

汉兴证券投资基金
二 00 九年年度报告
(摘要)

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2009年1月1日起至2009年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	富国汉兴封闭
基金主代码	500015
基金运作方式	契约型封闭式
基金合同生效日	1999年12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
报告期末基金份额总额	3,000,000,000.00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	2000年1月10日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为平衡型证券投资基金，兼顾稳定收益和资本利得。即在投资于绩优型上市公司和债券的同时，兼顾成长型上市公司的投资，充分注重投资组合的流动性，从而为投资者减少和分散投资风险，确保基金资产的安全，谋求基金资产的长期稳定收益。
投资策略	坚持长期投资的同时加强波段操作，注重投资组合的长、中、短线相结合，适度投资、分散风险；根据行业研究的成果，在个股投资上注重挖掘个股价值和成长性，精选个股，强调组合的成长和价值的平衡。
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	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

§ 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	766,623,029.28	594,123,826.45	1,951,826,047.82
本期利润	1,749,814,391.28	-3,080,800,439.05	4,512,339,989.64
加权平均基金份额本期利润	0.5833	-1.0269	1.5041
本期基金份额净值增长率	55.12%	-43.73%	110.40%
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
期末可供分配基金份额利润	0.3353	0.1832	0.5507
期末基金资产净值	4,762,319,276.45	3,549,504,886.00	8,100,305,325.05
期末基金份额净值	1.5874	1.1832	2.7001

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。

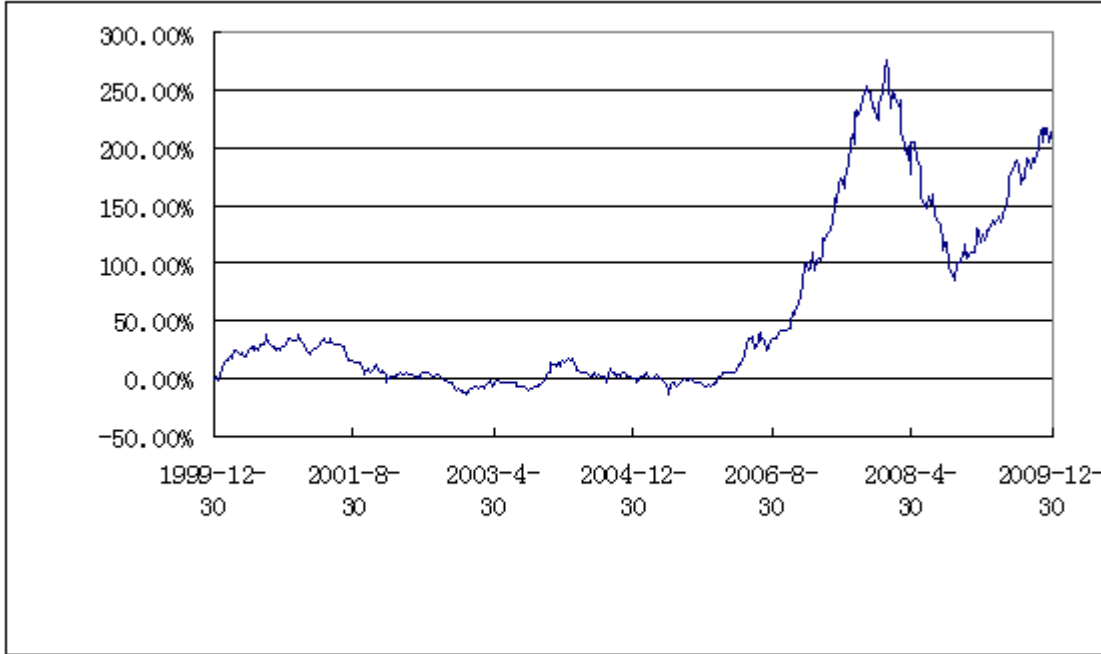
3.2 基金净值表现

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	12.51%	2.47%	—	—	—	—
过去六个月	18.03%	2.40%	—	—	—	—
过去一年	55.12%	2.38%	—	—	—	—
过去三年	83.65%	3.29%	—	—	—	—
过去五年	216.15%	2.98%	—	—	—	—
自基金合同生效日起至今	218.24%	2.61%	—	—	—	—

注：由于基金汉兴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。

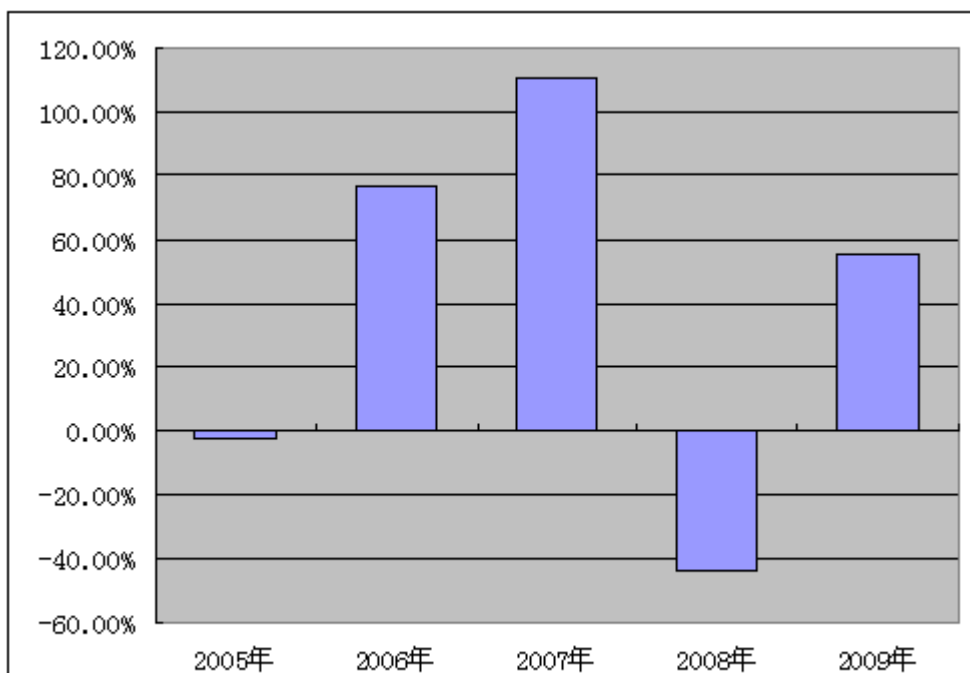
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：截止日期为 2009 年 12 月 31 日。由于基金汉兴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 12 月 30 日成立，建仓期 6 个月，从 1999 年 12 月 30 日至 2000 年 6 月 29 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：由于汉兴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
2009年	1.790	537,000,000.83	—	537,000,000.83	1次分红
2008年	4.900	1,470,000,000.00	—	1,470,000,000.00	1次分红
2007年	3.216	964,799,999.70	—	964,799,999.70	2次分红
合计	9.906	2,971,800,000.53	—	2,971,800,000.53	4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		
许达	本基金基金经理	2006-12-19	—	12 年	硕士，曾任申银万国证券研究所行业分析师。2001.2 至今任富国基金管理有限公司研究员、基金经理助理，现任汉兴基金基金经理。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汉兴证券投资基金的管理人严格按照《基金法》、《证券法》、《汉兴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，以为投资者减少和分散风险，确保基金资产的安全并谋求基金长期稳定收益为目标，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，严格执行交易系统内的公平交易程序，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

本基金管理人旗下无其他投资风格相似的投资组合。

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

本基金年初制定了相对保守的投资策略：一是股票资产比例过低，“在大类资产配置

上，我们依然倾向于保持较低的股票资产比例，待有经济转好的信号或估值相对便宜时再增加股票比例”；二是周期性股票比例过少，“在行业配置上，我们仍然尽量保持较高比例的非周期性股票。若有经济转好的信号时我们将首选周期性股票进行加仓”。

基于这种策略，本基金在一季度减持了本来就不多的高贝塔值的周期类股票，致使组合中剩下的大多是上半年表现很差的弱周期股。值得反思的是本基金没有在经济转好时首选周期性股票进行加仓。

经过一个多季度的思索，本基金于二季度增加了股票仓位，并适当改变了投资风格，注重行业配置。期间对组合进行了调整，减持了中游制造业，重点增配了银行、保险、地产等行业的股票，调整后组合表现较为理想。

三季度本基金的主要操作是在7月初减持了地产股，减持的主要原因：一是地产股估值过高，二是判断销售可能不如预期。从目前的表现来看，这次减持是成功的。

四季度增配了大盘股，降低了小盘股的比例。主要原因：一是小盘股估值整体偏高；二是股指期货的预期推动。另外，在行业配置上也相对均衡，增持了煤炭、钢铁、金融等行业的比例，降低了食品饮料、医药等行业的比例，但食品饮料及医药等行业的比例仍相对较高。到目前为止这种调整是不成功的，但这却是避免重蹈2009年年初覆辙的不得不采取的一种方法。

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1.5874元，份额累计净值为2.7480元。报告期内，本基金份额净值增长率为55.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，2010年全球经济维持低速增长的可能性较大。中国经济仍将保持强劲增长，并有可能引发调控。汽车和住房的相关消费可能难以持续旺盛，简单基数原因也会导致其增长率将回落至均衡水平。随着我国居民人均年龄逐年提高，消费能力和倾向都会自然提高，居民消费从长期看存在稳步增长的趋势。

2010年经济增长强劲，上市公司业绩增长率高，A股估值并不算太高，再加上低利率环境，全年来讲A股收益率应不算差。由于消费持续增长，且不受调控影响，因此本基金仍将对消费类股票有所侧重。

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

本基金于2009年4月7日公告对2008年报告期内利润进行收益分配。期末可供分配利润为549,504,886.00元，每10份基金单位派发现金红利1.79元，共计派发现金红

利 537,000,000.83 元, 占期末可供分配利润的 97.72%。

本基金于 2010 年 1 月 13 日公告对 2009 年报告期内利润进行收益分配。本基金 2009 年期末可供分配利润为 1,005,773,181.00 元, 每 10 份基金份额派发现金红利 3.03 元, 共计派发现金红利 908,999,998.17 元, 占期末可供分配利润的 90.38%。

根据本基金《基金合同》约定: “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%; ”。因此本基金本期分红已符合基金合同的约定。

§ 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, 托管人在汉兴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汉兴证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、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。本报告期内本基金进行了 1 次收益分配, 分配金额为 537,000,000.83 元, 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汉兴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

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: 汉兴证券投资基金

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)
资 产:		
银行存款	42,862,912.80	478,494,458.83
结算备付金	191,869,044.46	41,970.10
存出保证金	1,272,462.20	851,282.05
交易性金融资产	4,567,017,899.28	3,113,453,770.89
其中：股票投资	3,560,910,197.78	2,221,791,068.04
基金投资	—	—
债券投资	1,006,107,701.50	891,662,702.85
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	147,490,426.45	—
应收利息	9,777,716.83	13,220,246.99
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	4,960,290,462.02	3,606,061,728.86
负债和所有者权益	本期末 (2009年12月31日)	上年度末 (2008年12月31日)
负 债:		
短期借款	—	—
交易性金融负债	—	—
衍生金融负债	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	186,866,664.84	49,056,645.76
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	5,976,537.09	4,602,665.06
应付托管费	996,089.50	767,110.83
应付销售服务费	—	—
应付交易费用	2,186,907.64	185,434.71
应交税费	1,522,986.50	1,522,986.50
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	422,000.00	422,000.00
负债合计	197,971,185.57	56,556,842.86
所有者权益:		
实收基金	3,000,000,000.00	3,000,000,000.00
未分配利润	1,762,319,276.45	549,504,886.00
所有者权益合计	4,762,319,276.45	3,549,504,886.00

负债和所有者权益总计	4,960,290,462.02	3,606,061,728.86
------------	------------------	------------------

注：报告截止日 2009 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.5874 元，基金份额总额 3000000000 份。

7.2 利润表

会计主体：汉兴证券投资基金

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)
一、收入	1,838,109,637.44	-2,975,227,692.80
1. 利息收入	29,534,636.64	42,443,415.07
其中：存款利息收入	3,714,224.25	4,359,931.88
债券利息收入	25,820,412.39	37,952,308.19
资产支持证券利息收入	—	—
买入返售金融资产收入	—	131,175.00
其他利息收入	—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）	825,371,229.85	657,243,165.16
其中：股票投资收益	792,757,549.35	628,098,480.62
基金投资收益	—	—
债券投资收益	8,293,572.11	-2,802,805.80
资产支持证券投资收益	—	—
衍生工具投资收益	848,147.11	7,659,213.09
股利收益	23,471,961.28	24,288,277.25
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	983,191,362.00	-3,674,924,265.50
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	12,408.95	9,992.47
减：二、费用	88,295,246.16	105,572,746.25
1. 管理人报酬	60,858,258.56	76,116,003.21
2. 托管费	10,143,761.78	12,693,765.20
3. 销售服务费	—	—
4. 交易费用	13,960,693.94	6,246,447.58
5. 利息支出	1,328,504.81	7,118,511.76
其中：卖出回购金融资产支出	1,328,504.81	7,118,511.76
6. 其他费用	2,004,027.07	3,398,018.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,749,814,391.28	-3,080,800,439.05
减：所得税费用	—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,749,814,391.28	-3,080,800,439.05

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：汉兴证券投资基金

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）	3,000,000,000.00	549,504,886.00	3,549,504,886.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	1,749,814,391.28	1,749,814,391.28
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）	—	-537,000,000.83	-537,000,000.83
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	1,762,319,276.45	4,762,319,276.45
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）	3,000,000,000.00	5,100,305,325.05	8,100,305,325.05
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-3,080,800,439.05	-3,080,800,439.05
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）	—	-1,470,000,000.00	-1,470,000,000.00
五、期末所有者权益（基金净值）	3,000,000,000.00	549,504,886.00	3,549,504,886.00

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：

窦玉明

林志松

雷青松

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汉兴证券投资基金(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[1999]38号文《关于同意设立汉兴证券投资基金的批复》的核准,由海通证券股份有限公司(原名为海通证券有限公司)、华泰证券股份有限公司(原名为江苏证券有限责任公司)及富国基金管理有限公司于1999年12月24日共同发起并向社会募集设立。本基金为契约型封闭式,存续期为15年,发行规模为30亿份基金份额。本基金经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证上字[2000]1号文审核同意,于2000年1月10日在上交所挂牌交易。本基金的基金管理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。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行、上市的股票和债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于绩优型上市公司和债券的同时,兼顾成长型上市公司的投资,充分注重投资组合的流动性,从而为投资者减少和分散投资风险,确保基金资产的安全,谋求基金资产的长期稳定收益。本基金投资于股票、债券的比例不低于本基金资产总值的80%,其中投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%。

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 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。

7.4.5 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。

7.4.6 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、基金发起人
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
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

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。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.7.1.1 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	107,226,298.72	1.20	309,558,589.88	15.40
申银万国	1,131,556,028.26	12.71	304,222,186.02	15.14

7.4.7.1.2 权证交易

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	占当期权证成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
申银万国	—	—	5,622,960.75	10.60

注：本基金本年度未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.7.1.3 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	337,378.50	0.04	48,767,659.80	6.32
申银万国	160,220,254.90	19.03	45,286,735.12	5.87

7.4.7.1.4 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(%)
海通证券	—	—	1,046,500,000.00	15.59
申银万国	—	—	240,000,000.00	3.58

注：本基金本年度未通过关联方交易单元进行回购交易。

7.4.7.1.5 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	87,123.48	1.16	0.00	0.00
申银万国	956,751.94	12.78	197,851.76	9.07
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	259,772.60	15.39	214.21	0.12
申银万国	251,342.59	14.89	45,423.90	24.50

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。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 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	60,858,258.56	76,116,003.21
其中：支付销售机构的客户维护费	—	—

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，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。计算方法为计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

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(扣除基金持有现金比例超过20%部分的资产净值)

基金管理人的管理费每日计算，逐日累计至每月最后一个工作日(遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日)，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

7.4.7.2.2 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	10,143,761.78	12,693,765.20

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，逐日累计至每月最后一个工作日(遇公众假期延至节假日结束后的第一个工作日)，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金2009年度及2008年度均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

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)
基金合同生效日(1999年12月30日)持有的基金份额	—	—
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	0.33%	0.33%

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。

7.4.7.4.2 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(2009年12月31日)		上期末(2008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	5,000,000.00	0.17	5,000,000.00	0.17

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。

7.4.7.5 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	42,862,912.80	1,290,572.20	478,494,458.83	2,981,191.32

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2009年末为191,869,044.46元，2008年末为41,970.10元。

7.4.7.6 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年度未在本基金承销期内直接购入关联方承销证券。

7.4.7.7 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。

7.4.8 期末（2009年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

7.4.8.1.1 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	3,200,000	55,040,000.00	55,136,000.00	—
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	—
002315	焦点科技	2009-12-01	2010-03-09	认购新发证券	42.00	69.18	21,354	896,868.00	1,477,269.72	—
002322	理工监测	2009-12-11	2010-03-18	认购新发证券	40.00	61.88	14,995	599,800.00	927,890.60	—
002325	洪涛股份	2009-12-15	2010-03-22	认购新发证券	27.00	33.18	40,472	1,092,744.00	1,342,860.96	—
300002	神州泰岳	2009-09-29	2010-02-01	认购新发证券	58.00	105.20	11,389	660,562.00	1,198,122.80	—
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	—
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	—
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	55,467	1,585,246.86	3,074,535.81	—
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	—
600491	龙元建设	2009-06-02	2010-05-26	非公开发行	7.20	13.54	9,000,000	64,800,000.00	121,860,000.00	—

7.4.8.2 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
000623	吉林敖东	2009-12-28	筹划换股重组	49.19	2010-01-11	54.11	100,000	5,008,746.46	4,919,000.00	—
600739	辽宁成大	2009-12-28	筹划换股重组	38.09	2010-01-11	41.90	100,000	3,865,980.00	3,809,000.00	—

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.8.3.1 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。

7.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2009 年 12 月 31 日止，本基金无证券交易所债券正回购。

7.4.9 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	3,560,910,197.78	71.79
	其中：股票	3,560,910,197.78	71.79
2	固定收益投资	1,006,107,701.50	20.28
	其中：债券	1,006,107,701.50	20.28
	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	234,731,957.26	4.73
6	其他各项资产	158,540,605.48	3.20
7	合计	4,960,290,462.02	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	—	—
B	采掘业	207,321,482.17	4.35

C	制造业	1,144,710,109.72	24.04
C0	食品、饮料	422,181,534.20	8.87
C1	纺织、服装、皮毛	4,277,040.30	0.09
C2	木材、家具	—	—
C3	造纸、印刷	5,494,091.20	0.12
C4	石油、化学、塑胶、塑料	34,768,948.04	0.73
C5	电子	7,282,019.86	0.15
C6	金属、非金属	368,111,027.51	7.73
C7	机械、设备、仪表	55,628,857.23	1.17
C8	医药、生物制品	244,551,399.68	5.14
C99	其他制造业	2,415,191.70	0.05
D	电力、煤气及水的生产和供应业	—	—
E	建筑业	176,708,656.62	3.71
F	交通运输、仓储业	173,227,864.01	3.64
G	信息技术业	270,836,209.59	5.69
H	批发和零售贸易	273,161,228.00	5.74
I	金融、保险业	1,195,234,994.17	25.10
J	房地产业	22,287,530.00	0.47
K	社会服务业	82,893,160.58	1.74
L	传播与文化产业	3,074,535.81	0.06
M	综合类	11,454,427.11	0.24
	合计	3,560,910,197.78	74.77

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	601318	中国平安	5,181,776	285,464,039.84	5.99
2	600519	贵州茅台	1,431,598	243,113,972.36	5.10
3	002024	苏宁电器	11,200,000	221,376,000.00	4.65
4	002007	华兰生物	3,900,000	216,138,000.00	4.54
5	600036	招商银行	9,475,688	171,036,168.40	3.59
6	601166	兴业银行	3,600,000	145,116,000.00	3.05
7	600585	海螺水泥	2,856,836	142,441,842.96	2.99
8	600271	航天信息	6,320,158	128,172,804.24	2.69
9	600491	龙元建设	9,000,000	121,860,000.00	2.56
10	600030	中信证券	3,722,300	118,257,471.00	2.48

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于富国基金管理有限公司网站的年度报告正文

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	600030	中信证券	424,502,416.95	11.96
2	601318	中国平安	298,855,213.11	8.42
3	600050	中国联通	270,635,251.70	7.62
4	600036	招商银行	204,045,562.02	5.75
5	600009	上海机场	185,645,048.77	5.23
6	601628	中国人寿	154,501,038.87	4.35
7	601166	兴业银行	140,691,516.11	3.96
8	601006	大秦铁路	137,160,239.31	3.86
9	600016	民生银行	135,767,727.26	3.82
10	000858	五粮液	129,497,369.61	3.65
11	601186	中国铁建	128,705,278.55	3.63
12	600007	中国国贸	121,472,603.26	3.42
13	601939	建设银行	112,952,662.16	3.18
14	601088	中国神华	105,236,508.29	2.96
15	601169	北京银行	89,892,043.07	2.53
16	600585	海螺水泥	76,942,897.85	2.17
17	002024	苏宁电器	75,464,947.45	2.13
18	000002	万科A	72,913,197.75	2.05
19	600117	西宁特钢	67,036,370.11	1.89
20	601398	工商银行	66,105,017.55	1.86

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	002007	华兰生物	488,332,835.46	13.76
2	600030	中信证券	295,066,325.74	8.31
3	600036	招商银行	261,834,605.56	7.38
4	000002	万科A	228,699,706.73	6.44
5	600050	中国联通	218,275,942.64	6.15
6	601006	大秦铁路	189,701,723.96	5.34
7	600009	上海机场	186,226,434.65	5.25
8	600585	海螺水泥	181,858,773.38	5.12
9	600519	贵州茅台	158,959,579.59	4.48
10	600000	浦发银行	149,527,299.26	4.21

11	601628	中国人寿	128,593,625.85	3.62
12	002024	苏宁电器	128,286,509.12	3.61
13	601318	中国平安	99,505,955.48	2.80
14	600066	宇通客车	95,535,964.44	2.69
15	601939	建设银行	93,284,973.70	2.63
16	600271	航天信息	90,837,015.90	2.56
17	000538	云南白药	74,173,015.16	2.09
18	000869	张裕A	72,990,131.08	2.06
19	601169	北京银行	72,952,500.51	2.06
20	601398	工商银行	71,291,151.00	2.01

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	4,326,406,698.87
卖出股票收入（成交）总额	4,785,340,389.93

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	378,858,701.50	7.96
2	央行票据	210,807,000.00	4.43
3	金融债券	387,294,000.00	8.13
	其中：政策性金融债	387,294,000.00	8.13
4	企业债券	29,148,000.00	0.61
5	企业短期融资券	—	—
6	可转债	—	—
7	其他	—	—
8	合计	1,006,107,701.50	21.13

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	010112	21 国债(2)	1,107,340	113,557,717.00	2.38
2	010110	21 国债(0)	989,480	101,213,909.20	2.13
3	0701082	07 央行票据 82	1,000,000	101,170,000.00	2.12
4	080403	08 农发 03	1,000,000	100,600,000.00	2.11
5	010203	02 国债(3)	719,230	72,879,575.90	1.53

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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	1,272,462.20
2	应收证券清算款	147,490,426.45
3	应收股利	—
4	应收利息	9,777,716.83
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	158,540,605.48

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	600491	龙元建设	121,860,000.00	2.56	非公开发行股票
2	002024	苏宁电器	55,136,000.00	1.16	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(%)
64436	46,558.00	1,882,225,703.00	62.74	1,117,774,297.00	37.26

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国人寿保险股份有限公司	282,081,521	9.40
2	中国人寿保险(集团)公司	280,007,886	9.33
3	太平人寿保险有限公司	131,844,820	4.39
4	UBS AG	113,745,822	3.79
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红一个人分红	110,693,586	3.69
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司一传统一普通保险产品	97,913,928	3.26
7	中国太平洋财产保险股份有限公司一传统一普通保险产品一013C-CT001沪	78,578,548	2.62
8	兵器财务有限责任公司	61,427,676	2.05
9	MORGAN STANLEY & CO. INTERNATIONAL PLC.	47,729,397	1.59
10	阳光财产保险股份有限公司一自有资金	42,227,697	1.41

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略无改变。

10.5 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 10 万元人民币，其已提供审计服务的连续年限为 7 年。

10.6 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。

10.7 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 (%)	
长城证券	1	850,642,495.80	9.55	—	—	—	—	—	—	691,150.61	9.24	—
国泰君安	2	195,016,327.24	2.19	88,884,822.70	10.55	—	—	—	—	163,523.37	2.18	—
海通证券	1	107,226,298.72	1.20	337,378.50	0.04	—	—	—	—	87,123.48	1.16	—
金元证券	1	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—	—
联合证券	1	2,464,764.98	0.03	—	—	—	—	—	—	2,095.02	0.03	—
平安证券	2	1,693,230,738.65	19.02	61,153,098.50	7.26	—	—	—	—	1,407,441.74	18.81	—
申银万国	2	1,131,556,028.26	12.71	160,220,254.90	19.03	—	—	—	—	956,751.94	12.78	—
银河证券	2	1,199,528,336.72	13.47	57,073,130.00	6.78	—	—	2,345,312.67	100.00	1,010,510.80	13.50	—
招商证券	1	714,078,923.11	8.02	103,597,193.40	12.30	—	—	—	—	606,968.83	8.11	—
中金公司	1	2,262,980,889.12	25.42	158,069,655.60	18.77	385,000,000.00	100.00	—	—	1,923,523.38	25.70	—
中投证券	1	54,207,155.63	0.61	63,564,004.80	7.55	—	—	—	—	46,076.61	0.62	—
中信证券	1	692,723,541.75	7.78	149,225,210.30	17.72	—	—	—	—	588,809.47	7.87	—

注：我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未有变更

§ 11 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。