
中海优质成长证券投资基金 2010 年年度报告

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：中海基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年三月三十日

§ 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(以下简称“交通银行”)根据本基金合同规定，于 2011 年 3 月 28 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。

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。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	1
1.1	重要提示	1
§ 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.....	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的说明.....	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工作情况.....	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
6.1	管理层对财务报表的责任.....	14
6.2	注册会计师的责任	14
6.3	审计意见	14
§ 7	年度财务报表	15
7.1	资产负债表	15
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	40
8.1	期末基金资产组合情况	40
8.2	期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46

8.9	投资组合报告附注	46
§ 9	基金份额持有人信息	47
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
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.....	47
§ 10	开放式基金份额变动	47
§ 11	重大事件揭示	48
11.1	基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
11.4	基金投资策略的改变	48
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
11.8	其他重大事件	50
§ 12	备查文件目录	54
12.1	备查文件目录	54
12.2	存放地点	54
12.3	查阅方式	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中海优质成长证券投资基金	
基金简称	中海优质成长混合	
基金主代码	398001	
交易代码	398001（前端收费模式）	398002（后端收费模式）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2004年9月28日	
基金管理人	中海基金管理有限公司	
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	8,701,904,730.79份	
基金合同存续期	自基金成立之日起至基金终止之日	

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金主要通过投资于中国证券市场中具有品质保障和发展潜力的持续成长企业所发行的股票和国内依法公开发行上市的债券，在控制风险、确保基金资产流动性的前提下，以获取资本长期增值和股息红利收益的方式来谋求基金资产的中长期稳定增值。</p>
投资策略	<p>品质过滤，成长精选。</p> <p>（一）资产配置</p> <p>本基金由公司投资决策委员会基于如下的分析判断并结合《基金合同》中的投资限制和投资比例限制来确定、调整基金资产中股票、债券和现金的配置比例：</p> <p>1、根据宏观经济运行态势、宏观经济政策变化来把握宏观经济发展对证券市场的影响方向和力度，判断证券市场的发展趋势和风险收益特征；</p> <p>2、根据基金投资者对开放式基金的认识程度，以及基金行业的管理经验，判断基金申购和赎回净现金流量。</p> <p>（二）股票组合的构建</p> <p>1、选股标准</p> <p>本基金投资对象是优质成长企业的权益类证券。优质成长即注重上市公司品质和成长性的结合。主要从三方面考察上市公司的品质：</p> <p>① 财务健康，现金流充沛、业绩真实可靠；② 公司在所属行业内具有比较竞争优势；③ 良好的经营管理能力。同时从如下两个方面考察上市公司的成长性：① 公司应具有较强的潜在获利能力和较高的净利润增长率；② 公司产品或服务的需求总量不断扩大。</p> <p>2、备选股票库的构建</p> <p>备选股票库通过以下两个阶段构建：</p>

	<p>第一阶段：品质与历史成长性过滤</p> <p>本基金运用 GOQ 模型 (Growth On High Quality Model) 对所有上市公司 (投资决策委员会禁止投资的股票除外) 的品质和历史成长性进行过滤。主要通过经营性现金流、总资产回报率等指标对其财务状况进行评价。通过相对市场份额、超额毛利率等指标对行业竞争优势进行评价。通过净利润增长率等指标对历史成长性进行评价。GOQ 模型根据上述指标对上市公司进行综合评价排序, 初步筛选出 300 家左右的上市公司作为股票备选库 (I)。</p> <p>第二阶段：成长精选</p> <p>针对第一阶段筛选的股票备选库 (I), 本基金运用 α 公司评级系统对其进行成长精选。</p> <p>中海 α 公司评级系统由 4 个大的指标分析单元和 50 个具体评分指标构成, 其中客观性评分指标 30 个, 主观性评分指标 20 个。中海 α 公司评级系统 4 个大的分析单元分别是: 企业成长的行业基本情况评价, 企业成长的政策等非市场因素评价, 企业成长的内在因素深度分析, 企业成长的盈利与风险情况评价。</p> <p>中海 α 公司评级系统的设置充分体现了主客观结合的评价原则, 评级系统中可量化客观性指标的设置保证了选股过程的客观性和可比性。与一般的主观评级系统相比较, 这种主客观结合的指标体系既充分保障了评价结果的全面与客观可比性, 又有利于引导研究员对目标公司做更加深入细致的研究, 提高评价结果的准确度。</p> <p>本基金运用 α 公司评级系统的评价结果, 对备选库 (I) 中的股票进行进一步精选, 形成 150 家左右上市公司的股票备选库 (II)。</p> <p>3、股票投资组合的构建</p> <p>基金经理根据内部、外部的研究报告以及自己的综合判断, 特别是通过对公司管理团队的考量以及公司竞争力的全面分析, 对股票备选库 (II) 中的股票做出合适的投资判断, 在此基础上形成最终的股票投资组合, 并进行适时的调整。</p> <p>(三) 债券组合的构建</p> <p>本基金可投资国债、金融债和企业债 (包括可转债)。本基金根据基金资产总体配置计划, 在对利率走势和债券发行人基本面进行分析的基础上, 综合考虑利率变化对不同债券品种的影响、收益率水平、信用风险的大小、流动性的好坏等因素, 建立由不同类型、不同期限债券品种构成的投资组合。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%
风险收益特征	本基金是一只主动型的股票基金, 在证券投资基金中属于中等风险品种。本基金力争在严格控制风险的前提下谋求实现基金资产的长期稳定增长。

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	中海基金管理有限公司	交通银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	朱冰峰	张咏东
	联系电话	021-38429808	021-32169999-8755
	电子邮箱	zhubf@zhfund.com	zhangyd@bankcomm.com
客户服务电话		021-38789788、400-888-9788	95559
传真		021-68419525	021-62701216
注册地址		上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层	上海市浦东新区银城中路188号
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30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		陈浩鸣	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.zhfund.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	江苏公证天业会计师事务所有限公司	无锡市梁溪路28号
注册登记机构	中海基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号2905-2908室及30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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年	2008年
本期已实现收益	115,639,611.40	1,591,789,318.95	-2,960,449,154.52
本期利润	749,889,973.16	2,232,041,375.54	-3,272,824,762.63
加权平均基金份额本期利润	0.0990	0.3053	-0.4211
本期加权平均净值利润率	16.25%	43.75%	-63.04%
本期基金份额净值增长率	17.65%	57.49%	-44.70%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末	2008年末
期末可供分配利润	316,381,886.38	1,654,964,159.44	175,883,731.65

期末可供分配基金份额利润	0.0364	0.2444	0.0224
期末基金资产净值	5,963,532,522.40	5,511,957,382.91	4,051,125,932.52
期末基金份额净值	0.6853	0.8139	0.5168
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	362.91%	293.45%	149.83%

注 1：本基金合同于 2004 年 9 月 28 日生效。

注 2：以上所述基金业绩指标不包括基金份额持有人认购或交易基金的各项费用（例如，申购、赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

注 3：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 3 个月	16.15%	1.74%	4.99%	1.33%	11.16%	0.41%
过去 6 个月	42.06%	1.53%	16.59%	1.16%	25.47%	0.37%
过去 1 年	17.65%	1.48%	-8.29%	1.19%	25.94%	0.29%
过去 3 年	2.46%	1.68%	-28.12%	1.74%	30.58%	-0.06%
过去 5 年	388.09%	1.69%	161.28%	1.63%	226.81%	0.06%
自基金合同生效起至今	362.91%	1.56%	126.39%	1.52%	236.52%	0.04%

注 1：“自基金合同生效起至今”指 2004 年 9 月 28 日(基金合同生效日)至 2010 年 12 月 31 日。

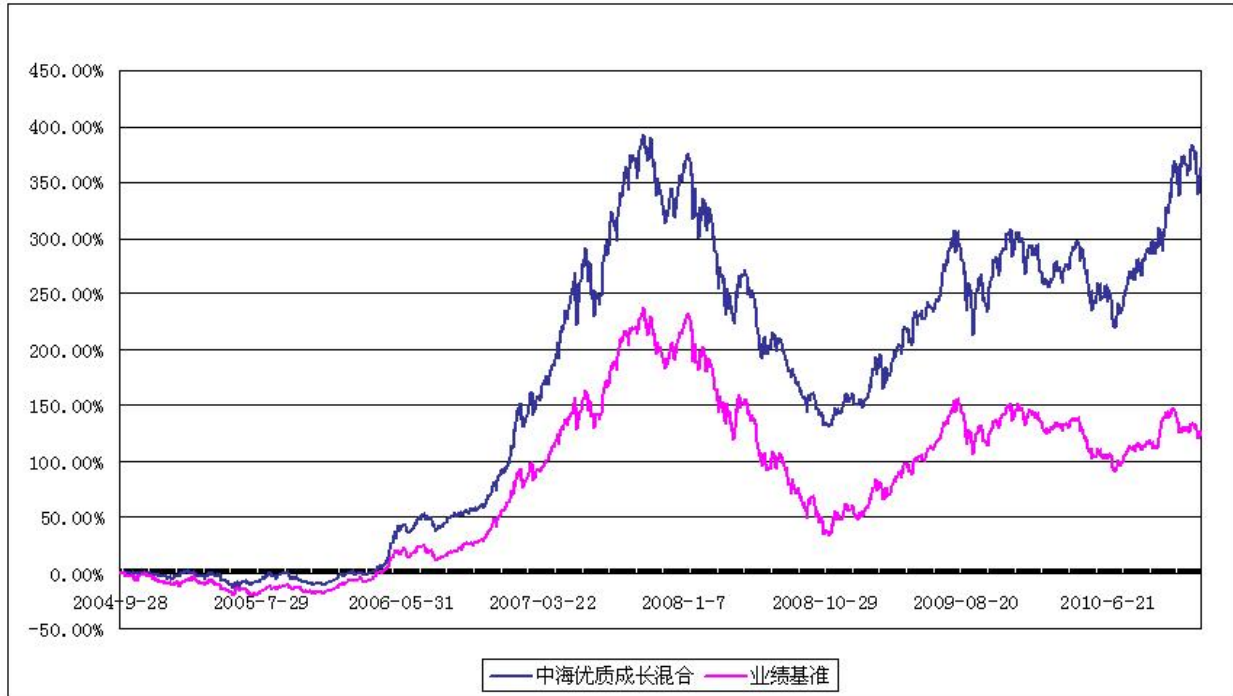
注 2：本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%，我们选取市场认同度很高的沪深 300 指数、上证国债指数作为计算业绩基准指数的基础指数。本基金投资股票的比例为 30%-95%，在一般市场状况下，本基金股票投资比例会控制在 75%左右，债券投资比例控制在 25%左右。我们根据本基金在一般市场状况下的资产配置比例来确定本基金业绩基准指数加权的权重，以使业绩比较更加合理。

本基金业绩基准指数每日按照 75%、25%的比例对基础指数进行再平衡，然后得到加权后的业绩基准指数的时间序列。

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

中海优质成长证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2004年9月28日至2010年12月31日)

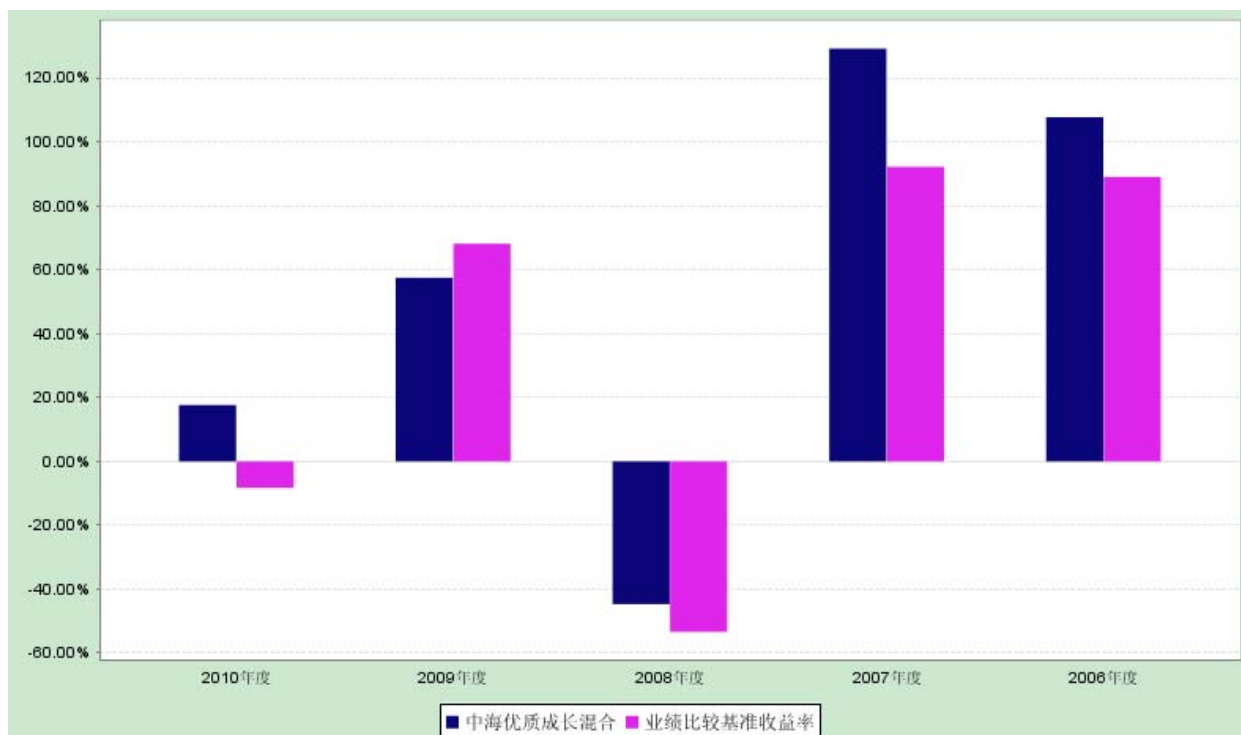


注 1：鉴于《新华富时指数使用许可协议》期限届满终止，中海基金管理有限公司作为基金管理人，已于 2007 年 6 月 1 日将中海优质成长证券投资基金业绩比较基准由“新华富时 A600 成长指数*75%+新华富时中国国债指数*25%”变更为“沪深 300 指数*75%+上证国债指数*25%”。

注 2：截至报告期末本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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

中海优质成长证券投资基金
过去五年净值增长率与同期业绩比较基准收益率对比图



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
2010年	2.200	1,036,143,934.22	666,620,010.14	1,702,763,944.36	-
2009年	-	-	-	-	-
2008年	0.030	11,458,027.33	11,711,863.02	23,169,890.35	-
合计	2.230	1,047,601,961.55	678,331,873.16	1,725,933,834.71	-

§ 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

基金管理人自 2004 年 3 月 18 日成立以来，始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行基金管理人的责任和义务，依靠强大的投研团队、规范的业务管理模式、严密科学的风险管理和内部控制体系，为广大基金份额持有人提供规范、专业的资产管理服务。截至 2010 年 12 月 31 日，共管理开放式证券投资基金 9 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨济如	本基金 基金经 理	2009-06-02	-	12	杨济如女士, 华东师范大学硕士、 哥伦比亚大学硕士。历任国泰君 安证券股份有限公司投资银行部 高级经理、资产管理部基金经理, 上海乐丰投资管理有限公司投资 经理。2008年4月进入本公司工 作, 曾任分析师、基金经理助理。 2009年6月至今任中海优质成长 证券投资基金基金经理。

注 1: 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

注 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合规守信情况的说明

基金管理人在报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、《基金合同》的规定, 勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益, 不存在损害基金份额持有人利益的行为, 不存在违法违规或未履行基金合同承诺。

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

为进一步完善公平交易管理, 防范和杜绝不规范交易行为, 保护基金份额持有人的合法权益, 公司建立了有纪律、规范化的投资研究和决策流程来确保公平对待不同投资组合, 切实防范利益输送。

公司通过制定《中海基金研究报告质量考评制度》, 树立了研究导向的投资文化, 强调投资应以研究作为依据, 不断建立完善系统、科学的研究方法和流程, 并认真地推行实施。

对于场内交易, 公司制定了《中海基金管理有限公司交易管理制度》, 所有的投资指令必须通过集中交易室下达, 集中交易室与投资部门相隔离, 规定多基金指令处理原则是: 时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡, 通过公司已有交易软件进行控制, 不同基金同向买卖同一证券完全通过系统进行比例分配, 同时禁止多基金之间的同日反向交易。对于场外交易, 通过《固定收益证券投资管理暂行办法》、《新股询价网下申购流程》以及《中海基金旗下基金投资流通受限证券管理办法》等规定对交易行为进行规范。

本报告期，不同投资组合的交易得到公平对待，未发生可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

本基金与本基金管理人旗下的其他投资组合的投资风格不同。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金有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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾 2010 年市场运行态势，影响市场走势的核心因素是市场担心经济是否存在二次探底可能，以及对于通胀和政府宏观调控预期的反复波动。因此在这样的背景下，本基金的投资策略主要是以自下而上为主，选择业绩相对确定性高的成长股为主，同时，考虑到大盘指标股的低估值，在投资策略上以把握指标股的波动机会为辅。整体看，在信息电子行业、建筑装饰、电力设备以及新材料领域中成长股的投资给基金带来了较好的回报，而在大盘指标股的波段投资方面不太理想，对于基金业绩有所拖累。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日,本基金份额净值 0.6853 元(累计净值 3.1509 元)。报告期内本基金净值增长率为 17.65%，高于业绩比较基准 25.94 个百分点。

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 2011 年，市场的纠结重心集中在通胀方面以及带来的宏观调控是否会超预期严厉。对于此，我们整体看好 2011 年的宏观经济。通胀在上半年压力较大，但鉴于政府在 2010 年四季度就着手坚定不移的治理通胀，总体判断通胀失控概率不大。再者，市场平均估值水平仍在合理区间，部分行业估值在历史低位。综合考虑上述因素，我们仍然看好 2011 年的市场。寻找优质、稳定成长的企业是本基金将长期遵守的投资宗旨，我们将力求最大限度的在不确定的市场环境中寻找业绩成长确定性品种，为投资人谋求更好的财富回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，管理人在内部监察工作中一切从合规运作、保障基金份额持有人利益出发，由监察稽

核部门遵守独立、客观、公正的原则，通过常规稽核、专项检查和系统监控等方法对公司经营、基金运作及员工行为的合规性进行检查，推动内部控制机制的完善与优化，保证各项法规和管理制度的落实，发现问题及时提出建议并督促有关部门改进。

管理人各项业务能遵循国家法律法规、中国证监会规章制度、管理人内部的规章制度以及各项业务规范流程，运行符合合法性、合规性的要求，主要内控制度基本有效。

在本报告期内，管理人内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 根据基金监管法律法规的不断更新与完善，推动各部门加强内部制度建设，确保制度对各项业务和管理环节的全覆盖、提高制度和流程的合规性、合理性和可操作性。

(2) 开展基金法律法规和管理人内部各项基本制度的培训学习工作，树立员工规范意识、合规意识和风险意识，形成员工主动、自觉进行内部控制的风险管理文化，构建主动进行管理人内部风险控制和自觉接受监察稽核的平台。

(3) 全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金销售、投资的合法合规。通过电脑监控、现场检查、人员询问、重点抽查等方法开展工作，不断提高全体员工的风险意识，保证了基金的合法合规运作。

(4) 按照中国证监会的要求，在管理内部严格推行风险控制自我评估制度。通过各部门的参与和自我评估，明确了各部门的风险点，对控制不足的风险点，制订了进一步的控制措施。

(5) 根据监管部门的要求，完成与基金投资业务相关的定期监察报告，报送中国证监会和董事会。

管理人自成立以来，各项业务运作正常，内部控制和风险防范措施逐步完善并积极发挥作用。基金运作合法合规，保障了基金份额持有人的利益。2011 年我们将继续紧紧抓住风险控制和合规性两条主线，构建一个制度修订规范化、风险责任岗位化、风险检测细致化、风险评估科学化的长效风险控制机制，提高内部监察工作的计划性、科学性和有效性，实现基金合法合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所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。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的估值核算小组，组成人员包括督察长、风险控制总监、监察稽核负责人及基金会计负责人等，

成员均具有多年基金从业经验，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。负责估值核算的小组成员中不包括投资总监及基金经理，但对于非活跃投资品种，投资总监及基金经理可以向估值核算小组提供估值建议。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规以及本基金合同的相关规定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益分配每年至多四次，收益分配比例不低于基金净收益的 90%；本基金本报告期净收益为 115,639,611.40 元，报告期内实施利润分配 1 次，实际分配金额为 1,702,763,944.36 元，本报告期应分配利润已于 2011 年 3 月 7 日实施分配。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010 年度，基金托管人在中海优质成长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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010 年度，中海基金管理有限公司在中海优质成长证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金进行 1 次收益分配，分配金额为 1,702,763,944.36 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

2010 年度，由中海基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中海优质成长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。

§ 6 审计报告

苏公 W[2011]A230 号

中海优质成长证券投资基金份额全体持有人：

我们审计了后附的中海优质成长证券投资基金（以下简称优质成长基金）会计报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表，2010 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。

6.1 管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制财务报表是优质成长基金的管理人中海基金管理有限公司管理层的责任。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。

6.2 注册会计师的责任

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。

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。

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。

6.3 审计意见

我们认为，优质成长基金财务报表已经按照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证券监督管理委员会允许的基金行业实务操作的有关规定编制，在所有重大方面公允反映了优质成长基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和净值变动情况。

江苏公证天业会计师事务所有限公司 注册会计师 沈岩 华可天
无锡市梁溪路 28 号

2011-03-21

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

报告截止日：2010年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	12,809,038.72	27,138,195.05
结算备付金		451,260,458.35	566,804,774.99
存出保证金		4,533,315.73	6,417,676.52
交易性金融资产	7.4.7. 2	5,537,963,425.10	4,866,426,803.97
其中：股票投资		5,342,703,425.10	4,616,776,803.97
基金投资		-	-
债券投资		195,260,000.00	249,650,000.00
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7. 3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7. 4	-	-
应收证券清算款		-	184,274,668.06
应收利息	7.4.7. 5	2,487,965.96	2,199,563.03
应收股利		-	-
应收申购款		4,492,232.72	304,444.31
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7. 6	-	-
资产总计		6,013,546,436.58	5,653,566,125.93
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		33,543,275.62	117,484,790.88
应付赎回款		1,253,206.88	5,643,671.86

应付管理人报酬		7,181,553.78	7,036,238.65
应付托管费		1,196,925.64	1,172,706.45
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,625,122.84	9,598,235.12
应交税费		54,643.83	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	2,159,185.59	673,100.06
负债合计		50,013,914.18	141,608,743.02
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,496,026,448.65	2,720,778,282.44
未分配利润	7.4.7.10	2,467,506,073.75	2,791,179,100.47
所有者权益合计		5,963,532,522.40	5,511,957,382.91
负债和所有者权益总计		6,013,546,436.58	5,653,566,125.93

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6853 元，基金份额总额 8,701,904,730.79 份。

7.2 利润表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

本报告期：2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
一、收入		872,853,732.94	2,390,621,681.52
1. 利息收入		8,902,000.88	14,082,699.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,999,401.45	6,832,075.13
债券利息收入		3,484,888.00	7,228,536.44
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		417,711.43	22,088.36
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		228,192,598.39	1,734,136,965.86
其中：股票投资收益	7.4.7.12	206,392,463.78	1,700,169,309.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	1,707,676.73	7,771,524.05
资产支持证券投资收益		-	-

衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	20,092,457.88	26,196,132.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	634,250,361.76	640,252,056.59
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,508,771.91	2,149,959.14
减：二、费用		122,963,759.78	158,580,305.98
1. 管理人报酬		69,138,197.10	75,996,875.90
2. 托管费		11,523,032.82	12,666,145.94
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	41,565,760.65	69,383,244.52
5. 利息支出		258,247.24	57,945.03
其中：卖出回购金融资产支出		258,247.24	57,945.03
6. 其他费用	7.4.7.19	478,521.97	476,094.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		749,889,973.16	2,232,041,375.54
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		749,889,973.16	2,232,041,375.54

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中海优质成长证券投资基金

本报告期：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,720,778,282.44	2,791,179,100.47	5,511,957,382.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	749,889,973.16	749,889,973.16
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）	775,248,166.21	629,200,944.48	1,404,449,110.69
其中：1. 基金申购款	1,746,441,757.45	1,103,074,173.35	2,849,515,930.80
2. 基金赎回款	-971,193,591.24	-473,873,228.87	-1,445,066,820.11
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）	-	-1,702,763,944.36	-1,702,763,944.36
五、期末所有者权益（基金净值）	3,496,026,448.65	2,467,506,073.75	5,963,532,522.40

项目	上年度可比期间 2009年1月1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）	3,149,020,869.37	902,105,063.15	4,051,125,932.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,232,041,375.54	2,232,041,375.54
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）	-428,242,586.93	-342,967,338.22	-771,209,925.15
其中：1. 基金申购款	722,305,884.02	498,377,465.04	1,220,683,349.06
2. 基金赎回款	-1,150,548,470.95	-841,344,803.26	-1,991,893,274.21
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）	2,720,778,282.44	2,791,179,100.47	5,511,957,382.91

报告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：

基金管理公司负责人：陈浩鸣，主管会计工作负责人：黄鹏，会计机构负责人：曹伟

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中海优质成长证券投资基金(以下简称“本基金”)原名国联优质成长证券投资基金，由国联基金管理有限公司（现已更名为“中海基金管理有限公司”）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》及有关法规规定，经中国证券监督管理委员会证监基金字【2004】92号《关于同意国联优质成长证券投资基金设立的批复》核准募集设立。经国联基金管理有限公司股东会 2006 年第一次、第二次临时会议决议和修改后章程的规定，并经中国证券监督管理委员会证监基金字[2006]90号“关于同意国联基金管理有限公司股权转让、增加注册资本、修改公司章程和变更公司名称的批复”批准，名称变更为中海基金管理有限公司；另经中海基金管理有限公司第一届董事会第十六次会议审议通过，并经各基金托管人同意及中国证券监督管理委员会基金监管部核准，将管理的开放式基金名称进行相应变更，原“国联优质成长证券投资基金”更名为“中海优质成长证券投资基金”。

本基金为契约型开放式，存续期限不定，基金管理人为中海基金管理有限公司，基金托管人为交通银行；有关基金募集文件已按规定向中国证券监督管理委员会备案；基金合同于 2004 年 9 月 28 日生效，该日的基金份额总额为 1,017,619,728.79 份。

本基金于 2007 年 10 月 19 日(拆分日)进行了基金份额拆分。当日，本基金拆分前基金份额净值为 2.4891 元，精确到小数点后第 9 位为 2.489131393 元，基金份额总额为 1,480,631,490.88 份，本基金管

理人按照 1:2.489131393 的拆分比例对本基金的份额进行了拆分。实施拆分后，拆分日基金份额净值调整为 1.0000 元，拆分后基金份额总额为 3,685,486,326.68 份,基金份额计算结果保留到小数点后 2 位，小数点 2 位后的部分截去，截去部分所代表的资产归基金资产所有。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 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》、本基金合同和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金在本报告期内的会计报表遵循了企业会计准则及其他有关规定。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本报告期为 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

7.4.4.3.1 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

7.4.4.3.2 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

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

7.4.4.4.1 金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

7.4.4.4.2 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

7.4.4.4.3 当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.4.4 本基金金融工具的成本计价方法具体如下：

7.4.4.4.4.1 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；

因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价，于股权分置改革方案实施后的股票复牌日，冲减股票投资成本；

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

7.4.4.4.4.2 债券投资

买入证券交易所交易的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；

买入未上市债券和银行间同业市场交易的债券，于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按实际成交价款入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。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、到期价和发行期限计算应收利息，并按上述会计处理方法核算；

卖出证券交易所交易和银行间同业市场交易的债券均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。

7.4.4.4.4.3 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

配股权证及由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，该等权证初

始成本为零；

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

7.4.4.4.4 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 7.4.4.4.2 和 7.4.4.4.3 中的相关方法进行计算。

7.4.4.4.5 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）在回购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

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。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。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

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：

7.4.4.5.1 上市证券的估值

7.4.4.5.1.1 交易所上市的有价证券（包括股票、权证等），以其估值日在证券交易所挂牌的收盘价估值；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，以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，确定公允价值；

7.4.4.5.1.2 交易所上市实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，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，确定公允价值；

7.4.4.5.1.3 交易所上市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；估值日没有交易的，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。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，确定公允价值；

7.4.4.5.1.4 交易所上市不存在活跃市场的有价证券，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，按成本估值。

7.4.4.5.2 未上市证券的估值

7.4.4.5.2.1 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，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值；

7.4.4.5.2.2 首次公开发行未上市的股票、债券和权证，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，按成本估值；

7.4.4.5.2.3 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，即依照上述 7.4.4.5.1.1 和 7.4.4.5.1.4 的相关方法进行估值；

7.4.4.5.2.4 非公开发行有明确锁定期的股票的估值

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，应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；

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，应按中国证监会相关规定处理；

7.4.4.5.3 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；

7.4.4.5.4 全国银行间债券市场交易的债券等固定收益品种，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，按成本估值；

7.4.4.5.5 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 7.4.4.5.1 中的相关方法进行估值；

7.4.4.5.6 同一债券同时在两个或两个以上市场交易的，按债券所处的市场分别估值；

7.4.4.5.7 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，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价格估值；

7.4.4.5.8 相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

基金管理人的管理人报酬根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值的1.5%的年费率逐日计提。

基金托管人的托管费根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定按基金资产净值的0.25%的年费率逐日计提。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也

可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

基金收益分配比例不低于基金净收益的 90%；

本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的单位基金资产净值自动转为基金单位进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

基金收益分配每年至多四次，基金成立不满 3 个月，收益不分配；

基金当年收益须先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

基金收益分配后每份基金单位净值不能低于面值；

如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；

每一基金单位享有同等收益分配权；

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

本基金本报告期没有发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期没有发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内不存在重大会计差错。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税字 [2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字 [2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]11 号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、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]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2007]84 号《关于调整证券(股票)交易印花税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

7.4.6.1

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。

7.4.6.2

基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

7.4.6.3

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。

7.4.6.4

基金买卖股票于 2008 年 4 月 24 日之前按照 0.3% 的税率缴纳股票交易印花税，自 2008 年 4 月 24 日起至 2008 年 9 月 18 日止按 0.1% 的税率缴纳。自 2008 年 9 月 19 日起基金卖出股票按 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。

7.4.6.5

基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

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 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
活期存款	12,809,038.72	27,138,195.05
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	12,809,038.72	27,138,195.05

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	4,338,632,956.89	5,342,703,425.10	1,004,070,468.21	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	196,220,000.00	195,260,000.00	-960,000.00
	合计	196,220,000.00	195,260,000.00	-960,000.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	4,534,852,956.89	5,537,963,425.10	1,003,110,468.21	
项目	上年度末 2009 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	

股票		4,247,566,697.52	4,616,776,803.97	369,210,106.45
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	250,000,000.00	249,650,000.00	-350,000.00
	合计	250,000,000.00	249,650,000.00	-350,000.00
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,497,566,697.52	4,866,426,803.97	368,860,106.45

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末及上年度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

本基金在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

本基金在本报告期末及上年度末均未持有买断式回购债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收活期存款利息	13,221.97	5,847.72
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	45,326.47	196,248.97
应收债券利息	2,423,342.47	1,997,328.77
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	6,038.75	101.27
其他	36.30	36.30
合计	2,487,965.96	2,199,563.03

7.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,624,102.49	9,598,235.12
银行间市场应付交易费用	1,020.35	-
合计	4,625,122.84	9,598,235.12

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	2,000,000.00	500,000.00
应付赎回费	1,985.59	15,900.06
预提费用	150,000.00	150,000.00
其他应付款	7,200.00	7,200.00
合计	2,159,185.59	673,100.06

7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,772,297,037.54	2,720,778,282.44
本期申购	4,346,984,015.85	1,746,441,757.45
本期赎回（以“-”号填列）	-2,417,376,322.60	-971,193,591.24
本期末	8,701,904,730.79	3,496,026,448.65

注：其中本期申购包含红利再投、转换入份额，本期赎回包含转换出份额。

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	1,654,964,159.44	1,136,214,941.03	2,791,179,100.47
本期利润	115,639,611.40	634,250,361.76	749,889,973.16
本期基金份额交易产生的变动数	248,542,059.90	380,658,884.58	629,200,944.48
其中：基金申购款	326,556,728.67	776,517,444.68	1,103,074,173.35
基金赎回款	-78,014,668.77	-395,858,560.10	-473,873,228.87
本期已分配利润	-1,702,763,944.36	-	-1,702,763,944.36
本期末	316,381,886.38	2,151,124,187.37	2,467,506,073.75

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	621,234.95	542,062.91
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	4,335,858.40	6,256,580.75
其他	42,308.10	33,431.47
合计	4,999,401.45	6,832,075.13

注：其他包括申购款利息收入（本期：40980.61；上年度可比期间：32120.00）以及权证交收价差保证金利息收入（本期：1327.49；上年度可比期间：1311.47）

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	206,392,463.78	1,700,169,309.29
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	206,392,463.78	1,700,169,309.29

7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	13,760,806,884.71	22,686,400,324.27
减：卖出股票成本总额	13,554,414,420.93	20,986,231,014.98
买卖股票差价收入	206,392,463.78	1,700,169,309.29

7.4.7.13 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12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	284,774,712.08	1,186,893,925.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	280,003,695.05	1,159,847,368.42
减：应收利息总额	3,063,340.30	19,275,033.42
债券投资收益	1,707,676.73	7,771,524.05

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金在本报告期及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
股票投资产生的股利收益	20,092,457.88	26,196,132.52
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	20,092,457.88	26,196,132.52

7.4.7.16 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12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
1. 交易性金融资产	634,250,361.76	640,252,056.59
——股票投资	634,860,361.76	667,105,688.17
——债券投资	-610,000.00	-26,853,631.58
——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	634,250,361.76	640,252,056.59

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
基金赎回费收入	1,398,731.91	2,110,773.95
转出基金补偿收入	76,772.50	-
印花税返还	33,267.50	21,121.84
其他	-	18,063.35
合计	1,508,771.91	2,149,959.14

注：根据《中海优质成长证券投资基金基金合同》的规定，基金赎回（转出）时收取赎回费，其中赎回费用的25%归入基金资产，作为对其他基金份额持有人的补偿。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	41,565,110.65	69,378,469.52
银行间市场交易费用	650.00	4,775.00
合计	41,565,760.65	69,383,244.52

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	150,000.00	150,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
银行费用	10,521.97	8,094.59
开户费	-	-
账户服务费	18,000.00	18,000.00
合计	478,521.97	476,094.59

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

本基金在本报告期内无需要说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2011 年 3 月 2 日宣告分红，向截至 2011 年 3 月 7 日止在本基金注册登记人中海基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.15 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中海基金管理有限公司（“中海基金”）	基金管理人、直销机构
交通银行	基金托管人、代销机构
中海信托股份有限公司（“中海信托”）	基金管理人的股东
国联证券股份有限公司（“国联证券”）	基金管理人的股东、代销机构
法国爱德蒙得洛希尔银行股份有限公司（“法国洛希尔银行”）	基金管理人的股东

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		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日		2009年1月1日至2009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
国联证券	3,833,333,309.40	14.01%	6,244,820,508.09	13.68%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金在本报告期及上年度可比期间均未在关联方交易单元进行债券回购交易。

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 2010年1月1日至2010年12月31日			
	当期 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
国联证券	3,114,604.29	13.66%	874,871.93	18.92%
关联方名称	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日			
	当期 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
国联证券	5,102,678.34	13.33%	732,981.88	7.64%

注：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除中国证券登记结算有限责任公司收取的由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

沪市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

深市实际交易佣金=股票成交金额×【0.1%】—股票交易经手费—股票交易证管费—证券结算风险基金

国联证券符合我司选择证券经营机构、使用其席位作为基金专用交易席位的标准，与其签订的席位租用合同是在正常业务中按照一般商业条款订立的。其为本基金提供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 2010年1月1日至2010年12月31 日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理	69,138,197.10	75,996,875.90

费		
其中：支付销售机构的客户维护费	18,038,807.56	19,112,296.31

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

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，逐日累计至每月月底，按月支付。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	11,523,032.82	12,666,145.94

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，逐日累计至每月月底，按月支付。

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

本基金在本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	57,006,954.99	57,006,954.99
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	57,006,954.99	57,006,954.99
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.66%	0.84%

注：本基金已按照招募说明书上列示的费率对基金管理人收取了基金投资的相关费用。

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年1月1日至2009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	12,809,038.72	621,234.95	27,138,195.05	542,062.91

注 1：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，并按银行间同业利率计息。

注 2：根据中国证券登记结算有限责任公司要求的证券投资基金结算模式，本基金需通过以基金托管人名义开立的“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”进行证券交易结算。于 2010 年 12 月 31 日，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额 440,476,614.55 元计入结算备付金科目(其中不包含最低结算备付金)。于 2009 年 12 月 31 日，本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，相关余额 551,772,986.91 元计入结算备付金科目(其中不包含最低结算备付金)。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2010年1月1日至2010年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
国联证券	601801	皖新传媒	分销	26,396	311,472.80
国联证券	601288	农业银行	分销	929,000	2,489,720.00
上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	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	利润分配 合计	备注
----	-----------	-----	-----------------------	--------------	---------------	------------	----

	2010-03-10	2010-03-10	2.200	1,036,143,934.22	666,620,010.14	1,702,763,944.36	-
合计	-	-	2.200	1,036,143,934.22	666,620,010.14	1,702,763,944.36	-

注：本基金的基金管理人于 2011 年 3 月 2 日宣告分红，向截至 2011 年 3 月 7 日止在本基金注册登记人中海基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.15 元。

7.4.12 期末（2010 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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
601933	永辉超市	2010-12-09	2011-03-15	网下申购新股锁定	23.98	31.24	24,732	593,073.36	772,627.68	-
300125	易世达	2010-09-27	2011-01-13	网下申购新股锁定	55.00	83.49	25,115	1,381,325.00	2,096,851.35	-
300133	华策影视	2010-10-14	2011-01-26	网下申购新股锁定	68.00	116.00	34,714	2,360,552.00	4,026,824.00	-
300142	沃森生物	2010-11-03	2011-02-14	网下申购新股锁定	95.00	133.20	21,616	2,053,520.00	2,879,251.20	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌股票。

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

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额，因此无抵押债券。

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《中海基金投资决策委员会议事规则》、《中海基金投资业务流程》、《中海基金权限管理办法》、《中海基金研究管理办法》、《中海基金股票库管理办法》等一系列相应的制度和流程来控制这些风险，并设定适当的风险阈值及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续实时监控上述各类风险。

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、风险管理部、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

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。本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能的信用风险。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极小；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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2010年12月31日	上年末 2009年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	195,260,000.00	0.00
合计	195,260,000.00	0.00

注：本期末按短期信用评级为“未评级”的债券均为中央银行票据。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2010年12月31日	上年末 2009年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	249,650,000.00
合计	0.00	249,650,000.00

注：上年度末按长期信用评级为“未评级”的债券为政策性金融债。

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困难，从而对基金收益造成的不利影响。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。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。本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金严格控制现金或者到期日在一年以内的政府债券持有量在基金资产净值中的占比保持在5%以上的水平，2010年12月31日，本基金股票资产持仓比例为89.59%，债券持仓比例为3.27%；2009年12月31日，本基金股票资产持仓比例为83.76%，债券持仓比例为4.53%。

以2010年12月31日股票持仓量为基准，在其他变量不变的假设情况下，以当月股票市场的平均活跃度为依据，除去因停牌或其他技术原因没有交易记录的个股之外，本基金的股票资产加权平均变现天数为0.94天，其中持仓股票最长变现天数为4.31天；2010年12月31日，本基金债券资产组合久期为0.34年，其中持仓债券最长久期为0.34年。

以2009年12月31日股票持仓量为基准，在其他变量不变的假设情况下，以当月股票市场的平均活跃度为依据，除去因停牌或其他技术原因没有交易记录的个股之外，本基金的股票资产加权平均变现天数为0.20天，其中持仓股票最长变现天数为0.80天；2009年12月31日，本基金仅持仓一只债券资产，其久期为0.34年。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过 MSCI Barra Aegis System 等量化风险控制软件对基金市场风险进行定量测定。

7.4.13.4.1 利率风险

本基金持有的股票资产不计利息。对于计息类交易性金融资产，本基金通过合理搭配其期限结构，从而达到有效降低基金利率风险的目的。

下表分别列示了截止2010年12月31日与2009年12月31日，本基金所面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进

行了分类。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010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	12,809,038.72	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	12,809,038.72
结算备付金	451,260,458.35	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	451,260,458.35
存出保证金	103,913.63	0.00	0.00	0.00	0.00	4,429,402.10	4,533,315.73
交易性金融资产	0.00	0.00	195,260,000.00	0.00	0.00	5,342,703,425.10	5,537,963,425.10
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,487,965.96	2,487,965.96
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	4,492,232.72	4,492,232.72
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	464,173,410.70	0.00	195,260,000.00	0.00	0.00	5,354,113,025.88	6,013,546,436.58
负债							
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	33,543,275.62	33,543,275.62
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,253,206.88	1,253,206.88
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	7,181,553.78	7,181,553.78
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,196,925.64	1,196,925.64
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	4,625,122.84	4,625,122.84
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	54,643.83	54,643.83
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,159,185.59	2,159,185.59
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	50,013,914.18	50,013,914.18
利率敏感度缺口	464,173,410.70	0.00	195,260,000.00	0.00	0.00	5,304,099,111.70	5,963,532,522.40
上年度末 2009年12月31日							
资产							
银行存款	27,138,195.05	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	27,138,195.05
结算备付金	566,804,774.99	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	566,804,774.99

存出保证金	103,913.63	0.00	0.00	0.00	0.00	6,313,762.89	6,417,676.52
交易性金融资产	0.00	0.00	249,650,000.00	0.00	0.00	4,616,776,803.97	4,866,426,803.97
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	184,274,668.06	184,274,668.06
应收利息	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,199,563.03	2,199,563.03
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	304,444.31	304,444.31
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	594,046,883.67	0.00	249,650,000.00	0.00	0.00	4,809,869,242.26	5,653,566,125.93
负债							
应付证券清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	117,484,790.88	117,484,790.88
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,643,671.86	5,643,671.86
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	7,036,238.65	7,036,238.65
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,172,706.45	1,172,706.45
应付交易费用	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	9,598,235.12	9,598,235.12
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	673,100.06	673,100.06
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	141,608,743.02	141,608,743.02
利率敏感度缺口	594,046,883.67	0.00	249,650,000.00	0.00	0.00	4,668,260,499.24	5,511,957,382.91

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析数据结果为基于本基金报表日组合持有债券资产的利率风险状况测算的理论变动值。		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他市场变量均不发生变化。		
	此项影响并未考虑基金经理为降低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
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）	
		本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
	利率下降 25 个基点	增加 17.13 万元	增加 21.12 万元
	利率上升 25 个基点	减少 17.08 万元	减少 21.05 万元

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金没有持有外汇资产及负债，故汇率变化不会对本基金产生重大的影响。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要是指除利率和汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险，本基金的

其他价格风险主要由股票价格变动对基金资产造成损失的可能性。

本基金通过资产优化配置降低股票市场价格风险。此外，本基金管理人定期运用多种定量方法进行风险度量和分析。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31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	5,342,703,425.10	89.59	4,616,776,803.97	83.76
交易性金融资产-债券投资	195,260,000.00	3.27	249,650,000.00	4.53
衍生金融资产-权证投资	0.00	0.00	0.00	0.00
其他	0.00	0.00	0.00	0.00
合计	5,537,963,425.10	92.86	4,866,426,803.97	88.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	测算组合市场价格风险的数据为沪深300指数变动时，股票资产相应的理论变动值。		
	假定沪深300指数变化5%，其他市场变量均不发生变化。		
	Beta系数是根据报表日持仓资产在过去100个交易日收益率与期对应指数收益率回归加权得出，对于交易少于100个交易日的资产，默认其波动与市场同步。		
	假定市场无风险利率为一年定期存款利率。		
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）	
		本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	-5%	减少 20,634.07 万元	减少 20,651.25 万元
	+5%	增加 20,634.07 万元	增加 20,651.25 万元

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

假设	假定基金收益率的分布服从正态分布。		
	根据基金单位净值收益率在报表日过去100个交易日的分布情况。		
	以95%的置信区间计算基金日收益率的绝对VaR值（不足100个交易日不予计算）		
分析	风险价值 (单位：%)	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	收益率绝对VaR	2.37	3.33

§ 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	5,342,703,425.10	88.84
	其中：股票	5,342,703,425.10	88.84
2	固定收益投资	195,260,000.00	3.25
	其中：债券	195,260,000.00	3.25
	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	464,069,497.07	7.72
6	其他各项资产	11,513,514.41	0.19
7	合计	6,013,546,436.58	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	59,936,079.20	1.01
B	采掘业	138,631,269.36	2.32
C	制造业	2,330,400,785.84	39.08
C0	食品、饮料	487,167,928.92	8.17
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	34,676,936.64	0.58
C4	石油、化学、塑胶、塑料	104,172,915.58	1.75
C5	电子	735,458,239.38	12.33
C6	金属、非金属	58,749,973.21	0.99
C7	机械、设备、仪表	596,629,380.23	10.00
C8	医药、生物制品	276,061,296.76	4.63
C99	其他制造业	37,484,115.12	0.63
D	电力、煤气及水的生产和供应业	15,932,148.90	0.27
E	建筑业	785,250,875.06	13.17
F	交通运输、仓储业	-	-

G	信息技术业	688,046,308.26	11.54
H	批发和零售贸易	117,135,228.60	1.96
I	金融、保险业	345,575,393.28	5.79
J	房地产业	372,436,938.90	6.25
K	社会服务业	95,150,425.60	1.60
L	传播与文化产业	19,706,642.00	0.33
M	综合类	374,501,330.10	6.28
	合计	5,342,703,425.10	89.59

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	601318	中国平安	6,153,408.00	345,575,393.28	5.79
2	002304	洋河股份	1,263,267.00	282,971,808.00	4.75
3	002106	莱宝高科	3,819,934.00	253,070,627.50	4.24
4	600256	广汇股份	5,850,095.00	245,294,483.35	4.11
5	002081	金螳螂	3,542,492.00	243,652,599.76	4.09
6	600415	小商品城	6,653,225.00	233,129,004.00	3.91
7	002375	亚厦股份	2,411,279.00	221,789,442.42	3.72
8	600406	国电南瑞	2,503,981.00	180,436,870.86	3.03
9	600970	中材国际	4,325,987.00	176,110,930.77	2.95
10	002296	辉煌科技	2,395,836.00	164,905,391.88	2.77
11	002073	软控股份	5,487,917.00	146,472,504.73	2.46
12	600537	海通集团	3,643,490.00	146,395,428.20	2.45
13	002241	歌尔声学	2,157,663.00	117,959,436.21	1.98
14	600252	中恒集团	3,009,586.00	106,689,823.70	1.79
15	600067	冠城大通	11,742,081.00	102,156,104.70	1.71
16	002230	科大讯飞	1,185,844.00	93,681,676.00	1.57
17	002431	棕榈园林	915,659.00	83,324,969.00	1.40
18	002236	大华股份	910,817.00	76,399,329.96	1.28
19	300083	劲胜股份	1,590,124.00	73,145,704.00	1.23
20	002024	苏宁电器	5,388,689.00	70,591,825.90	1.18
21	600240	华业地产	9,058,793.00	67,488,007.85	1.13
22	000581	威孚高科	1,712,769.00	63,629,368.35	1.07
23	600690	青岛海尔	2,226,965.00	62,822,682.65	1.05
24	002369	卓翼科技	1,362,949.00	61,659,812.76	1.03
25	002353	杰瑞股份	430,818.00	61,555,275.84	1.03
26	600123	兰花科创	1,174,344.00	55,288,115.52	0.93

27	600298	安琪酵母	1,222,274.00	54,122,292.72	0.91
28	000423	东阿阿胶	1,037,702.00	53,026,572.20	0.89
29	002396	星网锐捷	1,185,679.00	50,047,510.59	0.84
30	002453	天马精化	1,057,632.00	47,593,440.00	0.80
31	002399	海普瑞	321,570.00	44,740,034.10	0.75
32	002152	广电运通	785,405.00	42,710,323.90	0.72
33	002086	东方海洋	2,261,148.00	41,718,180.60	0.70
34	002415	海康威视	427,306.00	40,294,955.80	0.68
35	002056	横店东磁	928,660.00	36,459,191.60	0.61
36	600742	一汽富维	1,200,000.00	36,252,000.00	0.61
37	300070	碧水源	287,424.00	35,928,000.00	0.60
38	000063	中兴通讯	1,307,392.00	35,691,801.60	0.60
39	600770	综艺股份	1,598,272.00	34,682,502.40	0.58
40	002303	美盈森	827,217.00	34,676,936.64	0.58
41	002469	三维工程	427,034.00	33,308,652.00	0.56
42	600535	天士力	800,858.00	32,642,972.08	0.55
43	002063	远光软件	1,039,676.00	32,333,923.60	0.54
44	002376	新北洋	683,668.00	32,262,292.92	0.54
45	600169	太原重工	1,485,199.00	31,664,442.68	0.53
46	002410	广联达	442,104.00	31,389,384.00	0.53
47	002065	东华软件	1,006,502.00	30,970,066.54	0.52
48	002146	荣盛发展	2,109,400.00	28,666,746.00	0.48
49	300115	长盈精密	441,079.00	28,493,703.40	0.48
50	000039	中集集团	1,220,275.00	28,054,122.25	0.47
51	002310	东方园林	197,777.00	27,291,248.23	0.46
52	002326	永太科技	475,031.00	27,076,767.00	0.45
53	002177	御银股份	1,468,748.00	26,716,526.12	0.45
54	600557	康缘药业	1,365,741.00	25,512,041.88	0.43
55	600048	保利地产	2,004,231.00	25,453,733.70	0.43
56	002444	巨星科技	599,812.00	23,140,746.96	0.39
57	600422	昆明制药	1,645,030.00	22,833,016.40	0.38
58	002055	得润电子	770,582.00	21,137,064.26	0.35
59	000090	深天健	1,721,300.00	20,431,831.00	0.34
60	600268	国电南自	745,620.00	20,191,389.60	0.34
61	601699	潞安环能	325,700.00	19,424,748.00	0.33
62	600778	友好集团	1,405,264.00	18,718,116.48	0.31
63	600335	鼎盛天工	1,128,046.00	18,612,759.00	0.31
64	600479	千金药业	992,183.00	18,226,401.71	0.31
65	600750	江中药业	500,000.00	18,015,000.00	0.30
66	002427	尤夫股份	839,999.00	17,992,778.58	0.30
67	600522	中天科技	548,832.00	16,931,467.20	0.28

68	002398	建研集团	522,138.00	16,891,164.30	0.28
69	600276	恒瑞医药	281,700.00	16,778,052.00	0.28
70	300006	莱美药业	447,351.00	16,408,834.68	0.28
71	000419	通程控股	1,518,001.00	15,999,730.54	0.27
72	600292	九龙电力	831,966.00	15,932,148.90	0.27
73	300027	华谊兄弟	534,600.00	15,679,818.00	0.26
74	000888	峨眉山A	872,113.00	15,043,949.25	0.25
75	002214	大立科技	359,823.00	14,680,778.40	0.25
76	000650	仁和药业	640,500.00	14,667,450.00	0.25
77	300075	数字政通	266,770.00	14,245,518.00	0.24
78	002202	金风科技	613,041.00	13,670,814.30	0.23
79	002290	禾盛新材	338,506.00	12,176,060.82	0.20
80	002475	立讯精密	217,217.00	12,157,635.49	0.20
81	601299	中国北车	1,700,000.00	12,053,000.00	0.20
82	600284	浦东建设	589,350.00	11,669,130.00	0.20
83	002250	联化科技	280,730.00	11,509,930.00	0.19
84	300022	吉峰农机	345,404.00	11,052,928.00	0.19
85	002069	獐子岛	240,600.00	10,309,710.00	0.17
86	000826	桑德环境	262,900.00	8,772,973.00	0.15
87	600525	长园集团	369,000.00	8,416,890.00	0.14
88	600518	康美药业	389,481.00	7,676,670.51	0.13
89	300080	新大新材	133,200.00	7,555,104.00	0.13
90	601766	中国南车	1,000,000.00	7,550,000.00	0.13
91	300105	龙源技术	54,368.00	6,627,459.20	0.11
92	002299	圣农发展	164,300.00	5,906,585.00	0.10
93	002244	滨江集团	490,600.00	5,533,968.00	0.09
94	002213	特尔佳	320,700.00	5,500,005.00	0.09
95	300133	华策影视	34,714.00	4,026,824.00	0.07
96	600519	贵州茅台	20,000.00	3,678,400.00	0.06
97	300142	沃森生物	21,616.00	2,879,251.20	0.05
98	300101	国腾电子	25,504.00	2,755,962.24	0.05
99	300049	福瑞股份	100,000.00	2,655,000.00	0.04
100	002261	拓维信息	60,177.00	2,394,442.83	0.04
101	600395	盘江股份	72,600.00	2,363,130.00	0.04
102	300125	易世达	25,115.00	2,096,851.35	0.04
103	002477	雏鹰农牧	34,932.00	2,001,603.60	0.03
104	002060	粤水电	85,578.00	980,723.88	0.02
105	601933	永辉超市	24,732.00	772,627.68	0.01

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	601318	中国平安	472,896,120.06	8.58
2	601601	中国太保	328,458,548.88	5.96
3	600016	民生银行	272,378,392.98	4.94
4	600036	招商银行	236,583,940.22	4.29
5	600415	小商品城	214,097,875.67	3.88
6	002304	洋河股份	206,043,501.51	3.74
7	600256	广汇股份	196,843,568.09	3.57
8	600537	海通集团	190,945,744.36	3.46
9	600030	中信证券	182,250,479.42	3.31
10	002375	亚厦股份	179,382,541.47	3.25
11	600970	中材国际	171,380,395.48	3.11
12	600000	浦发银行	170,388,465.87	3.09
13	600406	国电南瑞	162,502,077.73	2.95
14	002081	金螳螂	154,990,791.15	2.81
15	000002	万科A	147,896,617.13	2.68
16	600067	冠城大通	141,161,698.09	2.56
17	600240	华业地产	134,736,081.52	2.44
18	002073	软控股份	134,161,053.14	2.43
19	601111	中国国航	134,031,658.80	2.43
20	002230	科大讯飞	133,199,903.00	2.42
21	601166	兴业银行	126,520,942.67	2.30
22	000402	金融街	125,522,341.37	2.28
23	600742	一汽富维	124,066,112.21	2.25
24	000858	五粮液	120,170,197.63	2.18
25	002241	歌尔声学	117,422,479.24	2.13

注：本报告期内，买入股票成本总额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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	601601	中国太保	401,488,321.69	7.28

2	601318	中国平安	364,653,438.07	6.62
3	600036	招商银行	320,152,261.48	5.81
4	601166	兴业银行	303,080,025.14	5.50
5	600030	中信证券	285,785,342.91	5.18
6	600016	民生银行	253,488,311.47	4.60
7	000858	五 粮 液	243,393,691.84	4.42
8	601169	北京银行	233,423,040.59	4.23
9	000983	西山煤电	184,432,024.77	3.35
10	600015	华夏银行	176,255,773.86	3.20
11	600028	中国石化	150,504,588.53	2.73
12	600000	浦发银行	146,328,198.40	2.65
13	600519	贵州茅台	145,370,480.56	2.64
14	601111	中国国航	143,308,561.53	2.60
15	000063	中兴通讯	142,076,960.90	2.58
16	000002	万 科 A	136,894,216.33	2.48
17	000402	金 融 街	125,996,620.74	2.29
18	600019	宝钢股份	121,267,387.38	2.20
19	600348	国阳新能	114,640,655.28	2.08
20	601666	平煤股份	110,611,850.50	2.01

注：本报告期内，卖出股票收入总额是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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

买入股票的成本（成交）总额	13,645,480,680.30
卖出股票的收入（成交）总额	13,760,806,884.71

注：本报告期内，买入股票成本总额和卖出股票收入总额都是以股票成交金额（成交单价乘以成交数量）列示的，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	-	-
2	央行票据	195,260,000.00	3.27
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	-	-
7	其他	-	-
8	合计	195,260,000.00	3.27

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	占基金资产净值比例（%）
1	1001038	10 央行票据 38	2,000,000	195,260,000.00	3.27

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

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

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 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

8.9.2 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	4,533,315.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,487,965.96
5	应收申购款	4,492,232.72
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	11,513,514.41
---	----	---------------

8.9.4 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。

8.9.5 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。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本基金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。

§ 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
256,200	33,965.28	1,785,862,436.70	20.52%	6,916,042,294.09	79.48%

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	495,416.93	0.0057%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2004年9月28日)基金份额总额	1,017,619,728.79
本报告期期初基金份额总额	6,772,297,037.54
本报告期基金总申购份额	4,346,984,015.85
减：本报告期基金总赎回份额	2,417,376,322.60
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,701,904,730.79

注：报告期间基金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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未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，本基金管理人免去顾建国先生副总经理职务；免去方培池先生副总经理职务；免去储晓明先生董事长职务；免去宋宇先生督察长职务；聘请宋宇先生担任副总经理职务；聘请朱冰峰先生担任督察长职务。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘请江苏公证天业会计师事务所有限公司提供审计服务，本报告期内已预提审计费150,000.00元，截至2010年12月31日暂未支付；本基金成立以来一直由该会计师事务所提供审计服务。

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

本报告期内本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

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	
国联证券	2	3,833,333,309.40	14.01%	3,114,604.29	13.66%	-
申银万国	2	5,652,601,337.66	20.66%	4,729,814.67	20.74%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	4,225,388,646.13	15.44%	3,476,986.00	15.25%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	2	1,618,003,434.77	5.91%	1,360,248.41	5.97%	-
中信建投证券	2	2,410,909,339.62	8.81%	1,996,182.45	8.75%	-
德邦证券	1	1,972,895,837.78	7.21%	1,676,954.08	7.35%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	5,440,930,212.81	19.88%	4,624,776.33	20.28%	-
华泰联合证券	1	315,943,208.98	1.15%	268,551.74	1.18%	-
东海证券	1	1,019,567,171.23	3.73%	828,405.39	3.63%	-
中信金通证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	72,768,052.55	0.27%	61,853.13	0.27%	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	279,962,800.50	1.02%	237,967.49	1.04%	-
国金证券	2	476,587,785.67	1.74%	387,230.78	1.70%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	43,883,242.19	0.16%	37,300.91	0.16%	-

注 1：本基金以券商研究服务质量作为交易单元的选择标准，具体评分指标分为研究支持和服务支持，研究支持包括券商研究报告质量、投资建议、委托课题、业务培训、数据提供等；服务支持包括券商组织上门路演，联合调研和各类投资研讨会。根据我公司及基金法律文件中对券商交易单元的选择标准，并参照我公司券商研究服务质量评分标准，确定拟租用交易单元的所属券商名单；由我公司相关部门分别与券商对应部门进行商务谈判，草拟证券交易单元租用协议并汇总修改意见完成协议初稿；报监察稽核部审核后确定租用交易单元。

注 2：本报告期内新增了广发证券的上海交易单元，申银万国证券、长江证券、国金证券、中信建投证券、东方证券、广发证券的深圳交易单元。

注 3：上述佣金按市场佣金率计算，已扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示

注 4：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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国联证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	9,903,639.72	20.47%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	20,632,061.28	42.65%	-	-	-	-
中信建投证券	3,386,607.43	7.00%	-	-	-	-
德邦证券	14,452,949.60	29.88%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	530,000,000.00	100.00%	-	-
华泰联合证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信金通证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与深圳发展银行基金定投及申购费率优惠推广活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-15
2	中海优质成长证券投资基金 2009 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-01-22

3	中海基金管理有限公司关于公司章程修订及法定代表人变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-02-08
4	中海基金管理有限公司关于新增东兴证券股份有限公司为旗下开放式基金代销机构并开通转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-02-22
5	中海基金管理有限公司关于暂停向深圳证券交易所发送旗下基金基金净值数据的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-02-25
6	中海优质成长证券投资基金第五次分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-05
7	中海优质成长证券投资基金 2009 年年度报告	中海基金网站	2010-03-27
8	中海优质成长证券投资基金 2009 年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-03-27
9	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与东方证券股份有限公司网上、电话、手机委托交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-07
10	中海基金管理有限公司关于调整旗下基金在上海浦东发展银行定期定额投资起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-08
11	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与兴业证券股份有限公司定期定额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	2010-04-12
12	中海优质成长证券投资基金 2010 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-21
13	中海基金管理有限公司关于副总经理离任的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-24
14	中海基金管理有限公司关于直销账户开户银行名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-27
15	中海基金管理有限公司关于旗下基金继续参与深圳发展银行基金定投及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	2010-04-28
16	中海基金管理有限公司关于非法机构冒用公司名称从事非法证券活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-04-29
17	中海优质成长证券投资基金更新招募说明书（2010 年第 1 号）	中海基金网站	2010-05-11
18	中海优质成长证券投资基金更新招募说明书摘要（2010 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-11
19	中海基金管理有限公司关于旗下基金在代销机构开通定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-05-21
20	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与东吴证券有限责任公司网上交易系统基金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	2010-05-21

21	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中信银行股份有限公司个人网银申购开放式基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-01
22	中海基金管理有限公司关于副总经理离任的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-05
23	中海基金管理有限公司关于旗下基金在中银万国证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-06-08
24	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与安信证券股份有限公司网上基金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	2010-06-23
25	中海基金关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-01
26	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行基金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	2010-07-01
27	中海优质成长证券投资基金 2010 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-17
28	中海基金管理有限公司关于旗下基金在信达证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-26
29	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与信达证券股份有限公司非现场委托方式基金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	2010-07-26
30	中海基金管理有限公司关于旗下部分基金后端收费模式新增华泰联合证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-07-29
31	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与国泰君安证券股份有限公司网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-18
32	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与金元证券股份有限公司网上交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-23
33	中海优质成长证券投资基金 2010 年半年度报告	中海基金网站	2010-08-27
34	中海优质成长证券投资基金 2010 年半年度报告（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-08-27
35	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与齐鲁证券有限公司网上交易系统基金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	2010-08-30
36	中海基金管理有限公司关于恢复对旗下基金持有的长期停牌股票“中国平安”进行市价估值的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-09-03

37	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与华泰证券股份有限公司网上交易系统及现场柜台系统基金定期定额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	2010-09-21
38	中海基金管理有限公司关于旗下基金在中国建银投资证券有限责任公司开通定期定额申购业务并参与基金定投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	2010-09-30
39	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中国农业银行股份有限公司网上银行基金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	2010-10-08
40	中海基金管理有限公司关于旗下基金在长江证券股份有限公司开通定期定额申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-10-20
41	中海优质成长证券投资基金 2010 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-10-27
42	中海优质成长证券投资基金更新招募说明书（2010 年第 2 号）	中海基金网站	2010-11-11
43	中海优质成长证券投资基金更新招募说明书摘要（2010 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-11-11
44	中海基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件或者身份证明文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-10
45	中海基金管理有限公司关于免去储晓明先生公司董事长职务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-18
46	中海基金管理有限公司关于旗下基金继续参与深圳发展银行基金定投及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	2010-12-29
47	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与中国工商银行股份有限公司基金定期定额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	2010-12-29
48	中海基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-30
49	中海基金管理有限公司关于旗下基金参与交通银行股份有限公司网上银行、手机银行基金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	2010-12-31
50	中海基金管理有限公司关于调整旗下基金在交通银行股份有限公司定期定额申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准募集中海优质成长证券投资基金的文件
- 2、中海优质成长证券投资基金基金合同
- 3、中海优质成长证券投资基金托管协议
- 4、中国证监会批准国联基金管理有限公司更名为中海基金管理有限公司的文件
- 5、中海优质成长证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路 68 号 2905-2908 室及 30 层。

12.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中海基金管理有限公司。

咨询电话：(021)38789788 或 400-888-9788

公司网址：<http://www.zhfund.com>

中海基金管理有限公司

二〇一一年三月三十日