665.31
基金投资	—	—
债券投资	589,383,417.60	2,953,050,621.67
资产支持证券投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	—	—
应收证券清算款	414,631,758.31	—
应收利息	6,788,545.36	35,502,814.01
应收股利	—	—
应收申购款	2,524,171.71	33,988,797.84
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	12,804,820,248.29	10,876,189,248.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>本期末 (2009年12月31日)</b>	<b>上年度末 (2008年12月31日)</b>
<b>负 债:</b>		
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	—	10,724,005.38
应付赎回款	25,458,205.88	7,698,050.61
应付管理人报酬	15,686,948.43	14,006,432.59
应付托管费	2,614,491.40	2,334,405.42
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	5,386,280.95	444,360.83
应交税费	434,180.80	72,056.00
应付利息	11,501.38	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	421,041.53	421,206.39
负债合计	350,012,650.37	35,700,517.22
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	13,003,464,161.44	16,947,064,110.93
未分配利润	-548,656,563.52	-6,106,575,380.06
所有者权益合计	12,454,807,597.92	10,840,488,730.87

负债和所有者权益总计	12,804,820,248.29	10,876,189,248.09
------------	-------------------	-------------------

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9578 元，基金份额总额 13003464161.44 份。

## 7.2 利润表

会计主体：富国天益价值证券投资基金

本报告期：2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 (2009 年 01 月 01 日至 2009 年 12 月 31 日)	上年度可比期间 (2008 年 01 月 01 日至 2008 年 12 月 31 日)
<b>一、收入</b>	5,063,696,328.22	-8,468,936,034.65
1. 利息收入	52,751,462.57	87,824,309.59
其中：存款利息收入	8,248,711.72	17,841,643.46
债券利息收入	44,353,061.71	66,841,212.59
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	149,689.14	3,141,453.54
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-1,308,301,729.82	-1,139,914,798.29
其中：股票投资收益	-1,514,450,081.61	-1,265,286,138.51
基金投资收益	—	—
债券投资收益	127,589,494.28	2,830,909.27
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	766,787.99	20,944,405.64
股利收益	77,792,069.52	101,596,025.31
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6,316,448,394.04	-7,421,601,865.62
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,798,201.43	4,756,319.67
<b>减：二、费用</b>	235,920,331.51	277,294,663.07
1. 管理人报酬	178,751,800.56	210,621,802.29
2. 托管费	29,791,966.74	35,103,633.71
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	25,403,491.84	27,414,781.78
5. 利息支出	1,520,688.82	3,664,294.20
其中：卖出回购金融资产支出	1,520,688.82	3,664,294.20
6. 其他费用	452,383.55	490,151.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>	4,827,775,996.71	-8,746,230,697.72
减：所得税费用	—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>	4,827,775,996.71	-8,746,230,697.72



### 7.3 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：2009年01月01日至2009年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 (2009年01月01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）	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）	—	4,827,775,996.71	4,827,775,996.71
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）	-3,943,599,949.49	730,142,819.83	-3,213,457,129.66
其中：1. 基金申购款	3,151,916,987.56	-645,938,527.17	2,505,978,460.39
2. 基金赎回款	-7,095,516,937.05	1,376,081,347.00	-5,719,435,590.05
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）	13,003,464,161.44	-548,656,563.52	12,454,807,597.92
项目	上年度可比期间 (2008年01月01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）	11,753,114,848.02	1,631,487,422.09	13,384,602,270.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-8,746,230,697.72	-8,746,230,697.72
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）	5,193,949,262.91	1,008,167,895.57	6,202,117,158.48
其中：1. 基金申购款	12,889,072,738.76	-203,163,259.33	12,685,909,479.43
2. 基金赎回款	-7,695,123,475.85	1,211,331,154.90	-6,483,792,320.95
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）	16,947,064,110.93	-6,106,575,380.06	10,840,488,730.87

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 基金基本情况

富国天益价值证券投资基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2004]38号文《关于同意富国天益价值证券投资基金设立的批复》的核准,由富国基金管理有限公司作为发起人向社会公开发行募集,基金合同于2004年6月15日正式生效,首次设立募集规模为1,033,718,023.69份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记人为富国基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金投资范围仅限于具有良好流动性的金融工具,包括投资于国内依法公开发行、上市的股票和债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。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。本基金原则上的资产配置比例为:股票40%-95%,债券和短期金融工具5%-60%。本基金的业绩比较基准为95%的中信标普300指数+5%的中信国债指数。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部2006年2月颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》及其他中国证监会颁布的相关规定。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2009年12月31日的财务状况以及2009年度的经营成果和净值变动情况。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；

本基金目前持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具（主要系权证投资）；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该金融资产已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；金融资产转移，是指本基金将金融资产让与或交付给该金融资产发行方以外的另一方（转入方）；本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债；

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

##### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益；

卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### (3)权证投资

买入权证于成交日确认为权证投资。权证投资成本按成交日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于成交日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于成交日结转；

### (4)分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

### (5)回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

## 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指在公平交易中熟悉情况的交易双方自愿进行资产交换或者债务清偿的金额。存在活跃市场的金融资产或金融负债以活跃市场中的报价确定公允价值。不存在活跃市场的金融资产或金融负债采用估值技术确定公允价值。采用估值技术得出的结果反映估值日在公平交易中可能采用的交易价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。本基金以上述原则确定的公允价值进行估值，本基金主要金融工具的估值方法如下：

### 1.股票投资

#### (1)上市流通的股票的估值

上市流通的股票按估值日该股票在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

#### (2)未上市的股票的估值

A.送股、转增股、公开增发新股或配股的股票，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

B.首次公开发行的股票，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按其成本价计算；

首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，以其在证券交易所挂牌的同一证券估值日的估值方法估值；

#### C.非公开发行有明确锁定期的股票的估值

本基金投资的非公开发行的股票按以下方法估值：

a. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价低于非公开发行股票初始取得成本时，采用在证券交易所的同一股票的市价作为估值日该非公开发行股票的价值；

b. 估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价高于非公开发行股票初始取得成本时，按中国证监会相关规定处理。

### 2.债券投资

(1)证券交易所市场实行净价交易的债券按估值日收盘价估值。估值日无交易的且最近

交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 证券交易所市场未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日债券收盘净价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(3) 未上市债券、交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

(4) 在全国银行间债券市场交易的债券、资产支持证券等固定收益品种，采用估值技术确定公允价值；

### 3. 权证投资

(1) 上市流通的权证按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值。估值日无交易的且最近交易日后经济环境未发生重大变化，按最近交易日的收盘价估值；如最近交易日后经济环境发生了重大变化的，可参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价格。如有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值，调整最近交易市价，确定公允价格；

(2) 未上市流通的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；

(3) 因持有股票而享有的配股权证，采用估值技术确定公允价值进行估值；

### 4. 分离交易可转债

分离交易可转债，上市日前，采用估值技术分别对债券和权证进行估值；自上市日起，上市流通的债券和权证分别按上述 2)、3) 中的相关原则进行估值；

### 5. 其他

(1) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映金融资产公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(2) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回

款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6)债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7)衍生工具收益/(损失)于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9)公允价值变动收益/(损失)系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10)其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1)基金管理费按前一日基金资产净值的 1.50%的年费率逐日计提；

(2)基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率逐日计提；

(3)卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

(4)其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1)基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；

(2)本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3)基金收益分配每年至少一次，成立不满三个月，收益不分配；

(4)基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

(5)基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；

(6)如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

(7)每一基金份额享有同等分配权。

(8)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末（2009年12月31日）	上年度末（2008年12月31日）
活期存款	450,097.01	26,834,041.48
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	450,097.01	26,834,041.48

注：本基金本期及上年度可比期间均未投资于定期存款。

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末（2009年12月31日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		9,936,434,023.56	11,372,823,156.22	1,436,389,132.66
债券	交易所市场	341,662,382.72	341,583,417.60	-78,965.12
	银行间市场	247,801,950.00	247,800,000.00	-1,950.00
	合计	589,464,332.72	589,383,417.60	-80,915.12
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		10,525,898,356.28	11,962,206,573.82	1,436,308,217.54
项目		上年度末（2008年12月31日）		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		11,975,380,939.88	6,925,813,665.31	-5,049,567,274.57
债券	交易所市场	1,463,944,023.60	1,564,854,621.67	100,910,598.07
	银行间市场	1,319,679,500.00	1,388,196,000.00	68,516,500.00
	合计	2,783,623,523.60	2,953,050,621.67	169,427,098.07
资产支持证券		—	—	—
其他		—	—	—
合计		14,759,004,463.48	9,878,864,286.98	-4,880,140,176.50

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末及上年度可比期末均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中的债券。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元



项目	本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
应收活期存款利息	56,301.87	60,156.40
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	139,980.07	155,041.02
应收债券利息	6,592,227.12	35,287,570.99
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
其他	36.30	45.60
合计	6,788,545.36	35,502,814.01

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
交易所市场应付交易费用	5,380,796.20	441,260.83
银行间市场应付交易费用	5,484.75	3,100.00
合计	5,386,280.95	444,360.83

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
应付券商交易单元保证金	250,000.00	250,000.00
应付赎回费	51,041.53	21,206.39
预提审计费	120,000.00	150,000.00
合计	421,041.53	421,206.39

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 (2009年01月01日至2009年12月31日)	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	16,947,064,110.93	16,947,064,110.93
本期申购	3,151,916,987.56	3,151,916,987.56
本期赎回 (以“-”号填列)	-7,095,516,937.05	-7,095,516,937.05
本期末	13,003,464,161.44	13,003,464,161.44

注：本年申购含转换入份额，赎回含转换出份额

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,212,751,726.17	-4,893,823,653.89	-6,106,575,380.06
本期利润	-1,488,672,397.33	6,316,448,394.04	4,827,775,996.71
本期基金份额交易产生的变动数	579,780,237.65	150,362,582.18	730,142,819.83

其中：基金申购款	-459,983,522.16	-185,955,005.01	-645,938,527.17
基金赎回款	1,039,763,759.81	336,317,587.19	1,376,081,347.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-2,121,643,885.85	1,572,987,322.33	-548,656,563.52

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
活期存款利息收入	2,268,014.84	9,865,306.29
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	5,942,165.68	7,349,447.35
其他	38,531.20	626,889.82
合计	8,248,711.72	17,841,643.46

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
卖出股票成交总额	8,567,209,585.50	1,493,806,346.81
减：卖出股票成本总额	10,081,659,667.11	2,759,092,485.32
买卖股票差价收入	-1,514,450,081.61	-1,265,286,138.51

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
卖出债券(、含债转股及债券到期兑付)成交总额	3,331,945,891.59	1,611,117,013.06
减：卖出债券(、含债转股及债券到期兑付)成本总额	3,144,993,709.72	1,581,773,675.81
减：应收利息总额	59,362,687.59	26,512,427.98
债券投资收益	127,589,494.28	2,830,909.27

#### 7.4.7.14 衍生工具收益——买卖权证差价收入

单位：人民币元

项目	本期发生(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
卖出权证成交总额	2,263,953.55	87,519,751.26
减：卖出权证成本总额	1,497,165.56	66,575,345.62
买卖权证差价收入	766,787.99	20,944,405.64

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
股票投资产生的股利收益	77,792,069.52	101,596,025.31
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	77,792,069.52	101,596,025.31

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期发生(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
1. 交易性金融资产	6,316,448,394.04	-7,419,962,507.83
股票投资	6,485,956,407.23	-7,579,048,011.49
债券投资	-169,508,013.19	159,085,503.66
资产支持证券投资	—	—
基金投资	—	—
2. 衍生工具	—	-1,639,357.79
权证投资	—	-1,639,357.79
3. 其他	—	—
合计	6,316,448,394.04	-7,421,601,865.62

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
基金赎回费收入	2,456,656.91	4,332,307.89
基金转换费收入	329,135.57	375,366.13
其他	12,408.95	48,645.65
合计	2,798,201.43	4,756,319.67

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
交易所市场交易费用	25,394,691.84	27,401,881.78
银行间市场交易费用	8,800.00	12,900.00
合计	25,403,491.84	27,414,781.78

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
审计费用	120,000.00	150,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行划款费用	14,383.55	22,151.09
债券账户维护费	18,000.00	18,000.00

合计	452,383.55	490,151.09
----	------------	------------

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需做披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 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、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
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
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01日至2008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	983,657,304.29	6.00	1,139,956,441.41	14.57
申银万国	2,724,731,832.20	16.62	1,850,366,416.22	23.64

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本年度及上年度未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01日至2008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	228,601,978.70	12.80	47,659,974.30	2.15
申银万国	208,213,472.75	11.65	390,693,459.80	17.59

#### 7.4.10.1.4 回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01日至2008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(%)
申银万国	—	—	1,072,200,000.00	16.77

注：本基金本年度未通过关联方交易单元进行回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期(2009年01月01日至2009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	836,107.83	6.08	253,677.50	4.71
申银万国	2,236,186.04	16.26	856,302.83	15.91
关联方名称	上年度可比期间(2008年01月01日至2008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	968,960.91	14.79	37,152.68	8.42
申银万国	1,552,826.42	23.70	83,472.39	18.92

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
当期发生的基金应支付的管理费	178,751,800.56	210,621,802.29
其中：支付销售机构的客户维护费	34,717,303.91	40,481,033.06

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：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期(2009年01月01日至2009年12月31日)	上年度可比期间(2008年01月01日至2008年12月31日)
当期发生的基金应支付的托管费	29,791,966.74	35,103,633.71

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：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

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。

#### 7.4.10.3 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(2009年01月01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
交通银行股份有限公司	—	363,715,851.38	—	—	—	—
上年度可比期间(2008年01月01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	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
—	—	—	—	—	—	—

注：本基金2008年度未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人2009年度及2008年度均未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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：本基金除基金管理人之外的其他关联方于2009年年末和2008年年末均未投资本基金。

#### 7.4.10.5 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01月01日至2009年12月31日)		上年度可比期间(2008年01月01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
交通银行股份有限公司	450,097.01	2,268,014.84	26,834,041.48	9,865,306.29

注：本基金本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2009年末为416,468,229.66元，2008年末为900,398,025.73元。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金于2009年度及2008年度未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金 2009 年度及 2008 年度均无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金 2009 年度未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2009 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1.1 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
002024	苏宁电器	2009-12-30	2010-12-31	非公开发行	17.20	17.23	6,200,000	106,640,000.00	106,826,000.00	—
002299	圣农发展	2009-10-13	2010-01-21	认购新发 证券	19.75	25.03	64,239	1,268,720.25	1,607,902.17	—
002300	太阳电缆	2009-10-13	2010-01-21	认购新发 证券	20.56	33.33	48,535	997,879.60	1,617,671.55	—
002301	齐心文具	2009-10-14	2010-01-21	认购新发 证券	20.00	35.20	35,656	713,120.00	1,255,091.20	—
002308	威创股份	2009-11-18	2010-03-01	认购新发 证券	23.80	31.83	56,492	1,344,509.60	1,798,140.36	—
002310	东方园林	2009-11-20	2010-03-01	认购新发 证券	58.60	110.88	13,914	815,360.40	1,542,784.32	—
300001	特锐德	2009-09-29	2010-02-01	认购新发 证券	23.80	42.24	89,582	2,132,051.60	3,783,943.68	—
300002	神州泰岳	2009-09-29	2010-02-01	认购新发 证券	58.00	105.20	71,753	4,161,674.00	7,548,415.60	—
300003	乐普医疗	2009-09-29	2010-02-01	认购新发 证券	29.00	51.20	70,615	2,047,835.00	3,615,488.00	—
300005	探路者	2009-09-29	2010-02-01	认购新发 证券	19.80	43.17	29,177	577,704.60	1,259,571.09	—
300007	汉威电子	2009-09-29	2010-02-01	认购新发 证券	27.00	44.01	42,313	1,142,451.00	1,862,195.13	—
300010	立思辰	2009-09-29	2010-02-01	认购新发 证券	18.00	32.79	91,947	1,655,046.00	3,014,942.13	—
300012	华测检测	2009-10-15	2010-02-01	认购新发 证券	25.78	43.14	39,828	1,026,765.84	1,718,179.92	—
300013	新宁物流	2009-10-15	2010-02-01	认购新发 证券	15.60	32.75	37,656	587,433.60	1,233,234.00	—
300015	爱尔眼科	2009-10-15	2010-02-01	认购新发 证券	28.00	48.80	38,568	1,079,904.00	1,882,118.40	—

300017	网宿科技	2009-10-15	2010-02-01	认购新发 证券	24.00	42.71	37,544	901,056.00	1,603,504.24	—
300019	硅宝科技	2009-10-15	2010-02-01	认购新发 证券	23.00	43.74	41,754	960,342.00	1,826,319.96	—
300022	吉峰农机	2009-10-19	2010-02-01	认购新发 证券	17.75	60.75	73,717	1,308,476.75	4,478,307.75	—
300023	宝德股份	2009-10-19	2010-02-01	认购新发 证券	19.60	38.68	55,555	1,088,878.00	2,148,867.40	—
300024	机器人	2009-10-19	2010-02-01	认购新发 证券	39.80	72.28	26,015	1,035,397.00	1,880,364.20	—
300026	红日药业	2009-10-19	2010-02-01	认购新发 证券	60.00	91.20	30,148	1,808,880.00	2,749,497.60	—
300027	华谊兄弟	2009-10-19	2010-02-01	认购新发 证券	28.58	55.43	55,552	1,587,676.16	3,079,247.36	—
300030	阳普医疗	2009-12-18	2010-03-26	认购新发 证券	25.00	35.10	20,990	524,750.00	736,749.00	—
300034	钢研高纳	2009-12-18	2010-03-25	认购新发 证券	19.53	34.53	39,466	770,770.98	1,362,760.98	—
300037	新宙邦	2009-12-28	2010-04-08	认购新发 证券	28.99	28.99	71,240	2,065,247.60	2,065,247.60	—
300040	九洲电气	2009-12-28	2010-04-08	认购新发 证券	33.00	33.00	62,578	2,065,074.00	2,065,074.00	—
601888	中国国旅	2009-09-25	2010-01-15	认购新发 证券	11.78	20.94	131,060	1,543,886.80	2,744,396.40	—

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌的股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无银行间市场债券正回购。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币 300,000,000.00 元，于 2010 年 1 月 7 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额



及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此，除在 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括其他价格风险、利率风险和外汇风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、权证存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

单位：人民币元

本期末（2009年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	450,097.01	—	—	—	—	—	450,097.01
结算备付金	416,468,229.66	—	—	—	—	—	416,468,229.66
存出保证金	103,913.63	—	—	—	—	1,646,958.79	1,750,872.42
交易性金融资产	—	149,520,000.00	439,863,417.60	—	—	11,372,823,156.22	11,962,206,573.82
应收证券清算款	—	—	—	—	—	414,631,758.31	414,631,758.31
应收利息	—	—	—	—	—	6,788,545.36	6,788,545.36
应收申购款	2,524,171.71	—	—	—	—	—	2,524,171.71
资产总计	419,546,412.01	149,520,000.00	439,863,417.60	—	—	11,795,890,418.68	12,804,820,248.29
负债							
卖出回购金融资产款	300,000,000.00	—	—	—	—	—	300,000,000.00
应付赎回款	—	—	—	—	—	25,458,205.88	25,458,205.88
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	15,686,948.43	15,686,948.43
应付托管费	—	—	—	—	—	2,614,491.40	2,614,491.40
应付交易费用	—	—	—	—	—	5,386,280.95	5,386,280.95
应付税费	—	—	—	—	—	434,180.80	434,180.80
应付利息	—	—	—	—	—	11,501.38	11,501.38
其他负债	—	—	—	—	—	421,041.53	421,041.53
负债总计	300,000,000.00	—	—	—	—	50,012,650.37	350,012,650.37
利率敏感度缺口	119,546,412.01	149,520,000.00	439,863,417.60	—	—	11,745,877,768.31	12,454,807,597.92
上年度末（2008年12月31日）	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计

月 31 日)							
资产							
银行存款	26,834,041.48	—	—	—	—	—	26,834,041.48
结算备付金	900,398,025.73	—	—	—	—	—	900,398,025.73
存出保证金	101,282.05	—	—	—	—	500,000.00	601,282.05
交易性金融资产	96,240,000.00	96,770,000.00	445,810,278.90	1,872,602,645.57	441,627,697.20	6,925,813,665.31	9,878,864,286.98
应收利息	—	—	—	—	—	35,502,814.01	35,502,814.01
应收申购款	33,988,797.84	—	—	—	—	—	33,988,797.84
资产总计	1,057,562,147.10	96,770,000.00	445,810,278.90	1,872,602,645.57	441,627,697.20	6,961,816,479.32	10,876,189,248.09
负债							
应付证券清算款	—	—	—	—	—	10,724,005.38	10,724,005.38
应付赎回款	—	—	—	—	—	7,698,050.61	7,698,050.61
应付管理人报酬	—	—	—	—	—	14,006,432.59	14,006,432.59
应付托管费	—	—	—	—	—	2,334,405.42	2,334,405.42
应付交易费用	—	—	—	—	—	444,360.83	444,360.83
应付税费	—	—	—	—	—	72,056.00	72,056.00
其他负债	—	—	—	—	—	421,206.39	421,206.39
负债总计	—	—	—	—	—	35,700,517.22	35,700,517.22
利率敏感度缺口	1,057,562,147.10	96,770,000.00	445,810,278.90	1,872,602,645.57	441,627,697.20	6,926,115,962.10	10,840,488,730.87

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

下表为利率风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

假设	1. 影响生息资产公允价值的其他变量不变，仅利率发生变动 2. 利率变动范围合理		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：千元）	
		本期末（2009年12月31日）	上年度末（2008年12月31日）
	1. 基准点利率增加0.1%	-223.87	-8,500.89
2. 基准点利率减少0.1%	223.87	8,500.89	

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

本基金投资组合中股票最高可达到基金资产净值的95%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值5%。于2009年12月31日和2008年12月31日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

金额单位：人民币元

项目	本期末（2009年12月31日）		上年度末（2008年12月31日）	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	11,372,823,156.22	91.31	6,925,813,665.31	63.89
交易性金融资产—债券投资	589,383,417.60	4.73	2,953,050,621.67	27.24
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	11,962,206,573.82	96.04	9,878,864,286.98	91.13

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金管理人运用资产-资本定价模型（CAPM）对本基金的市场价格风险进行分析。下表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，业绩比较基准所对应的市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金净值产生的影响。

假设	1. 基金的市场价格风险主要源于市场的系统性风险，即与基金的贝塔系数紧密相关； 2. 以下分析，除业绩比较基准发生变动，其他影响基金资产公允价值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：千元）	
		本期末（2009年12月31日）	上年度末（2008年12月31日）
	业绩比较基准减少1%	-86,243.91	-68,488.30
业绩比较基准增加1%	86,243.91	68,488.30	

7.4.14 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	11,372,823,156.22	88.82
	其中：股票	11,372,823,156.22	88.82
2	固定收益投资	589,383,417.60	4.60
	其中：债券	589,383,417.60	4.60
	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	416,918,326.67	3.26
6	其他各项资产	425,695,347.80	3.32
7	合计	12,804,820,248.29	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	1,607,902.17	0.01

B	采掘业	718,913,130.26	5.77
C	制造业	4,886,319,274.36	39.23
C0	食品、饮料	1,428,396,645.92	11.47
C1	纺织、服装、皮毛	19,735,225.69	0.16
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	118,494,763.00	0.95
C4	石油、化学、塑胶、塑料	424,720,343.73	3.41
C5	电子	123,486,131.78	0.99
C6	金属、非金属	1,286,664,054.98	10.33
C7	机械、设备、仪表	886,699,863.19	7.12
C8	医药、生物制品	537,073,916.18	4.31
C99	其他制造业	61,048,329.89	0.49
D	电力、煤气及水的生产和供应业	57,438,940.95	0.46
E	建筑业	146,011,727.76	1.17
F	交通运输、仓储业	182,480,435.79	1.47
G	信息技术业	1,209,825,408.22	9.71
H	批发和零售贸易	1,177,935,629.18	9.46
I	金融、保险业	2,407,772,446.49	19.33
J	房地产业	188,212,424.92	1.51
K	社会服务业	52,600,073.12	0.42
L	传播与文化产业	45,674,789.36	0.37
M	综合类	298,030,973.64	2.39
	合计	11,372,823,156.22	91.31

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	6,001,362	1,019,151,294.84	8.18
2	002024	苏宁电器	50,098,539	1,019,037,640.42	8.18
3	600585	海螺水泥	10,618,228	529,424,848.08	4.25
4	601318	中国平安	9,553,922	526,325,562.98	4.23
5	600050	中国联通	55,462,097	404,318,687.13	3.25
6	600016	民生银行	50,423,490	398,849,805.90	3.20
7	002028	思源电气	14,492,146	389,548,884.48	3.13
8	600271	航天信息	18,290,169	370,924,627.32	2.98
9	601166	兴业银行	9,000,000	362,790,000.00	2.91
10	002153	石基信息	9,100,850	300,146,033.00	2.41
11	601601	中国太保	11,093,564	284,217,109.68	2.28
12	000001	深发展A	10,760,885	262,242,767.45	2.11
13	000898	鞍钢股份	16,049,258	256,788,128.00	2.06
14	000401	冀东水泥	12,800,817	247,055,768.10	1.98

15	600036	招商银行	13,001,619	234,679,222.95	1.88
16	601169	北京银行	12,000,000	232,080,000.00	1.86
17	600031	三一重工	6,085,739	224,016,052.59	1.80
18	600583	海油工程	19,177,773	218,626,612.20	1.76
19	000423	东阿阿胶	7,883,350	206,149,602.50	1.66
20	000024	招商地产	7,067,684	188,212,424.92	1.51
21	600415	小商品城	4,000,000	178,920,000.00	1.44
22	601766	中国南车	30,000,273	170,701,553.37	1.37
23	600309	烟台万华	7,089,482	170,218,462.82	1.37
24	000869	张裕A	2,119,981	161,160,955.62	1.29
25	000538	云南白药	2,452,425	148,126,470.00	1.19
26	601668	中国建筑	30,607,827	144,468,943.44	1.16
27	600009	上海机场	8,289,515	144,403,351.30	1.16
28	000858	五粮液	4,509,806	142,780,457.96	1.15
29	601088	中国神华	3,895,862	135,653,914.84	1.09
30	601001	大同煤业	3,009,909	135,415,805.91	1.09
31	600858	银座股份	4,584,718	119,110,973.64	0.96
32	000063	中兴通讯	2,582,737	115,887,409.19	0.93
33	000718	苏宁环球	8,389,013	115,013,368.23	0.92
34	601958	金钼股份	5,828,134	111,084,234.04	0.89
35	000895	双汇发展	1,983,125	105,303,937.50	0.85
36	600231	凌钢股份	7,999,956	104,159,427.12	0.84
37	600315	上海家化	3,055,810	100,536,149.00	0.81
38	002106	莱宝高科	4,007,916	97,793,150.40	0.79
39	000792	盐湖钾肥	1,600,275	91,199,672.25	0.73
40	002022	科华生物	4,005,255	87,675,031.95	0.70
41	601699	潞安环能	1,487,354	77,015,190.12	0.62
42	600276	恒瑞医药	1,384,383	72,680,107.50	0.58
43	000959	首钢股份	9,969,905	59,919,129.05	0.48
44	002215	诺普信	1,899,790	58,874,492.10	0.47
45	600015	华夏银行	4,700,000	58,374,000.00	0.47
46	000061	农产品	4,179,002	58,004,547.76	0.47
47	601918	国投新集	3,199,941	57,438,940.95	0.46
48	002140	东华科技	1,106,588	46,255,378.40	0.37
49	000778	新兴铸管	3,572,495	44,406,112.85	0.36
50	600511	国药股份	1,726,609	44,201,190.40	0.35
51	600037	歌华有线	3,001,800	42,595,542.00	0.34
52	000417	合肥百货	2,601,650	38,166,205.50	0.31
53	601998	中信银行	4,493,447	36,981,068.81	0.30
54	002122	天马股份	1,082,127	31,630,572.21	0.25
55	601299	中国北车	5,000,000	30,650,000.00	0.25

56	600208	新湖中宝	3,076,813	30,552,753.09	0.25
57	002003	伟星股份	1,426,360	30,495,576.80	0.24
58	600553	太行水泥	2,954,156	29,984,683.40	0.24
59	600563	法拉电子	1,477,497	24,319,600.62	0.20
60	000937	金牛能源	500,000	20,800,000.00	0.17
61	000338	潍柴动力	319,888	20,626,378.24	0.17
62	000983	西山煤电	509,335	20,317,373.15	0.16
63	600591	*ST 上航	2,667,451	19,178,972.69	0.15
64	600428	中远航运	1,674,396	17,664,877.80	0.14
65	600987	航民股份	1,772,873	15,938,128.27	0.13
66	000759	武汉中百	1,068,269	14,047,737.35	0.11
67	002088	鲁阳股份	554,154	12,800,957.40	0.10
68	601788	光大证券	440,161	11,232,908.72	0.09
69	002007	华兰生物	190,801	10,574,191.42	0.08
70	300002	神州泰岳	71,753	7,548,415.60	0.06
71	600521	华海药业	216,520	5,629,520.00	0.05
72	300022	吉峰农机	73,717	4,478,307.75	0.04
73	300001	特锐德	89,582	3,783,943.68	0.03
74	300003	乐普医疗	70,615	3,615,488.00	0.03
75	300027	华谊兄弟	55,552	3,079,247.36	0.02
76	300010	立思辰	91,947	3,014,942.13	0.02
77	300026	红日药业	30,148	2,749,497.60	0.02
78	601888	中国国旅	131,060	2,744,396.40	0.02
79	002177	御银股份	150,000	2,323,500.00	0.02
80	300023	宝德股份	55,555	2,148,867.40	0.02
81	300037	新宙邦	71,240	2,065,247.60	0.02
82	300040	九洲电气	62,578	2,065,074.00	0.02
83	002291	星期六	86,422	2,060,300.48	0.02
84	002294	信立泰	21,680	1,923,666.40	0.02
85	300015	爱尔眼科	38,568	1,882,118.40	0.02
86	300024	机器人	26,015	1,880,364.20	0.02
87	300007	汉威电子	42,313	1,862,195.13	0.01
88	300019	硅宝科技	41,754	1,826,319.96	0.01
89	002115	三维通信	70,264	1,812,811.20	0.01
90	002308	威创股份	56,492	1,798,140.36	0.01
91	002293	罗莱家纺	42,299	1,736,796.94	0.01
92	300012	华测检测	39,828	1,718,179.92	0.01
93	002300	太阳电缆	48,535	1,617,671.55	0.01
94	002299	圣农发展	64,239	1,607,902.17	0.01
95	300017	网宿科技	37,544	1,603,504.24	0.01
96	002275	桂林三金	55,783	1,565,828.81	0.01



97	002310	东方园林	13,914	1,542,784.32	0.01
98	300034	钢研高纳	39,466	1,362,760.98	0.01
99	300005	探路者	29,177	1,259,571.09	0.01
100	002301	齐心文具	35,656	1,255,091.20	0.01
101	300013	新宁物流	37,656	1,233,234.00	0.01
102	002278	神开股份	39,497	1,022,972.30	0.01
103	002292	奥飞动漫	22,752	966,732.48	0.01
104	002288	超华科技	32,819	893,333.18	0.01
105	002295	精艺股份	31,760	762,240.00	0.01
106	300030	阳普医疗	20,990	736,749.00	0.01
107	002296	辉煌科技	9,585	621,970.65	0.00
108	002298	鑫龙电器	22,167	516,934.44	0.00
109	002289	宇顺电子	14,211	480,047.58	0.00
110	601989	中国重工	13,000	101,530.00	0.00

#### 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	600050	中国联通	601,460,696.55	5.55
2	601318	中国平安	581,803,235.41	5.37
3	600016	民生银行	412,022,087.91	3.80
4	600036	招商银行	288,088,712.24	2.66
5	600585	海螺水泥	280,372,505.41	2.59
6	600030	中信证券	277,019,816.13	2.56
7	601166	兴业银行	256,270,402.00	2.36
8	000401	冀东水泥	232,169,647.88	2.14
9	000001	深发展A	231,500,149.34	2.14
10	600031	三一重工	213,100,859.46	1.97
11	601169	北京银行	195,897,461.46	1.81
12	601601	中国太保	175,143,572.62	1.62
13	601668	中国建筑	171,962,047.03	1.59
14	002024	苏宁电器	171,392,107.39	1.58
15	000002	万科A	160,575,450.48	1.48
16	601628	中国人寿	156,715,382.12	1.45
17	601766	中国南车	152,160,826.42	1.40
18	601001	大同煤业	138,401,792.30	1.28
19	000858	五粮液	136,682,412.90	1.26
20	000024	招商地产	134,512,521.69	1.24

注：“本期累计买入金额”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	002024	苏宁电器	757,222,730.08	6.99
2	600519	贵州茅台	452,680,199.27	4.18
3	600036	招商银行	422,292,093.42	3.90
4	600271	航天信息	405,819,556.87	3.74
5	000002	万科A	353,832,128.84	3.26
6	600050	中国联通	322,355,675.60	2.97
7	601628	中国人寿	294,705,177.41	2.72
8	600030	中信证券	294,111,515.56	2.71
9	000792	盐湖钾肥	289,743,048.71	2.67
10	601699	潞安环能	237,590,918.87	2.19
11	600585	海螺水泥	232,434,225.13	2.14
12	601006	大秦铁路	223,216,280.59	2.06
13	002022	科华生物	193,850,947.47	1.79
14	002028	思源电气	190,776,769.58	1.76
15	601398	工商银行	181,029,619.52	1.67
16	601318	中国平安	174,240,186.34	1.61
17	601169	北京银行	168,786,110.72	1.56
18	600028	中国石化	166,331,157.12	1.53
19	601088	中国神华	158,814,443.80	1.47
20	000063	中兴通讯	138,046,953.61	1.27

注：“本期累计卖出金额”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	8,042,712,750.79
卖出股票收入（成交）总额	8,567,209,585.50

注：“买入股票成本（成交）总额”和“卖出股票收入（成交）总额”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	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	386,837,504.00	3.11
2	央行票据	197,950,000.00	1.59
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	4,595,913.60	0.04
7	其他	—	—
8	合计	589,383,417.60	4.73

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	010004	20 国债(4)	3,343,130	336,987,504.00	2.71
2	0901065	09 央行票据 65	1,000,000	99,670,000.00	0.80
3	0901038	09 央行票据 38	1,000,000	98,280,000.00	0.79
4	099925	09 贴现国债 25	500,000	49,850,000.00	0.40
5	125969	安泰转债	13,200	1,976,964.00	0.02

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.9.2 申明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,750,872.42
2	应收证券清算款	414,631,758.31
3	应收股利	—
4	应收利息	6,788,545.36
5	应收申购款	2,524,171.71
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	425,695,347.80
---	----	----------------

#### 8.9.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002024	苏宁电器	106,826,000.00	0.86	非公开发行股票

#### 8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分。

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 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(%)
499006	26,058.73	1,566,763,272.90	12.05	11,436,700,888.54	87.95

#### 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	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	6,366,244.05	0.0490

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年06月15日)基金份额总额	1,033,718,023.69
报告期期初基金份额总额	16,947,064,110.93
本报告期基金总申购份额	3,151,916,987.56
减：本报告期基金总赎回份额	7,095,516,937.05
本报告期基金拆分变动份额	—

本报告期末基金份额总额	13,003,464,161.44
-------------	-------------------

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金没有召开基金份额持有人大会。

### 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

本报告期内经中国证监会核准，本基金基金管理人于 2009 年 6 月 4 日在中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站上公告聘任孟朝霞女士担任公司副总经理。

本报告期内本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

本报告期无涉及基金管理人、基金资产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金管理人没有改聘为其审计的会计师事务所，本基金本年度支付给审计机构安永华明会计师事务所的报酬为 12 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 7 年。

### 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

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员无受到监管部门稽查或处罚的情况。

### 11.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		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 (%)	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 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
安信证券	1	3,100,770,657.58	18.92	445,394,104.30	24.93	4,151,200,000.00	59.05	—	—	2,635,627.64	19.17	—
东方证券	1	341,694,739.79	2.08	—	—	—	—	—	—	290,441.15	2.11	—
高华证券	1	156,425,239.43	0.95	215,606,558.00	12.07	—	—	—	—	132,959.44	0.97	—
光大证券	1	1,136,285,979.58	6.93	353,463,814.80	19.79	742,000,000.00	10.55	—	—	965,838.92	7.02	—
广发华福	1	205,291,543.34	1.25	1,471,326.00	0.08	—	—	2,263,953.55	100.00	174,496.51	1.27	—
海通证券	1	983,657,304.29	6.00	228,601,978.70	12.80	—	—	—	—	836,107.83	6.08	—
恒泰证券	1	43,500,496.58	0.27	—	—	—	—	—	—	36,974.53	0.27	—
申银万国	2	2,724,731,832.20	16.62	208,213,472.75	11.65	—	—	—	—	2,236,186.04	16.26	—
西南证券	1	3,012,594,053.80	18.38	160,905,052.80	9.01	1,517,000,000.00	21.58	—	—	2,560,691.14	18.62	—
湘财证券	1	1,554,859,303.69	9.49	21,821,429.80	1.22	620,000,000.00	8.82	—	—	1,321,622.55	9.61	—
银河证券	1	375,903,772.71	2.29	119,991,128.60	6.72	—	—	—	—	319,516.23	2.32	—
中金公司	1	2,755,436,419.82	16.81	31,035,959.84	1.74	—	—	—	—	2,238,802.75	16.28	—

注：我公司对基金交易单元的选择是综合考虑券商的研究能力及其它相关因素后决定的。

本期内本基金租用券商交易单元的变更情况：向广发华福证券新租用上交所交易单元号 23030。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	富国基金管理有限公司关于恢复旗下基金产品持有的唐钢股份股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年01月05日
2	富国基金管理有限公司关于旗下基金持有的盐湖钾肥股票复牌后估值方法调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年01月07日
3	富国基金管理有限公司关于恢复旗下基金持有的长江电力股票市价估值方法的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年05月19日
4	富国基金管理有限公司关于旗下基金投资创业板证券及风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年09月23日
5	关于修改富国天利增长债券投资基金、富国天益价值证券投资基金基金合同的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、公司网站	2009年12月08日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金无影响投资者决策的其他重要事项。

## § 13 备查文件目录

备查文件名称	备查文件存放地点	备查文件查阅方式
1、中国证监会批准设立富国天益价值证券投资基金的文件	上海市浦东新区花园石桥路 33 号花旗集团大厦 5、6 层	投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人富国基金管理有限公司。 咨询电话：95105686、4008880688（全国统一，免长途话费） 公 司 网 址：
2、富国天益价值证券投资基金基金合同		
3、富国天益价值证券投资基金托管协议		
4、中国证监会批准设立		

<p>富国基金管理有限公司的文件</p> <p>5、富国天益价值证券投资基金财务报表及报表附注</p> <p>6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告</p>		<p><a href="http://www.fullgoal.com.cn">http://www.fullgoal.com.cn</a></p>
--	--	--