

天弘精选混合型证券投资基金  
2010 年半年度报告

2010 年 6 月 30 日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一〇年八月二十七日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司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、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本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。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
1.2	目录.....	2
§ 2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§ 3	主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1	主要会计数据及财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
§ 4	管理人报告.....	7
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的说明.....	8
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	9
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
§ 5	托管人报告.....	10
5.1	报告期内基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
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.....	10
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）.....	11
6.1	资产负债表.....	11
6.2	利润表.....	12
6.3	所有者权益(基金净值)变动表.....	13
6.4	报表附注.....	14
§ 7	投资组合报告.....	25
7.1	期末基金资产组合情况.....	25
7.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	26
7.3	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.....	27
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	29
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	31
7.6	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.....	31
7.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	31
7.8	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.....	31
7.9	投资组合报告附注.....	31
§ 8	基金份额持有人信息.....	32
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	32

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况 .....	32
§9 开放式基金份额变动 .....	33
§10 重大事件揭示 .....	33
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	33
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 .....	33
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	33
10.4 基金投资策略的改变 .....	33
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	33
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 .....	33
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	33
10.8 其他重大事件 .....	35
§11 备查文件目录 .....	37
11.1 备查文件目录 .....	37
11.2 存放地点 .....	37
11.3 查阅方式 .....	37

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘精选混合型证券投资基金
基金简称	天弘精选混合
基金主代码	420001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005 年 10 月 8 日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,628,656,524.42 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以资产配置为导向，在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择，在控制风险的前提下追求基金财产的长期稳健增值。
投资策略	在资产配置层次上，本基金以资产配置为导向，力图通过对股票、债券和短期金融工具进行灵活资产配置，在控制风险基础上，获取收益；在行业配置层次上，根据各个行业的景气程度，进行行业资产配置；在股票选择上，本基金将挖掘行业龙头，投资于有投资价值的行业龙头企业；本基金债券投资坚持以久期管理和凸性分析为核心，以稳健的主动投资为主导，选取价值被低估的券种，以获得更高的收益。
业绩比较基准	上证180指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型基金，其长期平均风险程度低于股票型基金，高于货币市场型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	吕传红	蒋松云
	联系电话	022-83865568	010-66105799

电子邮箱	lvch@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	022-83310988、4007109999	95588
传真	022-83865569	010-66105798
注册地址	天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	300203	100140
法定代表人	李琦	姜建清

## 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.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心A座16层
分公司	天弘基金管理有限公司北京分公司	北京市西城区金融大街1号金亚光大厦A座15层
	天弘基金管理有限公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴环路166号未来资产大厦8楼B单元
	天弘基金管理有限公司广州分公司	广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心写字楼第10层08单元

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据及财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年1月1日—2010年6月30日
本期已实现收益	-270,483,114.63
本期利润	-649,938,247.63
加权平均基金份额本期利润	-0.1137
本期加权平均净值利润率	-19.80%
本期基金份额净值增长率	-18.33%
3.1.2 期末数据和指标	2010年6月30日

期末可供分配利润	-782,615,917.56
期末可供分配基金份额利润	-0.1390
期末基金资产净值	2,867,390,757.23
期末基金份额净值	0.5094
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2010年6月30日</b>
基金份额累计净值增长率	59.34%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为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。

### 3.2 基金净值表现

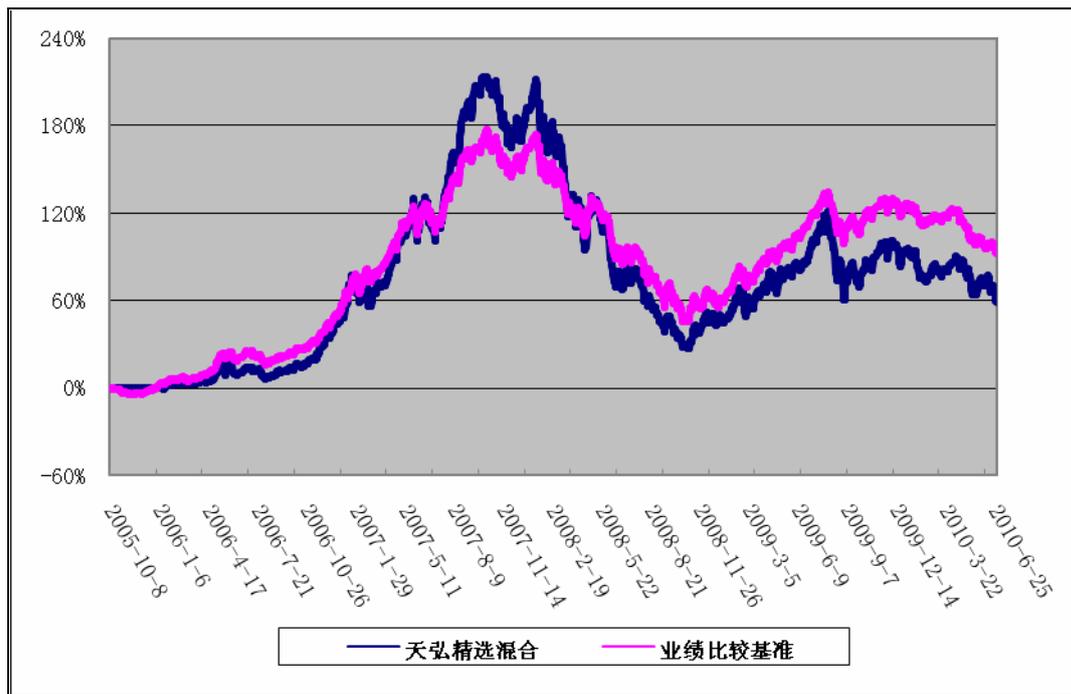
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-8.13%	1.52%	-3.75%	0.90%	-4.38%	0.62%
过去三个月	-13.68%	1.61%	-12.99%	0.98%	-0.69%	0.63%
过去六个月	-18.33%	1.37%	-15.31%	0.86%	-3.02%	0.51%
过去一年	-16.52%	1.76%	-9.87%	1.04%	-6.65%	0.72%
过去三年	-24.27%	1.90%	-10.15%	1.32%	-14.12%	0.58%
自基金合同生效起至今	59.34%	1.72%	92.15%	1.21%	-32.81%	0.51%

注：天弘精选混合基金业绩比较基准：上证 180 指数收益率\*55%+上证国债指数收益率\*45%。上证 180 指数和上证国债指数由上海证券交易所编制发布，分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况，具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是 30%-85%，债券和短期金融工具的投资比例范围是 15%-70%，分别参考上述投资比例范围的中值，确定本基金业绩比较基准中，上证 180 指数占 55%，上证国债指数占 45%。

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

天弘精选混合基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2005年10月8日至2010年6月30日)



注：1、本基金合同于 2005 年 10 月 8 日生效。  
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2004]164 号文批准,于2004 年11 月 8 日正式成立。注册资本为1亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司(持股比例48%)、兵器财务有限责任公司(持股比例26%)、内蒙古君正能源化工股份有限公司(持股比例26%)。本基金管理人目前管理四只开放式基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

吕宜振	本基金基金经理；天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理；本公司投资总监。	2009年3月	—	9年	男，工学博士。历任易方达基金管理有限公司研究主管；信诚基金管理有限公司研究总监；信诚精粹成长股票型证券投资基金基金经理。2008年加盟本公司，历任天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理。
徐正国	本基金基金经理。	2009年3月	—	6年	男，管理学硕士，2004年加盟本公司。历任天弘基金管理有限公司交易员、行业研究员、高级研究员、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。

注：1、上述任职日期、离任日期均为本基金管理人对外披露的任免日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，公司制定并执行了公平交易管理办法。公平交易管理办法的范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动。

公平交易的执行情况包括：公平对待不同投资组合，严禁进行以各投资组合之间利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；实行集中交易制度和公平的交易分配制度；加强对投资交易行为的监察稽核力度等。

本报告期内，基金管理人严格执行了公平交易管理办法的相关规定。

##### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下没有与天弘精选混合型证券投资基金投资风格相似的基金。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金报告期内未发生法规禁止的同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年初，在出口复苏，基建和房地产投资高速增长的拉动下，宏观经济呈现通胀走高和资产泡沫的过热迹象，中央为此连续出台宏观调控措施，包括连续提高银行存款准备金率，控制房地产的投资需求，清理地方融资平台等。随着调控措施的效应逐渐体现，经济过热的状况得以控制，经济增速出现一定程度的放缓。

回顾上半年，A 股在对国内宏观调控和欧洲主权债务危机的担忧下出现单边下行的走势，受调控影响最大的房地产和基建产业链（地产、钢铁、有色、化工等）的相关行业跌幅较大，而随着创业板上市带来赚钱效应的增加以及市场经济结构转型的期待，一些新股、战略新兴产业以及大消费类股票走势较好。

本基金立足宏观分析，通过资产配置获取超额收益，根据宏观经济转型的特征，本基金上半年对传统行业进行了较大幅度的减持，增持了战略新兴产业和大消费类产业。

##### 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 0.5094 元。本报告期本基金份额净值增长率为-18.33%，同期业绩比较基准增长率为-15.31%，低于基准 3.02%。

#### 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，全球宏观经济虽然进入复苏通道，但是发达国家由于结构性（去杠杆化和储蓄率上升）的问题，将在较长的时间保持低速增长，而随着经济结构转型，中国的重化工业也度过了高速增长阶段，所以在这种状况下股市的估值水平很难出现大的抬升，部分估值过高的周期性行业仍有下跌的风险。同时中国的经济结构面临转型，战略新兴产业和大消费类行业具有较大的发展空间，同时传统行业中个股如果能够进行结构调整和创新，也能重新获得高增长。本基金将立足上面的判断，侧重配置战略新兴产业，大消费类行业，以及传统行业中具有创新能力的板块，争取为基金持有人创造超额收益。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内基金托管人遵规守信情况声明

2010年上半年，本基金托管人在对天弘精选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，天弘精选混合型证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘精选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天弘精选混合型证券投资基金未进行利润分配。

### 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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘精选混合型证券投资基金2010年半年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘精选混合型证券投资基金

报告截止日：2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	110,853,715.01	641,352,525.32
结算备付金		7,558,442.92	16,155,239.70
存出保证金		5,365,983.21	9,037,551.41
交易性金融资产	6.4.7.2	2,748,760,442.97	3,360,216,077.18
其中：股票投资		2,192,559,942.07	2,828,847,077.18
基金投资		-	-
债券投资		556,200,500.90	531,369,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	8,133,841.47	4,997,681.97
应收股利		360.00	-
应收申购款		348,673.36	54,612.15
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	100,593.00	24,657.96
<b>资产总计</b>		<b>2,881,122,051.94</b>	<b>4,031,838,345.69</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2010 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2009 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	378,599,232.10
应付证券清算款		2,540,890.98	-
应付赎回款		1,335,496.43	3,774,284.59
应付管理人报酬		3,801,124.58	4,645,958.60
应付托管费		633,520.76	774,326.42
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	4,011,252.92	7,562,125.65
应交税费		574,800.00	574,800.00

应付利息		-	57,487.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	834,209.04	1,038,009.52
<b>负债合计</b>		<b>13,731,294.71</b>	<b>397,026,224.02</b>
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,509,724,440.90	2,598,382,815.21
未分配利润	6.4.7.10	357,666,316.33	1,036,429,306.46
<b>所有者权益合计</b>		<b>2,867,390,757.23</b>	<b>3,634,812,121.67</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>2,881,122,051.94</b>	<b>4,031,838,345.69</b>

注：报告截止日 2010 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5094 元，基金份额总额 5,628,656,524.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘精选混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>-603,151,815.39</b>	<b>1,023,045,444.13</b>
1. 利息收入		8,993,330.81	12,657,901.09
其中：存款利息收入	6.4.7.11	901,055.11	625,118.21
债券利息收入		8,058,624.12	12,032,782.88
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		33,651.58	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-232,724,967.55	538,926,397.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-241,535,938.05	509,270,252.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	697,120.17	16,207,455.57
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,113,850.33	13,448,688.64
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-379,455,133.00	471,287,982.53
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	34,954.35	173,163.41
<b>减：二、费用</b>		<b>46,786,432.24</b>	<b>66,932,913.72</b>
1. 管理人报酬		24,426,661.94	25,688,781.64
2. 托管费		4,071,110.34	4,281,463.65
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	17,388,008.27	36,333,574.33

5. 利息支出		672,918.72	440,677.06
其中：卖出回购金融资产支出		672,918.72	440,677.06
6. 其他费用	6.4.7.19	227,732.97	188,417.04
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-649,938,247.63</b>	<b>956,112,530.41</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-649,938,247.63</b>	<b>956,112,530.41</b>

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘精选混合型证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 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)	2,598,382,815.21	1,036,429,306.46	3,634,812,121.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-649,938,247.63	-649,938,247.63
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)	-88,658,374.31	-28,824,742.50	-117,483,116.81
其中：1. 基金申购款	12,128,715.26	3,342,028.81	15,470,744.07
2. 基金赎回款	-100,787,089.57	-32,166,771.31	-132,953,860.88
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)	2,509,724,440.90	357,666,316.33	2,867,390,757.23
项目	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 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)	2,951,829,587.65	109,948,355.74	3,061,777,943.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	956,112,530.41	956,112,530.41
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)	-163,380,495.86	-38,214,802.57	-201,595,298.43
其中：1. 基金申购款	18,411,888.42	3,876,588.34	22,288,476.76
2. 基金赎回款	-181,792,384.28	-42,091,390.91	-223,883,775.19
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)	2,788,449,091.79	1,027,846,083.58	3,816,295,175.37
-----------------	------------------	------------------	------------------

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：

胡 敏	胡 敏	田 中 甲
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘精选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2005]第 104 号《关于同意天弘精选混合型证券投资基金募集的批复》核准,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》和《天弘精选混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 339,099,940.28 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师京(验)报字(05)第 020 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘精选混合型证券投资基金基金合同》于 2005 年 10 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 339,143,795.66 份基金份额,其中认购资金利息折合 43,855.38 份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《天弘精选混合型证券投资基金招募说明书(更新)》和《关于天弘精选混合型证券投资基金基金实施份额拆分和持续营销及修改基金合同的公告》的有关规定,本基金于 2007 年 10 月 11 日进行了基金份额拆分,拆分比例为 2.242719141,并于 2007 年 10 月 12 日进行了变更登记。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘精选混合型证券投资基金基金合同》和最新公告的《天弘精选混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金投资于股票、债券和短期金融工具,以及中国证监会允许投资的其它金融工具,本基金股票投资比例范围是基金资产的 30%-85%;债券和短期金融工具的投资比例范围是基金资产的 15-70%,短期金融工具是指现金以及期限在一年以内(含一年)的债券、债券回购、中央银行票据、银行定期存款等金融工具。本基金的业绩比较基准为:上证 180 指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、证券投资基金信息披露编报规则第 4 号《基金投资组合报告的编制及披露》、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编报规则第 2 号《基金净值表现的编制及披露》、证券投资基金信息披露编报规则第 1 号《主要财务指标的计算及披露》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘精选混合型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 年上半年度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截止 2010 年 6 月 30 日的财务状况以及 2010 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.4 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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 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。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]102 号《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]107 号《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- 1、以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- 2、基金买卖股票、债券的差价收入暂免征收营业税和企业所得税。
- 3、对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按 50% 计入个人应纳税所得额，依照现行税法规定即 20% 代扣代缴个人所得税，暂不征收企业所得税。
- 4、基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
活期存款	110,853,715.01
定期存款	-
其他存款	-
合计	110,853,715.01

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,353,835,913.82	2,192,559,942.07	-161,275,971.75
债券	交易所市场	89,967,000.00	94,588,700.90
	银行间市场	461,971,953.95	461,611,800.00

	合计	551,938,953.95	556,200,500.90	4,261,546.95
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
	合计	2,905,774,867.77	2,748,760,442.97	-157,014,424.80

注：截至 2010 年 6 月 30 日，股票投资余额无按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金没有衍生金融资产和衍生金融负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金没有买入返售金融资产余额，本基金本报告期内也没有进行买断式逆回购交易。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	29,426.74
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	2,645.50
应收债券利息	8,101,515.55
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	236.58
其他	17.10
合计	8,133,841.47

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	100,593.00
合计	100,593.00

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	4,008,243.37
银行间市场应付交易费用	3,009.55
合计	4,011,252.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	750,000.00
应付赎回费	342.64
预提费用	83,866.40
合计	834,209.04

#### 6.4.7.9. 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,827,494,230.54	2,598,382,815.21
本期申购	27,201,743.95	12,128,715.26
本期赎回(以“-”号填列)	-226,039,450.07	-100,787,089.57
本期末	5,628,656,524.42	2,509,724,440.90

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 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	-534,256,882.85	1,570,686,189.31	1,036,429,306.46
本期利润	-270,483,114.63	-379,455,133.00	-649,938,247.63
本期基金份额交易产生的变动数	22,124,079.92	-50,948,822.42	-28,824,742.50
其中：基金申购款	-3,128,684.42	6,470,713.23	3,342,028.81
基金赎回款	25,252,764.34	-57,419,535.65	-32,166,771.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-782,615,917.56	1,140,282,233.89	357,666,316.33

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	832,665.73
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	67,596.54
其他	792.84
合计	901,055.11

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,744,079,641.42

减：卖出股票成本总额	5,985,615,579.47
买卖股票差价收入	-241,535,938.05

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
卖出债券及债券到期兑付成交金额	131,029,930.80
减：卖出债券及债券到期兑付成本总额	128,936,428.08
减：应收利息总额	1,396,382.55
债券投资收益	697,120.17

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期未发生衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,113,850.33
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,113,850.33

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	
——股票投资	-382,480,538.03
——债券投资	3,025,405.03
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2. 衍生工具	
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-379,455,133.00

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,372.72
基金转出费收入	-
印花税手续费返还	19,581.63
合计	34,954.35

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2、本基金的转出费总额的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	17,386,710.52
银行间市场交易费用	1,297.75
合计	17,388,008.27

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
审计费用	54,547.97
信息披露费	148,541.64
债券托管账户维护费	13,500.00
银行划款手续费	11,143.36
合计	227,732.97

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**
**6.4.8.1 或有事项**

本基金无或有事项的说明。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

本基金无资产负债表日后事项的说明。

**6.4.9 关联方关系**
**6.4.9.1 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**

本报告期存在控制关系或重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**
**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

**6.4.10.2 关联方报酬**
**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	24,426,661.94	25,688,781.64
其中：支付销售机构的客户维护费	4,418,382.52	4,629,100.65

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.5% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	4,071,110.34	4,281,463.65

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 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
中国工商银行	-	-	-	-	146,500,000.00	40,939.73
上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 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
中国工商银行	-	85,355,662.88	-	-	-	-

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.4.2 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

本报告期内除基金管理人之外的其他关联方没有投资及持有本基金份额。

#### 6.4.10.5 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 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2009 年 1 月 1 日至 2009 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	110,853,715.01	832,665.73	153,575,608.84	514,460.07

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未通过关联方购买其承销期内的证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期内无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末(2010年6月30日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

##### 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

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
002386	天原集团	10.03.31	10.07.09	新股网下申购	15.36	16.53	401,163	6,161,863.68	6,631,224.39	
002399	海普瑞	10.04.28	10.08.06	新股网下申购	148.00	117.03	17,572	2,600,656.00	2,056,451.16	
002407	多氟多	10.05.06	10.08.18	新股网下申购	39.39	41.65	37,099	1,461,329.61	1,545,173.35	
300070	碧水源	10.04.12	10.07.21	新股网下申购	69.00	93.20	31,337	2,162,253.00	2,920,608.40	
300077	国民技术	10.04.23	10.08.02	新股网下申购	87.50	116.75	34,079	2,981,912.50	3,978,723.25	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下任意一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601318	中国平安	10/06/29	重大资产重组	46.81	-	-	20,000	1,023,203.68	936,200.00	

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2010 年 6 月 30 日止，本基金没有从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额，也没有从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于中等风险品种。其长期平均风险程度低于股票型基金，高于货币市场型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及短期金融工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以督查委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立督查委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责评估风险、提出控制政策建议；金融工程部专门负责基金投资绩效、风险的计量和控制；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

##### 6.4.13.2 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2010 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 5.49%。

##### 6.4.13.3 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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控

制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。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，因此除附注 6.4.12 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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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投资的公允价值。

本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 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，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年6月30日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	110,853,715.01	-	-	-	110,853,715.01
结算备付金	7,558,442.92	-	-	-	7,558,442.92
存出保证金	-	-	-	5,365,983.21	5,365,983.21
交易性金融资产	250,169,800.00	246,909,700.90	59,121,000.00	2,192,559,942.07	2,748,760,442.97
应收股利	-	-	-	360.00	360.00
应收利息	-	-	-	8,133,841.47	8,133,841.47
应收申购款	-	-	-	348,673.36	348,673.36
其他资产	-	-	-	100,593.00	100,593.00
<b>资产总计</b>	<b>368,581,957.93</b>	<b>246,909,700.90</b>	<b>59,121,000.00</b>	<b>2,206,509,393.11</b>	<b>2,881,122,051.94</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	2,540,890.98	2,540,890.98
应付赎回款	-	-	-	1,335,496.43	1,335,496.43
应付管理人报酬	-	-	-	3,801,124.58	3,801,124.58
应付托管费	-	-	-	633,520.76	633,520.76

应付交易费用	-	-	-	4,011,252.92	4,011,252.92
应交税费	-	-	-	574,800.00	574,800.00
其他负债	-	-	-	834,209.04	834,209.04
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>13,731,294.71</b>	<b>13,731,294.71</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>368,581,957.93</b>	<b>246,909,700.90</b>	<b>59,121,000.00</b>	<b>2,192,778,098.40</b>	<b>2,867,390,757.23</b>

上年度末 2009年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	641,352,525.32	-	-	-	641,352,525.32
结算备付金	16,155,239.70	-	-	-	16,155,239.70
存出保证金	48,780.49	-	-	8,988,770.92	9,037,551.41
交易性金融资产	338,423,000.00	172,667,000.00	20,279,000.00	2,828,847,077.18	3,360,216,077.18
应收利息	-	-	-	4,997,681.97	4,997,681.97
应收申购款	11,828.50	-	-	42,783.65	54,612.15
其他资产	-	-	-	24,657.96	24,657.96
<b>资产总计</b>	<b>995,991,374.01</b>	<b>172,667,000.00</b>	<b>20,279,000.00</b>	<b>2,842,900,971.68</b>	<b>4,031,838,345.69</b>
<b>负债</b>					
卖出回购金融资产	378,599,232.10	-	-	-	378,599,232.10
应付赎回款	-	-	-	3,774,284.59	3,774,284.59
应付管理人报酬	-	-	-	4,645,958.60	4,645,958.60
应付托管费	-	-	-	774,326.42	774,326.42
应付交易费用	-	-	-	7,562,125.65	7,562,125.65
应交税费	-	-	-	574,800.00	574,800.00
应付利息	-	-	-	57,487.14	57,487.14
其他负债	-	-	-	1,038,009.52	1,038,009.52
<b>负债总计</b>	<b>378,599,232.10</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>18,426,991.92</b>	<b>397,026,224.02</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>617,392,141.91</b>	<b>172,667,000.00</b>	<b>20,279,000.00</b>	<b>2,824,473,979.76</b>	<b>3,634,812,121.67</b>

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

2010年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为19.40%，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情

况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 30%-85%，债券和短期金融工具为 15%-70%。此外，本基金的基金管理人每日还对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 6 月 30 日		上年度末 2009 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	2,192,559,942.07	76.47	2,828,847,077.18	77.83
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,192,559,942.07	76.47	2,828,847,077.18	77.83

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
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：人民币亿元)	
		本期末 2010 年 6 月 30 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	1. 业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 1.68	增加约 2.78
	2. 业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	下降约 1.68	下降约 2.78

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 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	2,192,559,942.07	76.10
	其中：股票	2,192,559,942.07	76.10

2	固定收益投资	556,200,500.90	19.30
	其中：债券	556,200,500.90	19.30
	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	118,412,157.93	4.11
6	其他各项资产	13,949,451.04	0.48
7	合计	2,881,122,051.94	100.00

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	185,678,467.29	6.48
B	采掘业	1,140,425.00	0.04
C	制造业	1,390,774,204.77	48.50
C0	食品、饮料	233,006,023.60	8.13
C1	纺织、服装、皮毛	155,711,295.24	5.43
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	134,894,486.98	4.70
C5	电子	147,682,435.60	5.15
C6	金属、非金属	2,674,631.50	0.09
C7	机械、设备、仪表	246,266,389.25	8.59
C8	医药、生物制品	469,999,742.60	16.39
C99	其他制造业	539,200.00	0.02
D	电力、煤气及水的生产和供应业	74,695,897.07	2.61
E	建筑业	84,103,938.09	2.93
F	交通运输、仓储业	71,960,000.00	2.51
G	信息技术业	81,338,795.40	2.84
H	批发和零售贸易	12,965,690.52	0.45
I	金融、保险业	73,134,358.68	2.55
J	房地产业	23,567,866.49	0.82
K	社会服务业	159,987,349.78	5.58
L	传播与文化产业	29,738,044.00	1.04
M	综合类	3,474,904.98	0.12
	合计	2,192,559,942.07	76.47

## 7.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000596	古井贡酒	2,729,014	115,437,292.20	4.03
2	600750	江中药业	3,623,406	111,782,075.10	3.90
3	000860	顺鑫农业	5,549,661	92,845,828.53	3.24
4	002051	中工国际	2,719,772	87,168,692.60	3.04
5	600439	瑞贝卡	9,599,583	83,036,392.95	2.90
6	601111	中国国航	7,000,000	71,960,000.00	2.51
7	600461	洪城水业	4,999,657	70,895,136.26	2.47
8	002310	东方园林	499,951	70,598,080.71	2.46
9	000423	东阿阿胶	2,028,597	70,514,031.72	2.46
10	002236	大华股份	1,431,099	64,614,119.85	2.25
11	000999	华润三九	2,581,903	59,254,673.85	2.07
12	600079	人福医药	3,534,993	56,559,888.00	1.97
13	300072	三聚环保	1,362,733	55,626,761.06	1.94
14	600765	中航重机	5,047,249	53,551,311.89	1.87
15	002252	上海莱士	1,219,585	50,612,777.50	1.77
16	002004	华邦制药	1,003,082	49,562,281.62	1.73
17	600809	山西汾酒	1,200,000	49,236,000.00	1.72
18	601169	北京银行	4,000,000	48,520,000.00	1.69
19	000973	佛塑股份	3,667,571	43,937,500.58	1.53
20	600707	彩虹股份	3,000,000	43,410,000.00	1.51
21	000848	承德露露	1,177,301	42,382,836.00	1.48
22	002376	新北洋	1,192,727	41,864,717.70	1.46
23	002041	登海种业	799,930	39,028,584.70	1.36
24	600420	现代制药	2,756,917	38,569,268.83	1.35
25	002042	华孚色纺	2,000,000	37,820,000.00	1.32
26	000826	桑德环境	1,820,504	37,247,511.84	1.30
27	600563	法拉电子	1,500,000	35,550,000.00	1.24
28	600118	中国卫星	2,243,830	35,115,939.50	1.22
29	600481	双良节能	2,519,738	34,772,384.40	1.21
30	600038	哈飞股份	1,598,470	32,464,925.70	1.13
31	002123	荣信股份	1,009,193	32,294,176.00	1.13
32	002193	山东如意	2,035,394	30,042,415.44	1.05
33	600054	黄山旅游	1,499,810	27,626,500.20	0.96
34	300058	蓝色光标	1,000,000	26,550,000.00	0.93
35	002311	海大集团	1,169,874	25,854,215.40	0.90
36	601601	中国太保	1,039,884	23,678,158.68	0.83
37	600467	好当家	3,000,000	23,340,000.00	0.81
38	600480	凌云股份	2,000,000	22,980,000.00	0.80

39	000650	仁和药业	1,499,990	22,319,851.20	0.78
40	000559	万向钱潮	2,045,547	21,191,866.92	0.74
41	000592	中福实业	3,999,953	20,079,764.06	0.70
42	600303	曙光股份	1,499,997	19,439,961.12	0.68
43	000400	许继电气	623,924	16,396,722.72	0.57
44	002011	盾安环境	1,000,000	16,120,000.00	0.56
45	000811	烟台冰轮	1,109,333	16,085,328.50	0.56
46	600491	龙元建设	1,724,886	13,505,857.38	0.47
47	600383	金地集团	1,999,903	12,119,412.18	0.42
48	000998	隆平高科	499,905	9,478,198.80	0.33
49	600053	中江地产	1,325,069	9,262,232.31	0.32
50	002386	天原集团	401,163	6,631,224.39	0.23
51	300077	国民技术	35,189	4,108,315.75	0.14
52	600900	长江电力	281,169	3,511,800.81	0.12
53	002344	海宁皮城	101,899	3,364,704.98	0.12
54	002144	宏达经编	221,709	3,248,036.85	0.11
55	000888	峨眉山A	188,887	3,214,856.74	0.11
56	600037	歌华有线	230,350	3,188,044.00	0.11
57	300070	碧水源	31,337	2,920,608.40	0.10
58	600458	时代新材	90,884	2,717,431.60	0.09
59	002091	江苏国泰	102,000	2,270,520.00	0.08
60	601106	中国一重	407,600	2,188,812.00	0.08
61	002399	海普瑞	17,572	2,056,451.16	0.07
62	600729	重庆百货	49,000	2,010,960.00	0.07
63	002437	誉衡药业	32,000	1,977,600.00	0.07
64	000538	云南白药	30,600	1,973,700.00	0.07
65	600693	东百集团	192,900	1,956,006.00	0.07
66	600403	欣网视讯	112,170	1,857,535.20	0.06
67	300055	万邦达	26,220	1,809,180.00	0.06
68	002407	多氟多	37,099	1,545,173.35	0.05
69	600785	新华百货	46,560	1,528,099.20	0.05
70	600703	三安光电	35,600	1,456,396.00	0.05
71	002379	鲁丰股份	40,527	1,398,181.50	0.05
72	000661	长春高新	36,793	1,324,548.00	0.05
73	000963	华东医药	52,300	1,243,694.00	0.04
74	000061	农产品	76,244	1,210,754.72	0.04
75	002184	海得控制	100,300	1,187,552.00	0.04
76	000829	天音控股	82,000	1,185,720.00	0.04
77	600208	新潮中宝	247,800	1,182,006.00	0.04
78	002154	报喜鸟	48,700	1,144,450.00	0.04
79	002353	杰瑞股份	14,500	1,140,425.00	0.04
80	002022	科华生物	74,640	1,098,700.80	0.04
81	600327	大厦股份	117,760	1,057,484.80	0.04

82	601318	中国平安	20,000	936,200.00	0.03
83	000713	丰乐种业	74,760	906,091.20	0.03
84	000417	合肥百货	60,512	871,372.80	0.03
85	600511	国药股份	40,000	870,800.00	0.03
86	000861	海印股份	66,500	778,050.00	0.03
87	600406	国电南瑞	15,900	610,401.00	0.02
88	002146	荣盛发展	63,200	584,600.00	0.02
89	600329	中新药业	23,042	580,888.82	0.02
90	002017	东信和平	33,700	539,200.00	0.02
91	600660	福耀玻璃	56,000	498,400.00	0.02
92	000338	潍柴动力	8,000	492,000.00	0.02
93	002089	新海宜	30,000	482,400.00	0.02
94	600062	双鹤药业	17,200	446,512.00	0.02
95	600475	华光股份	32,600	441,730.00	0.02
96	002029	七匹狼	14,000	420,000.00	0.01
97	002227	奥特迅	11,198	291,148.00	0.01
98	600863	内蒙华电	43,000	288,960.00	0.01
99	600376	首开股份	19,300	253,216.00	0.01
100	600658	电子城	25,000	220,250.00	0.01
101	002356	浩宁达	7,000	217,350.00	0.01
102	000528	柳工	10,400	191,672.00	0.01
103	000402	金融街	20,000	166,400.00	0.01
104	002028	思源电气	5,000	127,000.00	0.00
105	600518	康美药业	10,000	122,800.00	0.00
106	000671	阳光城	10,000	110,200.00	0.00
107	600559	老白干酒	4,000	95,680.00	0.00
108	600859	王府井	100	3,400.00	0.00
109	000889	渤海物流	100	573.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 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	600439	瑞贝卡	108,685,495.99	2.99
2	000596	古井贡酒	105,484,888.50	2.90
3	600000	浦发银行	101,080,503.52	2.78
4	601998	中信银行	100,680,097.51	2.77
5	002051	中工国际	98,301,701.59	2.70
6	000860	顺鑫农业	97,058,447.59	2.67
7	601001	大同煤业	93,802,064.54	2.58

8	000937	冀中能源	88,231,678.18	2.43
9	600557	康缘药业	85,192,482.67	2.34
10	002008	大族激光	85,158,716.85	2.34
11	601169	北京银行	83,270,871.32	2.29
12	600795	国电电力	78,049,406.21	2.15
13	600183	生益科技	77,395,774.11	2.13
14	002310	东方园林	76,217,785.37	2.10
15	600869	三普药业	76,007,392.88	2.09
16	000039	中集集团	74,668,478.28	2.05
17	600595	中孚实业	74,447,811.38	2.05
18	600461	洪城水业	72,576,404.36	2.00
19	000999	华润三九	71,857,537.07	1.98
20	600750	江中药业	71,126,228.15	1.96

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	600036	招商银行	159,775,347.45	4.40
2	600000	浦发银行	158,309,472.61	4.36
3	600166	福田汽车	120,343,935.37	3.31
4	600816	安信信托	116,530,882.64	3.21
5	600231	凌钢股份	113,342,263.50	3.12
6	600809	山西汾酒	106,395,832.37	2.93
7	600584	长电科技	104,110,865.70	2.86
8	601169	北京银行	102,756,894.08	2.83
9	000157	中联重科	101,880,962.15	2.80
10	002064	华峰氨纶	99,131,178.44	2.73
11	601998	中信银行	92,209,030.89	2.54
12	000540	中天城投	86,506,659.70	2.38
13	601001	大同煤业	81,159,678.91	2.23
14	000425	徐工机械	79,980,904.96	2.20
15	600795	国电电力	78,715,464.94	2.17
16	600557	康缘药业	77,666,393.73	2.14
17	000039	中集集团	73,557,005.40	2.02
18	002008	大族激光	72,744,089.92	2.00
19	000937	冀中能源	72,492,669.43	1.99
20	600837	海通证券	71,924,740.46	1.98

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	5,731,808,982.39
卖出股票收入（成交）总额	5,744,079,641.42

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	258,217,000.00	9.01
3	金融债券	140,545,000.00	4.90
	其中：政策性金融债	140,545,000.00	4.90
4	企业债券	121,075,500.00	4.22
5	企业短期融资券	32,012,800.00	1.12
6	可转债	4,350,200.90	0.15
7	合计	556,200,500.90	19.40

### 7.6 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	080413	08 农发 13	1,000,000	100,240,000.00	3.50
2	0901044	09 央行票据 44	900,000	88,335,000.00	3.08
3	0901038	09 央行票据 38	600,000	58,902,000.00	2.05
4	0801044	08 央行票据 44	500,000	50,880,000.00	1.77
5	1001032	10 央行票据 32	400,000	40,060,000.00	1.40

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，也没有在报
---

告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.9.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.9.3 其他资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	5,365,983.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	360.00
4	应收利息	8,133,841.47
5	应收申购款	348,673.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	100,593.00
8	合计	13,949,451.04

### 7.9.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.9.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.9.6 投资组合报告附注的其他文字表述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
343,505	16,385.95	18,942,808.45	0.34%	5,609,713,715.97	99.66%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额 级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员 持有本开放式基金		40,290.21	0.0007%
	合计	40,290.21	0.0007%

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2005 年 10 月 8 日）基金份额总额	339, 143, 795. 66
本报告期期初基金份额总额	5, 827, 494, 230. 54
本报告期基金总申购份额	27, 201, 743. 95
减：本报告期基金总赎回份额	226, 039, 450. 07
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5, 628, 656, 524. 42

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

### 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

### 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元股票交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
信达证券股份有限公司	1	12, 035, 745, 075. 07	17. 81%	1, 654, 057. 45	17. 39%	

中邮证券有限责任公司	1	1,553,473,307.16	13.59%	1,320,446.88	13.88%	
申银万国证券股份有限公司	1	1,238,845,792.22	10.84%	1,052,995.30	11.07%	
渤海证券股份有限公司	2	1,235,438,789.45	10.81%	1,003,805.48	10.55%	
中信证券股份有限公司	1	916,485,382.51	8.02%	779,011.61	8.19%	
国泰君安证券股份有限公司	1	761,949,037.68	6.67%	647,652.40	6.81%	
中银国际证券有限责任公司	1	561,098,739.74	4.91%	455,898.17	4.79%	
国金证券股份有限公司	1	454,862,024.53	3.98%	369,581.83	3.88%	
广州证券有限责任公司	2	449,332,267.09	3.93%	374,048.08	3.93%	
平安证券有限责任公司	1	446,103,447.61	3.90%	362,461.03	3.81%	
中信建投证券有限责任公司	1	420,962,971.92	3.68%	357,817.98	3.76%	
招商证券股份有限公司	1	418,446,297.80	3.66%	339,991.10	3.57%	
齐鲁证券有限公司	1	379,837,624.56	3.32%	322,860.17	3.39%	
中国国际金融有限公司	1	290,951,829.42	2.55%	247,306.57	2.60%	
华泰证券股份有限公司	1	151,723,769.99	1.33%	128,965.31	1.36%	
东兴证券股份有限公司	1	113,486,692.12	0.99%	96,464.19	1.01%	

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元债券交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券股份有限公司	2	29,936,075.34	73.92%	-	-	
中邮证券有限责任公司	1	10,561,787.60	26.08%	-	-	

### 10.7.3 基金租用证券公司交易单元债券回购交易的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金融有限公司	1	290,000,000.00	50.05%	-	-	
申银万国证券股份有限公司	1	100,000,000.00	17.26%	-	-	
中信证券股份有限公司	1	90,000,000.00	15.53%	-	-	
中邮证券有限责任公司	1	54,000,000.00	9.32%	-	-	
华泰证券股份有限公司	1	45,400,000.00	7.84%	-	-	

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况

稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

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

3、报告期内新租用证券公司交易单元情况

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	东兴证券股份有限公司	上海	1 个
2	广州证券有限责任公司	上海、深圳	各 1 个
3	英大证券有限责任公司	上海、深圳	各 1 个

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 10.8 其他重大事件

序号	披露事项名称	披露媒体	法定披露日期
1	关于北京分公司地址变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 4 日
2	关于开通招商银行网上交易的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 6 日
3	关于旗下基金参加中国工商银行定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 9 日
4	关于旗下基金参加中国银河证券定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 14 日
5	关于公司股东名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 19 日
6	天弘精选混合基金 2009 年 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 21 日
7	关于旗下基金参加中国邮政储蓄银行网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 1 月 22 日
8	关于上海分公司成立的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 3 月 10 日
9	天弘精选混合基金 2009 年年度报告及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 3 月 31 日
10	关于旗下基金参加中国工商银行个人电子银行申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 1 日
11	关于增加广州证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2010 年 4 月 8 日
12	关于在广州证券开通旗下基金定期定额投资业务的公	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 4 月 8 日

	告	及公司网站 www. thfund. com. cn	
13	关于增加信达证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 4 月 16 日
14	关于在信达证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 4 月 16 日
15	关于旗下基金参加广州证券网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 4 月 16 日
16	天弘精选混合基金 2010 年 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 4 月 21 日
17	关于增加英大证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 10 日
18	关于在英大证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 10 日
19	关于再次提请旗下基金投资者及时更新身份证件或身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 11 日
20	关于增加华安证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 12 日
21	关于在华安证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 12 日
22	关于在华安证券开通旗下基金定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 12 日
23	关于在广州证券开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 13 日
24	关于在华夏银行开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 20 日
25	天弘精选混合基金招募说明书 2010 年第 1 次更新及摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 22 日
26	关于增加国联证券、天相投资顾问公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 28 日
27	关于在国联证券、天相投资顾问公司开通旗下基金转换的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 5 月 28 日
28	关于旗下基金参加中信银行网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 6 月 1 日
29	关于旗下基金在申银万国证券开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 6 月 3 日
30	关于增加国金证券为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2010 年 6 月 21 日
31	关于旗下基金参加华夏银行网上银行基金申购及基金	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010 年 6 月 25 日

	定期定额投资申购费率优惠活动的公告	及公司网站 <a href="http://www.thfund.com.cn">www.thfund.com.cn</a>	
32	关于旗下基金在安信证券开通定期定额投资业务及参加网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 <a href="http://www.thfund.com.cn">www.thfund.com.cn</a>	2010 年 6 月 28 日

## §11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘精选混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘精选混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘精选混合型证券投资基金招募说明书
- 4、天弘精选混合型证券投资基金托管协议
- 5、天弘基金管理有限公司批准成立批件、营业执照及公司章程
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

### 11.2 存放地点

天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 16 层

### 11.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇一〇年八月二十七日