

信诚优胜精选股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

2010 年 12 月 31 日

基金管理人：信诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2011 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2011 年 3 月 29 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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	信诚优胜精选股票
基金主代码	550008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 8 月 26 日
基金管理人	信诚基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,409,567,427.36 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于具有积极变化特征的公司,追求高于基准的超额收益,在控制风险的前提下,追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金定位为股票型基金,其战略性资产配置以股票为主,并不因市场的中短期变化而改变。在不同的市场条件下,本基金将根据 MVRS 模型,综合考虑宏观环境、市场估值水平、风险水平以及市场情绪,在一定的范围内作战术性资产配置调整,以降低系统性风险对基金收益的影响。</p> <p>本基金认为,上市公司的长期发展遵循“优胜劣汰”的规律。企业应根据所处的外部环境变化而不断积极变化。精选该类“优胜”上市公司,能够实现基金长期稳定增值的投资目标。</p> <p>同时,上市公司的积极变化会依次在管理人态度、公司财务数据和股票价格上先后反映。在积极变化反映到股票价格之前,介入该类上市公司的投资,能够创造超额收益。鉴于此,本基金的股票投资将以“自下而上”的精选策略为主,以甄别产生积极变化的上市公司。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较标准为 80%×中信标普 A 股综合指数收益率+20%×中信全债指数收

	益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金中的高风险、高收益品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		信诚基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	唐世春	尹东
	联系电话	021-68649788	010-67595003
	电子邮箱	shichun.tang@citicpru.com.cn	yindong@ccb.cn
客户服务电话		400-666-0066/021-51085168	010-67595096
传真		021-50120888	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.citicprufunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所和营业场所

§ 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 08 月 26 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
本期已实现收益	170,227,053.74	61,659,790.55
本期利润	299,479,704.41	182,818,221.42
加权平均基金份额本期利润	0.1162	0.0846
本期基金份额净值增长率	7.05%	7.80%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末
期末可供分配基金份额利润	0.1037	0.0313
期末基金资产净值	2,780,162,214.93	2,162,587,117.01
期末基金份额净值	1.154	1.078
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末
基金份额累计净值增长率	15.40%	7.80%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

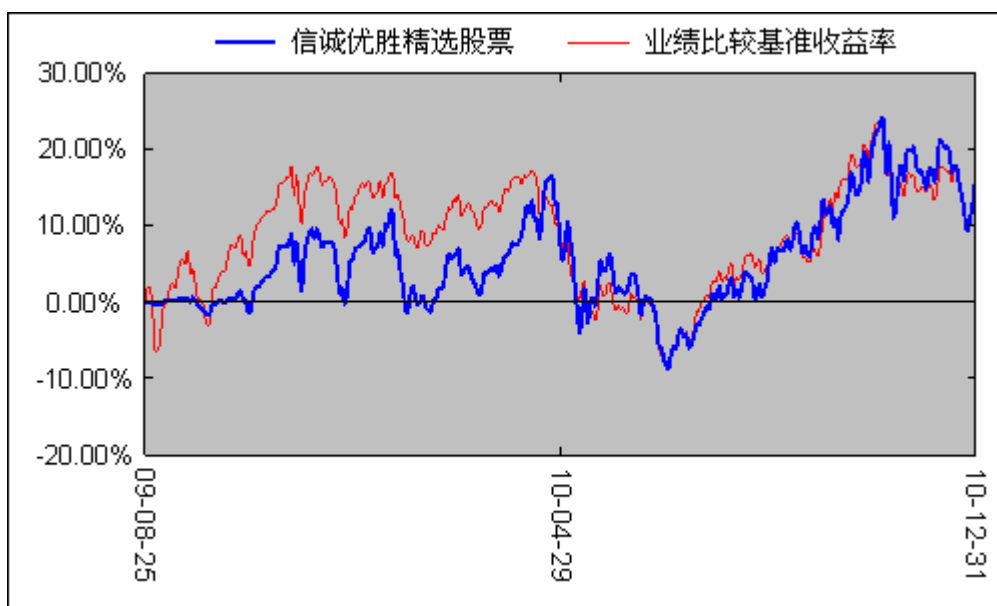
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	4.53%	1.90%	5.38%	1.37%	-0.85%	0.53%
过去六个月	22.64%	1.59%	21.55%	1.22%	1.09%	0.37%
过去一年	7.05%	1.64%	-1.93%	1.26%	8.98%	0.38%
自基金合同生效起至今	15.40%	1.53%	13.41%	1.35%	1.99%	0.18%

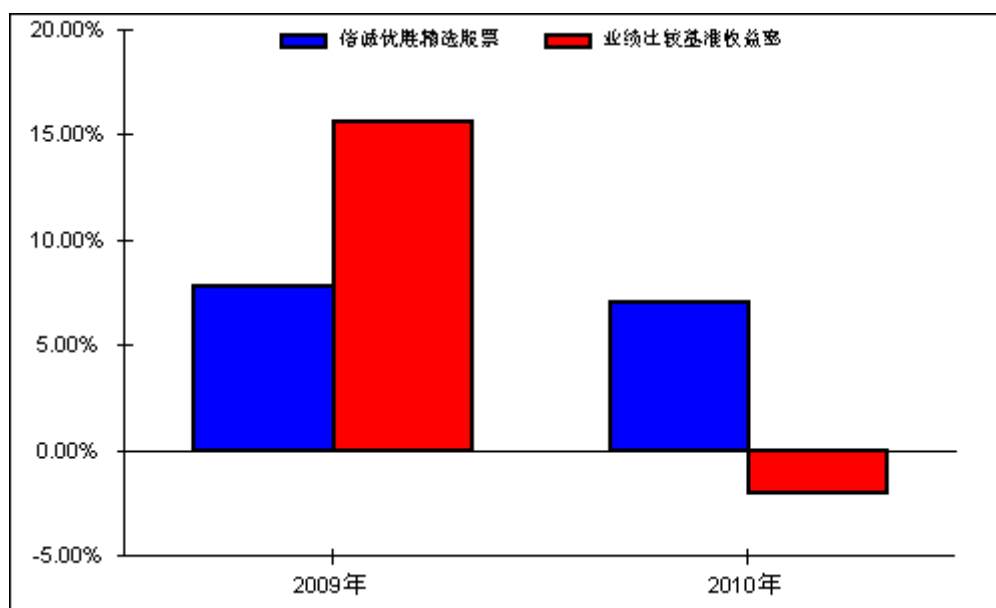
注：本基金的业绩比较标准为 $80\% \times$ 中信标普 A 股综合指数收益率 $+20\% \times$ 中信全债指数收益率。

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



注：本基金建仓期自 2009 年 8 月 26 日至 2010 年 2 月 26 日，建仓期结束时资产配置比例符合本基金基金合同规定。

3.2.2 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同自 2009 年 8 月 26 日起生效。截至 2010 年 12 月 31 日,未进行过利润分配。

§ 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

本基金管理人信诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于 2005 年 9 月 30 日正式成立,注册资本 2 亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为 49%、49%、2%。截至 2010 年底,本基金管理人共管理 10 只基金,分别为信诚四季红混合型证券投资基金、信诚精萃成长股票型证券投资基金、信诚盛世蓝筹股票型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚经典优债债券型证券投资基金、信诚优胜精选股票型证券投资基金、信诚中小盘股票型证券投资基金、信诚深度价值股票型证券投资基金 (LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金和信诚金砖四国积极配置证券投资基金 (LOF)。

4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理简介

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		
黄坚	本基金基金经理,信诚基金管理有限公司副总经理、首席投资官兼股票投资总监	2009 年 8 月 26 日	-	10	经济学硕士,历任申银万国证券公司研究所行业分析师,银华基金管理有限公司行业研究员、投资管理部组合经理,担任多只基金的基金经理(银华道琼斯 88 精选证券投资基金,2004 年 8 月至 2005 年 4 月;天华证券投资基金,2004 年 12 月至 2005 年 9 月;银华优势企业证券投资基金,2005 年 9 月至 2006 年 4 月);华宝兴业基金管理有限公司基金经理(华宝兴业多策略股票基金,2006 年 9 月至 2007 年 10 月)。

注:1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日;若该基金经理自基金合同生效日起即任职,则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及基金合同和招募说明书的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生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专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

针对中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司采取了一系列行动来落实指导意见中的各项要求。明确了各部门在公平交易执行中的具体责任，在日常交易中，严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的有关规定对本基金的日常交易行为进行监控。对于交易所公开竞价交易，在恒生交易系统中执行公平交易程序，确保不同基金在买卖同一证券时，按照时间优先，比例分配的原则在各基金间公平分配交易量。对于场外交易，通过业务流程的人为控制执行公平交易程序。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本基金管理人旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内无异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2010 年是股市结构性特征特别明显的一年。在国家倡导经济结构调整、增长方式转变的大背景下，节能环保、新一代信息技术、生物、新能源等战略性新兴产业获得政策大力支持，在股市上也有较好表现；与此同时，政策对房地产市场进行持续的调控，金融、地产、钢铁等相关行业表现较弱。2010 年本基金将主要资产配置在电子信息、医药及消费等行业上，在区域上则侧重在国家重点支持的新疆等区域。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2010 年，本基金净值增长 7.05%，超越业绩比较基准 8.98 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，经济形势面临诸多变数。首先是高企的全球大宗商品价格和粮食价格容易引发通胀，而通胀压力又使得紧缩的货币政策会在全年成为常态；在货币政策偏紧的同时，实体经济仍保持旺盛的格局，中西部和东部沿海同时出现用工荒，资产价格仍不断上涨，而资产价格和劳动力成本的上升又会推升企业成本，影响到企业的利润。此外，作为“十二五”规划的元年，又是经济增长方式转变的“起承转合”之年，经济增长方式能否顺利转变，关乎中国经济前景，自然也关乎股市的起落。

面对复杂多变的经济形势和政策环境，本基金将致力于寻找到能够穿越经济周期、持续增长、同时估值合理的股票来规避经济和货币政策波动的影响；同时，尽量利用市场震荡较多的特点，通过适当波段操作来降低风险，获得收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务，本基金管理人对估值和定价过程进行了最严格的控制。本基金管理人通过建立估值决策委员来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员：首席运营官(会议主席)、副首席运营官、风险控制总监/专员、数量研究员、交易总监、运营总监、基金会计主管。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上，综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见，确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或

投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人将基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

基金份额净值公告需经处理估值的操作人员、复核估值的复核人员和基金运营总监三人确认后,方可对外发布。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具有专业会计学习经历,具有会计上岗证和基金从业人员资格

本基金管理人的估值人员平均拥有6年金融从业经验和3年本基金管理公司的基金从业和基金估值经验

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,将通过首席投资官提请召开估值决策委员会会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配应遵循下列原则:

1. 本基金的每份基金份额享有同等分配权;
2. 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资人自行承担。当投资人的现金红利小于一定金额,不足以支付银行转账或其他手续费用时,基金注册登记机构可将投资人的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额;
3. 本基金收益每年最多分配 12 次,每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 25%(期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数);
4. 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;
5. 本基金收益分配方式分为两种:现金分红与红利再投资,投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资;若投资人不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;
6. 基金红利发放日距离收益分配基准日(即期末可供分配利润计算截至日)的时间不得超过 15 个工作日;
7. 基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;
8. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

本基金的收益分配情况符合本基金的利润分配机制,本基金本期间的利润分配严格遵守了上述原则。

截至 2010 年 12 月 31 日,本基金尚未进行过利润分配。

§ 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

本报告期,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 信诚优胜精选股票型证券投资基金
报告截止日: 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	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	218,370,428.08	385,798,368.94
结算备付金	13,445,113.46	17,649,450.77
存出保证金	2,198,444.65	215,484.41
交易性金融资产	2,452,353,959.87	1,821,987,189.08
其中: 股票投资	2,452,353,959.87	1,821,987,189.08
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	105,296,303.97	13,493,364.05
应收利息	64,108.25	57,626.97

应收股利	-	-
应收申购款	346,866.68	24,687.58
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	2,792,075,224.96	2,239,226,171.80
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2010年12月31日	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	-	20,331,981.18
应付赎回款	336,883.40	47,278,545.28
应付管理人报酬	3,609,521.23	2,376,336.89
应付托管费	601,586.86	396,056.17
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	6,924,006.98	5,905,673.72
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	441,011.56	350,461.55
负债合计	11,913,010.03	76,639,054.79
所有者权益:		
实收基金	2,409,567,427.36	2,006,237,023.69
未分配利润	370,594,787.57	156,350,093.32
所有者权益合计	2,780,162,214.93	2,162,587,117.01
负债和所有者权益总计	2,792,075,224.96	2,239,226,171.80

注：报告截止日 2010 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.154 元，基金份额总额 2,409,567,427.36 份。

7.2 利润表

会计主体：信诚优胜精选股票型证券投资基金

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	上年度可比期间 2009年8月26日(基金合 同生效日)至2009年12 月31日
一、收入	389,026,887.70	208,787,601.96
1. 利息收入	3,293,665.74	3,016,783.79
其中：存款利息收入	3,293,665.74	3,016,783.79
债券利息收入	-	-

资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	253,983,423.03	83,341,074.41
其中：股票投资收益	243,804,027.68	83,341,074.41
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	10,179,395.35	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	129,252,650.67	121,158,430.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	2,497,148.26	1,271,312.89
减：二、费用	89,547,183.29	25,969,380.54
1. 管理人报酬	41,180,376.20	11,579,429.13
2. 托管费	6,863,396.05	1,929,904.90
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	40,915,208.77	12,226,034.62
5. 利息支出	-	-
其中：卖出回购金融资产支出	-	-
6. 其他费用	588,202.27	234,011.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	299,479,704.41	182,818,221.42

注：本基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日。因此利润表上年度可比期间为 2009 年 8 月 26 日起至 2009 年 12 月 31 日。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚优胜精选股票型证券投资基金

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）	2,006,237,023.69	156,350,093.32	2,162,587,117.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	299,479,704.41	299,479,704.41
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）	403,330,403.67	-85,235,010.16	318,095,393.51
其中：1. 基金申购款	2,379,438,754.00	123,945,298.77	2,503,384,052.77
2. 基金赎回款	-1,976,108,350.33	-209,180,308.93	-2,185,288,659.26

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）	2,409,567,427.36	370,594,787.57	2,780,162,214.93
项目	上年度可比期间 2009年8月26日(基金合同生效日)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）	2,356,333,486.41	-	2,356,333,486.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	182,818,221.42	182,818,221.42
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）	-350,096,462.72	-26,468,128.10	-376,564,590.82
其中：1. 基金申购款	561,486,529.50	41,305,603.96	602,792,133.46
2. 基金赎回款	-911,582,992.22	-67,773,732.06	-979,356,724.28
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）	2,006,237,023.69	156,350,093.32	2,162,587,117.01

注：本基金合同生效日为 2009 年 8 月 26 日。因此所有者权益基金净值变动表上年度可比期间为 2009 年 8 月 26 日起至 2009 年 12 月 31 日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王俊锋 桂思毅 詹朋
 基金管理公司负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

信诚优胜精选股票型证券投资基金（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”）《关于核准信诚优胜精选股票型证券投资基金募集的批复》（证监许可[2009]540 号文）和《关于信诚优胜精选股票型证券投资基金备案确认的函》（基金部函[2009]569 号文）批准，由信诚基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《信诚优胜精选股票型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2009 年 8 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为信诚基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《信诚优胜精选股票型证券投资基金基金合同》和《信诚优胜精选股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为

具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的 60%-95%;债券、资产支持证券等固定收益类证券品种占基金资产的 0-40%;现金或到期日在一年内的政府债券不低于基金资产净值的 5%;权证不超过基金资产净值的 3%。当法律法规的相关规定变更时,基金管理人在履行适当程序后可对上述资产配置比例进行适当调整。本基金的业绩比较标准为 $80\% \times$ 中信标普 A 股综合指数收益率 $+20\% \times$ 中信全债指数收益率。

根据《证券投资基金信息披露管理办法》,本基金定期报告在公开披露的第二个工作日,报中国证监会和基金管理人主要办公场所所在地中国证监会派出机构备案。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金按照财政部颁布的企业会计准则(2006)、中国证券业协会于 2007 年颁布的《证券投资基金会计核算指引》、《信诚优胜精选股票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 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的规定编制年度财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“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”)的要求,真实、完整地反映了本基金的财务状况、经营成果和基金净值变动情况。

此外,本财务报表同时符合如会计报表附注 7.4.2 所列示的其他有关规定的要求。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需说明会计政策变更事项。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需说明会计估计变更事项。

7.4.4.3 差错更正的说明

本基金在本年度未发生重大会计差错。

7.4.5 税项

根据财税字[1998]55 号文、[2001]61 号文《关于证券投资基金税收问题的通知》、财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税字[2005]11 号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2005]102 号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2005]107 号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》、财税[2007]84 号文《财政部国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

- (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、债券的投资收益暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 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、现金对价, 暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金取得的股票的股息、红利收入, 债券的利息收入, 由上市公司、发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税, 自 2005 年 6 月 13 日起, 对个人投资者从上市公司取得的股票的股息、红利收入暂减按 50% 计算个人所得税。

(5) 自 2005 年 1 月 24 日起, 基金买卖 A 股、B 股股权所书立的股权转让书据按照 0.1% 的税率征收证券(股票)交易印花税。自 2007 年 5 月 30 日起, 该税率上调至 0.3%。自 2008 年 4 月 24 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 调整证券(股票)交易印花税税率, 由 0.3% 降至 0.1%。自 2008 年 9 月 19 日起, 根据上海证券交易所与深圳证券交易所的相关规定, 证券交易印花税改为单边征收, 即仅对卖出 A 股、B 股股权按 0.1% 的税率征收。

(6) 对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入, 暂不征收个人所得税和企业所得税。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
信诚基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“建设银行”)	基金托管人
中信信托有限责任公司	基金管理人的中方股东
英国保诚集团股份有限公司	基金管理人的外方股东
中新苏州工业园区创业投资有限公司	基金管理人的中方股东
信诚人寿保险有限公司	基金管理人主要股东控制的机构

注: 下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行, 并以一般交易价格为定价基础。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行, 并以一般交易价格为定价基础。

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金在本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位: 人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2009 年 8 月 26 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	41, 180, 376. 20	11, 579, 429. 13
其中: 支付销售机构的客户维护费	2, 769, 383. 24	2, 022, 238. 91

注: 支付基金管理人信诚基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 1.5% 的年费率每日计提, 逐日累计至每月月底, 按月支付。计算公式为: 日基金管理费=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数。

7.4.7.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年	上年度可比期间
----	---------------------------	---------

	12 月 31 日	2009 年 8 月 26 日(基金合同生效日)至 2009 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	6,863,396.05	1,929,904.90

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期及上年度可比期间未与其他关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

基金管理人运用自有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。本基金的基金管理人在本期间未投资过本基金。

7.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2010 年 12 月 31 日		上年度末 2009 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例
信诚人寿保险有限公司	37,699,340.25	1.56%	59,999,000.00	2.99%

注：1、除上表所示外，本基金其它关联方在本期末未持有本基金。

2、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

7.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2009 年 8 月 26 日(基金合同生效日)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
建设银行	218,370,428.08	3,116,259.37	385,798,368.94	2,970,164.74

注：本基金通过“中国建设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的结算备付金，于 2010 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 13,445,113.46 元。(2009 年 12 月 31 日：人民币 17,649,450.77 元)。

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本期间未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.8 期末(2010 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有流通受限的证券。

7.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量（股）	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600518	康美药业	2010-12-28	配股	19.71	2011-01-06	17.29	2,982,170	39,334,938.15	58,778,570.70	-

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至 2010 年 12 月 31 日, 本基金未持有因正回购交易而作为抵押的证券。

§ 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	2,452,353,959.87	87.83
	其中：股票	2,452,353,959.87	87.83
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	231,815,541.54	8.30
6	其他各项资产	107,905,723.55	3.86
7	合计	2,792,075,224.96	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	46,785,805.40	1.68
B	采掘业	405,188,756.37	14.57
C	制造业	1,416,005,013.97	50.93
C0	食品、饮料	155,885,750.66	5.61
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-

C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	136,017,326.23	4.89
C5	电子	261,036,494.10	9.39
C6	金属、非金属	381,083,363.66	13.71
C7	机械、设备、仪表	54,727,641.18	1.97
C8	医药、生物制品	427,254,438.14	15.37
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	275,474,725.61	9.91
H	批发和零售贸易	31,886,228.52	1.15
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	164,499,580.00	5.92
K	社会服务业	69,247,250.00	2.49
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	43,266,600.00	1.56
	合计	2,452,353,959.87	88.21

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002106	莱宝高科	2,716,934	179,996,877.50	6.47
2	600362	江西铜业	3,585,184	161,942,761.28	5.82
3	600256	广汇股份	3,288,490	137,886,385.70	4.96
4	600585	海螺水泥	3,360,446	99,738,037.28	3.59
5	601666	平煤股份	4,558,825	96,145,619.25	3.46
6	600050	中国联通	15,999,905	85,599,491.75	3.08
7	002155	辰州矿业	2,235,131	80,285,905.52	2.89
8	600997	开滦股份	3,811,516	76,725,817.08	2.76
9	300150	世纪瑞尔	1,525,000	72,895,000.00	2.62
10	000423	东阿阿胶	1,417,323	72,425,205.30	2.61

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于 www.citicprufunds.com.cn 网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	----------	----------------

1	600000	浦发银行	398,630,248.97	18.43
2	600036	招商银行	277,673,115.60	12.84
3	600425	青松建化	254,777,696.82	11.78
4	600048	保利地产	202,093,588.11	9.34
5	002092	中泰化学	196,913,181.67	9.11
6	600362	江西铜业	187,975,156.83	8.69
7	600015	华夏银行	176,391,677.81	8.16
8	600256	广汇股份	167,996,646.61	7.77
9	000858	五粮液	161,030,779.60	7.45
10	601288	农业银行	152,393,067.03	7.05
11	002106	莱宝高科	152,084,276.69	7.03
12	000792	盐湖钾肥	148,217,598.79	6.85
13	600432	吉恩镍业	148,185,061.27	6.85
14	600197	伊力特	146,878,848.48	6.79
15	600585	海螺水泥	145,226,192.06	6.72
16	600100	同方股份	144,479,071.45	6.68
17	002142	宁波银行	144,099,656.55	6.66
18	600104	上海汽车	139,211,289.20	6.44
19	000823	超声电子	138,728,617.92	6.41
20	600123	兰花科创	130,408,200.75	6.03
21	601666	平煤股份	130,085,151.24	6.02
22	000960	锡业股份	127,220,186.08	5.88
23	601398	工商银行	126,597,715.95	5.85
24	000973	佛塑股份	120,793,427.95	5.59
25	000021	长城开发	119,949,547.33	5.55
26	600050	中国联通	119,364,152.33	5.52
27	600376	首开股份	119,230,463.12	5.51
28	000009	中国宝安	117,366,584.44	5.43
29	600778	友好集团	117,152,289.09	5.42
30	002007	华兰生物	115,552,730.50	5.34
31	600111	包钢稀土	112,175,081.97	5.19
32	300070	碧水源	109,227,580.12	5.05
33	000568	泸州老窖	108,870,311.96	5.03
34	600016	民生银行	107,735,133.98	4.98
35	600498	烽火通信	100,718,118.73	4.66
36	601168	西部矿业	98,533,459.01	4.56
37	601958	金铂股份	95,965,267.82	4.44
38	600859	王府井	94,271,264.76	4.36
39	002064	华峰氨纶	92,634,463.71	4.28
40	600581	八一钢铁	92,402,802.46	4.27
41	600519	贵州茅台	91,790,807.43	4.24

42	600030	中信证券	90,804,411.04	4.20
43	300150	世纪瑞尔	89,668,084.29	4.15
44	600518	康美药业	89,618,652.99	4.14
45	000623	吉林敖东	88,701,063.38	4.10
46	002155	辰州矿业	87,994,873.03	4.07
47	000826	桑德环境	85,110,215.77	3.94
48	000650	仁和药业	84,624,195.39	3.91
49	000848	承德露露	83,629,904.46	3.87
50	002194	武汉凡谷	81,221,837.08	3.76
51	600325	华发股份	80,630,295.92	3.73
52	600467	好当家	79,666,379.34	3.68
53	600997	开滦股份	76,604,487.62	3.54
54	600267	海正药业	74,831,136.15	3.46
55	000538	云南白药	73,733,839.38	3.41
56	600303	曙光股份	71,933,037.97	3.33
57	600075	新疆天业	71,221,728.31	3.29
58	601628	中国人寿	70,824,574.41	3.27
59	000877	天山股份	70,588,439.69	3.26
60	601318	中国平安	69,662,238.63	3.22
61	000559	万向钱潮	69,077,891.29	3.19
62	600166	福田汽车	68,352,226.50	3.16
63	000423	东阿阿胶	68,282,713.05	3.16
64	300080	新大新材	67,553,303.13	3.12
65	600079	人福医药	67,222,209.48	3.11
66	600068	葛洲坝	66,124,650.56	3.06
67	000338	潍柴动力	64,962,392.83	3.00
68	002202	金风科技	64,818,965.17	3.00
69	600348	国阳新能	63,940,231.57	2.96
70	000060	中金岭南	63,755,836.89	2.95
71	000895	双汇发展	63,696,859.54	2.95
72	600837	海通证券	63,160,596.70	2.92
73	600276	恒瑞医药	62,973,193.89	2.91
74	600703	三安光电	61,560,427.28	2.85
75	600844	丹化科技	59,525,482.35	2.75
76	002415	海康威视	58,996,258.74	2.73
77	600805	悦达投资	58,936,664.76	2.73
78	000537	广宇发展	58,813,504.92	2.72
79	002024	苏宁电器	58,473,924.09	2.70
80	000926	福星股份	57,735,543.92	2.67
81	601699	潞安环能	54,273,938.39	2.51
82	000400	许继电气	53,802,121.14	2.49

83	600628	新世界	53,709,358.70	2.48
84	000061	农产品	53,214,465.24	2.46
85	600707	彩虹股份	52,939,770.17	2.45
86	600750	江中药业	52,753,753.62	2.44
87	600741	华域汽车	52,426,763.11	2.42
88	000679	大连友谊	52,163,282.83	2.41
89	601988	中国银行	51,960,163.69	2.40
90	600315	上海家化	51,502,016.64	2.38
91	002017	东信和平	51,201,319.02	2.37
92	600216	浙江医药	51,190,780.53	2.37
93	601111	中国国航	50,332,997.27	2.33
94	000014	沙河股份	49,959,530.16	2.31
95	601888	中国国旅	49,923,803.67	2.31
96	002304	洋河股份	49,763,880.63	2.30
97	002430	杭氧股份	49,196,046.06	2.27
98	600521	华海药业	48,679,634.63	2.25
99	000758	中色股份	46,799,738.53	2.16
100	002146	荣盛发展	46,593,172.52	2.15
101	000540	中天城投	46,114,057.82	2.13
102	601998	中信银行	45,247,359.48	2.09
103	601328	交通银行	45,231,593.85	2.09
104	000728	国元证券	44,822,779.17	2.07
105	300002	神州泰岳	44,625,342.31	2.06
106	600122	宏图高科	43,230,017.61	2.00

注：买入金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600000	浦发银行	458,183,813.47	21.19
2	600036	招商银行	360,955,413.04	16.69
3	600425	青松建化	241,154,655.21	11.15
4	000858	五粮液	221,365,697.10	10.24
5	002092	中泰化学	193,534,374.51	8.95
6	600015	华夏银行	181,984,913.30	8.42
7	600048	保利地产	169,317,867.73	7.83
8	600100	同方股份	163,935,890.95	7.58
9	000823	超声电子	161,193,845.55	7.45
10	600016	民生银行	155,310,385.75	7.18
11	601288	农业银行	150,210,000.00	6.95
12	002142	宁波银行	149,174,934.51	6.90

13	600197	伊力特	148,345,671.10	6.86
14	600104	上海汽车	144,743,727.39	6.69
15	600111	包钢稀土	142,494,145.83	6.59
16	002106	莱宝高科	135,691,553.63	6.27
17	000021	长城开发	133,559,234.34	6.18
18	000960	锡业股份	133,064,940.64	6.15
19	000792	盐湖钾肥	125,941,765.76	5.82
20	601398	工商银行	125,127,424.16	5.79
21	000826	桑德环境	122,880,462.75	5.68
22	600030	中信证券	119,462,895.86	5.52
23	600778	友好集团	113,559,483.33	5.25
24	600256	广汇股份	111,432,393.52	5.15
25	000568	泸州老窖	111,329,344.29	5.15
26	600123	兰花科创	108,599,987.83	5.02
27	600376	首开股份	106,620,754.48	4.93
28	600859	王府井	99,202,355.62	4.59
29	600581	八一钢铁	98,879,029.52	4.57
30	600432	吉恩镍业	97,145,303.74	4.49
31	600019	宝钢股份	97,008,019.05	4.49
32	600479	千金药业	95,511,892.05	4.42
33	600498	烽火通信	93,869,993.03	4.34
34	601601	中国太保	92,673,757.79	4.29
35	600519	贵州茅台	91,930,915.87	4.25
36	600584	长电科技	90,530,579.24	4.19
37	600122	宏图高科	85,961,968.66	3.97
38	600267	海正药业	85,922,293.39	3.97
39	600750	江中药业	83,397,978.50	3.86
40	600707	彩虹股份	82,624,060.83	3.82
41	002064	华峰氨纶	80,115,199.11	3.70
42	000009	中国宝安	79,857,876.97	3.69
43	600325	华发股份	79,854,748.32	3.69
44	300080	新大新材	78,853,808.21	3.65
45	600348	国阳新能	77,409,700.22	3.58
46	002007	华兰生物	77,388,554.90	3.58
47	601958	金钼股份	75,198,340.10	3.48
48	000758	中色股份	74,591,012.95	3.45
49	600805	悦达投资	74,461,925.14	3.44
50	600315	上海家化	71,214,484.89	3.29
51	600068	葛洲坝	71,068,336.06	3.29
52	600844	丹化科技	70,182,258.16	3.25
53	000338	潍柴动力	69,658,106.64	3.22

54	601318	中国平安	68,996,147.57	3.19
55	000877	天山股份	67,679,960.35	3.13
56	600166	福田汽车	67,327,108.58	3.11
57	000559	万向钱潮	67,310,994.15	3.11
58	600741	华域汽车	67,264,088.48	3.11
59	002202	金风科技	67,023,868.89	3.10
60	600837	海通证券	66,881,286.60	3.09
61	600585	海螺水泥	66,294,316.29	3.07
62	601628	中国人寿	66,208,896.17	3.06
63	000423	东阿阿胶	66,172,812.87	3.06
64	002065	东华软件	65,716,763.25	3.04
65	600518	康美药业	64,677,480.73	2.99
66	000973	佛塑股份	61,754,725.94	2.86
67	600075	新疆天业	61,388,537.99	2.84
68	600703	三安光电	59,929,973.17	2.77
69	002024	苏宁电器	59,620,136.90	2.76
70	002194	武汉凡谷	59,155,865.51	2.74
71	000926	福星股份	58,043,711.56	2.68
72	002017	东信和平	57,855,082.09	2.68
73	601699	潞安环能	57,314,319.95	2.65
74	000848	承德露露	55,772,120.47	2.58
75	600160	巨化股份	55,349,959.37	2.56
76	000537	广宇发展	55,173,844.79	2.55
77	000581	威孚高科	54,890,366.29	2.54
78	600582	天地科技	54,521,450.33	2.52
79	000729	燕京啤酒	53,705,364.13	2.48
80	600468	百利电气	53,027,884.49	2.45
81	601888	中国国旅	51,473,337.08	2.38
82	000800	一汽轿车	51,212,751.33	2.37
83	000538	云南白药	51,140,497.25	2.36
84	002430	杭氧股份	50,934,879.57	2.36
85	002415	海康威视	50,914,644.55	2.35
86	601988	中国银行	50,404,375.50	2.33
87	600467	好当家	49,658,786.35	2.30
88	000061	农产品	49,587,127.28	2.29
89	600201	金宇集团	49,322,030.28	2.28
90	601919	中国远洋	49,305,698.68	2.28
91	000400	许继电气	49,084,113.19	2.27
92	000540	中天城投	48,826,179.97	2.26
93	000679	大连友谊	48,638,968.74	2.25
94	300070	碧水源	48,590,102.89	2.25

95	600570	恒生电子	48,351,537.32	2.24
96	600522	中天科技	48,011,165.76	2.22
97	000968	煤气化	47,267,240.32	2.19
98	000014	沙河股份	46,897,972.72	2.17
99	601111	中国国航	46,776,765.52	2.16
100	002146	荣盛发展	46,609,948.21	2.16
101	600216	浙江医药	46,601,572.06	2.15
102	600521	华海药业	46,083,346.91	2.13
103	601998	中信银行	45,590,297.90	2.11
104	600303	曙光股份	44,664,758.75	2.07
105	601328	交通银行	44,537,931.62	2.06
106	600628	新世界	44,303,830.69	2.05
107	600028	中国石化	43,681,006.05	2.02
108	002051	中工国际	43,191,014.34	2.00

注：卖出金额按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	13,623,741,883.69
卖出股票收入（成交）总额	13,366,431,791.25

注：买入股票成本和卖出股票收入按成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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中，没有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。

8.9.2 本基金本报告期末未持有股票投资，没有超过基金合同规定备选库之外的股票。

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	2,198,444.65

2	应收证券清算款	105,296,303.97
3	应收股利	-
4	应收利息	64,108.25
5	应收申购款	346,866.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	107,905,723.55

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的情况。

8.9.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因,投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
15,677	153,700.80	1,940,485,441.91	80.53%	469,081,985.45	19.47%

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

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	3,914,891.59	0.16%

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2009年8月26日)基金份额总额	2,356,333,486.41
本报告期期初基金份额总额	2,006,237,023.69
本报告期基金总申购份额	2,379,438,754.00

减:本报告期基金总赎回份额	1,976,108,350.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,409,567,427.36

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

1、基金管理人的重大人事变动:

经信诚基金管理有限公司第二届董事会第十次会议审议通过,聘任黄小坚先生担任公司副总经理。

本基金管理人已于 2010 年 10 月 29 日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》及公司网站上刊登了《信诚基金管理有限公司关于副总经理任职的公告》。

上述变更事项已按规定向中国证监会和上海证监局报告。

2、本基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金报告年度应支付给毕马威华振会计师事务所的报酬为人民币 171,000 元。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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

报告期内管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
安信证券	2	4,225,242,662.01	15.66%	3,439,499.19	15.27%	-
国泰君安	1	3,998,749,447.01	14.82%	3,398,924.92	15.09%	-

申银万国	1	3,961,408,039.18	14.68%	3,367,186.62	14.94%	-
中金国际	1	2,902,193,832.20	10.76%	2,466,858.05	10.95%	-
联合证券	1	2,838,373,274.52	10.52%	2,306,199.40	10.24%	-
国信证券	1	1,884,572,348.54	6.98%	1,531,228.92	6.80%	-
招商证券	1	1,726,854,311.84	6.40%	1,467,817.54	6.51%	-
国金证券	1	1,390,064,238.26	5.15%	1,129,436.25	5.01%	本年新增
中投证券	2	945,339,629.15	3.50%	803,534.29	3.57%	本年新增 一个交易 单元
海通证券	1	924,417,018.90	3.43%	785,751.83	3.49%	本年新增
长江证券	1	914,301,666.82	3.39%	777,152.63	3.45%	本年新增
英大证券	1	644,363,655.21	2.39%	547,703.12	2.43%	本年新增
高华证券	1	626,989,842.96	2.32%	509,433.95	2.26%	-
广发证券	1	-	-	-	-	本年新增
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	本年新增 一个交易 单元
中银国际	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	本年新增
银河证券	1	-	-	-	-	本年新增

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本基金托管人中国建设银行股份有限公司的重大事项披露如下：

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告，每10股派发现金股息人民币2.02元(含税)。

2010年9月15日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

信诚基金管理有限公司
2011年3月30日