

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书

华泰柏瑞基金管理有限公司 二〇一一年三月二十三日

一、重要声明与提示

上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）上市交易公告书依据《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称“基金法”）、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号（上市交易公告书的内容与格式）》和《上海证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制，华泰柏瑞基金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”或“本公司”）的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本基金托管人中国银行股份有限公司保证本报告书中基金财务会计资料内容的真实性、准确性和完整性，承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和上海证券交易所对 本基金上市交易及有关事项的意见，均不表明对本基金的任何保证。凡本上市交 易公告书未涉及的有关内容，请投资者详细查阅2010年12月17日刊登在《中国证券报》及华泰柏瑞基金管理有限公司网站（www.huatai-pb.com）上的《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》（以下简称“招募说明书”）。

二、基金概览

- 基金二级市场交易简称：中小ETF。
- 二级市场交易代码：510220。
- 基金申购、赎回简称：中小申赎。
- 申购、赎回代码：510221。
- 2011年3月21日基金份额总额：95,229,161份。
- 2011年3月21日基金份额净值：3.625元。
- 本次上市交易份额：95,229,161份。
- 上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 上市交易日期：2011年3月28日。
- 基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司。
- 基金托管人：中国银行股份有限公司。
- 上市销售人：西南证券股份有限公司。
- 申购赎回代办券商（以下简称“二级交易商”）：长江证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司和中航证券股份有限公司。

三、基金的募集与上市交易

- （一）本基金上市前基金募集情况
- 基金募集申请的核准机构和核准文号：中国证监会证监许可〔2010〕1535号文。
 - 基金运作方式：交易型开放式。
 - 基金合同期限：不定期。
 - 发售日期：本基金自2010年12月20日起至2011年1月18日通过销售机构公开发售。其中，网下现金发售期间为2010年12月20日至2011年1月18日，网上现金发售日期为2011年1月14日至2011年1月18日，网下股票认购的发售期间为2011年1月14日至2011年1月18日。
 - 发售价格：1.00元人民币。
 - 发售期限：网下现金发售22个工作日，网上现金发售3个工作日，网下股票认购3个工作日。
 - 发售方式：投资人可选择网上现金认购、网下现金认购和网下股票认购三种方式。
 - 发售机构
 - 直销机构
 - 网下现金发售直销机构：华泰柏瑞基金管理有限公司。
 - 代销机构

本基金的网下现金发售代理机构和网下股票发售代理机构为爱建证券有限责任公司、安信证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、长江证券股份有限公司、德邦证券股份有限公司、第一创业证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东莞证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、国金证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、平安证券股份有限公司、齐鲁证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、上海证券有限责任公司、申银万国证券股份有限公司、万联证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券有限责任公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、浙商证券有限责任公司、中国国际金融有限公司、中国建银投资证券有限责任公司、中国民族证券有限责任公司、中国银河证券股份有限公司、中航证券有限公司、中信建投证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司、中银证券股份有限公司和中原证券股份有限公司等。

本基金网上现金发售通过具有基金代销业务资格及上海证券交易所会员资格的证券公司：爱建证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、北京高华证券股份有限公司、渤海证券股份有限公司、财达证券有限责任公司、财富里昂证券股份有限公司、财富证券有限责任公司、财通证券有限责任公司、长城证券股份有限公司、长江证券股份有限公司、大通证券股份有限公司、大同证券经纪有限责任公司、德邦证券有限责任公司、第一创业证券有限责任公司、东北证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、东海证券股份有限公司、东莞证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、东吴证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、广州证券有限责任公司、国都证券股份有限公司、国海证券股份有限公司、国金证券股份有限公司、国联证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、国泰君安证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、华宝证券股份有限公司、华创证券股份有限公司、华林证券股份有限公司、华龙证券股份有限公司、华融证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、华泰证券股份有限公司、华西证券股份有限公司、华鑫证券有限责任公司、江海证券有限公司、金元证券股份有限公司、联讯证券股份有限公司、民生证券股份有限公司、中国民族证券股份有限公司、南京证券有限责任公司、平安证券股份有限公司、齐鲁证券有限公司、日信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、天风证券股份有限公司、天源证券经纪有限公司、万和证券经纪有限责任公司、万联证券股份有限公司、五矿证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、西藏同信证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、厦门证券有限公司、湘财证券股份有限公司、新时代证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、银泰证券股份有限公司、英大证券有限责任公司、招商证券股份有限公司、浙商证券股份有限公司、中航证券有限公司、中国国际金融有限公司、中信证券股份有限公司、中银国际证券有限责任公司、中原证券股份有限公司和中融证券有限责任公司等。

截至2011年1月18日本基金募集工作圆满结束。经普华永道中天会计师事务所验资，本次募集应计的募集金额总额为348,418,327.00元人民币（含所募集股票市值），折合基金份额348,418,327.00份；经基金注册（登记）机构确认结转基金份额的募集期间认购资金利息共计9,120.00元人民币，折合基金份额9,120.00份。该资金已于2011年1月24日全额划入本基金在基金托管人中国银行股份有限公司开立的基金托管专户；所募集股票已于2011年1月24日由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理过户。

本次募集有效认购总户数为34,932户，按照每份基金份额初始面值人民币1.00元计算，本次募集期间有效认购份额（含所募集股票市值）和利息结转的基金份额合计348,427,447.00份，已全部计入相应基金份额持有人账户，归各基金份额持有人所有。本基金基金管理人及本公司的基金从业人员没有认购本基金。根据《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》以及《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金募集符合有关条件，本基金管理人已向中国证监会办理完毕基金备案手续，并于2011

年1月26日获书面确认，基金合同自该日起正式生效。自基金合同生效之日起，本基金管理人开始正式管理本基金。

（二）基金份额折算

根据《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金管理人确定 2011 年 3 月 11 日为本基金的基金份额折算日，折算后的基金份额净值与基金份额折算日标的指数收盘值的千分之一基本一致。2011年3月11日，上证中小盘指数收盘值为3683.60点，基金资产净值为350,787.01418元，折算前基金份额总额为348,427,447.00份，折算前基金份额净值为1.007元。

根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.27331199，折算后基金份额总额为95,229,161.00份，折算后基金份额净值为3.684元。

本基金管理人已根据上述折算比例，对各基金份额持有人认购的基金份额进行了折算，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2011年3月14日进行了变更登记。折算后的基金份额采取四舍五入的方法计算保留到整数位，投资者可以自2011年3月15日起在其上海证券账户指定的销售机构查询折算后其持有的基金份额。

本基金管理人和基金托管人已根据折算后的基金份额总额进行了相应的会计处理，并互相核对。

（四）基金上市交易

- 基金上市交易核准机构和核准文号：上海证券交易所 上证债字〔2011〕55号。
- 上市交易日期：2011年3月28日。
- 上市交易的证券交易所：上海证券交易所。
- 基金二级市场交易简称：中小ETF。
- 二级市场交易代码：510220。投资者在上海证券交易所各会员单位证券营业部均可参与本基金的二级市场交易。
- 基金申购、赎回简称：中小申赎。
- 申购、赎回代码：510221。
- 投资者应当在本基金指定的一级交易商办理本基金申购和赎回业务的营业场所或按一级交易商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。目前本基金的一级交易商包括：长江证券股份有限公司、德邦证券有限责任公司、东吴证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、华泰联合证券有限责任公司、宏源证券股份有限公司、山西证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国建银投资证券有限责任公司和中航证券股份有限公司。
- 本次上市交易份额：95,229,161.00份。
- 来上市交易份额的流通规定：本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在来上市交易的基金份额锁定的情况。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人

- （一）持有人户数
- 截至2011年3月21日，本基金份额持有人户数为4,932户，平均每户持有的基金份额为19,308份。
- （二）持有人结构
- 截至2011年3月21日，本基金份额持有人结构如下：机构投资者持有的基金份额为45,790,210份，占基金份额总额的48.08%；个人投资者持有的基金份额为49,438,951份，占基金总份额的 51.92%。
- （三）前十名基金份额持有人的情况：
- 截至2011年3月21日，前十名基金份额持有人的情况如下表。

序号	持有人名称（名称）	持有基金份额（份）	占总份额比例（%）
1	太平人寿保险有限公司	5,466,622	5.74%
2	中国人民财产保险股份有限公司-传统-普通	5,466,622	5.74%
3	东兴证券-元大-东兴1号价值基金集合资产管理计划	4,919,616	5.17%
4	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-红-万能	2,733,175	2.87%
5	华泰证券-招行-华泰紫金一号集合资产管理计划	2,733,120	2.87%
6	国金证券股份有限公司	2,186,496	2.30%
7	兴业证券股份有限公司	2,186,496	2.30%
8	中航证券有限公司	2,186,496	2.30%
9	中国银河证券股份有限公司	2,186,496	2.30%
10	国信-招行-国信证券策略收益互换（券商）	2,186,496	2.30%

五、基金主要当事人简介

- （一）基金管理人
- 名称：华泰柏瑞基金管理有限公司
 - 注册地址：上海浦东新区民生路1199弄上海证大五道口广场1号楼17层
 - 法定代表人：齐亮
 - 总经理：陈国杰
 - 成立日期：2004年11月18日
 - 批准设立机关：中国证监会监督管理委员会
 - 批准设立文号：中国证监会证监基金字〔2004〕178号
 - 工商登记注册机关：国家工商行政管理总局；3100004000404609
 - 经营范围：基金管理人业务；发起设立基金；中国证监会批准的其他业务
 - 组织形式：有限责任公司
 - 注册资本：贰亿元人民币
 - 存续期间：持续经营
 - 信息披露负责人：陈晖
 - 联系电话：400-888-0001、021 38601777
 - 股权结构：PinBridge Investments LLC 柏瑞投资有限责任公司 349%、华泰证券股份有限公司49%、苏州新区高新技术产业股份有限公司2%。
 - 内部组织结构及职能：公司设立了投资决策委员会和风险控制委员会等专业委员会。投资决策委员会负责指导基金资产的运作，确定基本的投资策略和投资组合的原则。风险控制委员会负责全面评估公司的经营过程中的各项风险，并提出防范措施。目前，公司下设23个部门，并在北京、深圳分别设立了分公司。投资部：负责根据投资决策委员会制定的原则进行基金的投资股票投资。专户投资部：负责专户的投资管理。海外投资部：负责公司QDII的投资管理。宏源证券有限责任公司 400-800-0562 宏源证券有限责任公司 400-866-1618 宏源证券有限责任公司 400-809-6096 宏源证券有限责任公司 400-888-8888 宏源证券有限责任公司 400-600-8008 宏源证券有限责任公司 400-886-6567

北京分公司、深圳分公司、第一营销中心、第二营销中心、第三营销中心：负责基金销售。机构理财部：负责机构客户的服务拓展。营销管理总部：负责对外开拓维护渠道总部，对内管理服务渠道销售人员。市场部：负责公司产品、基金产品的市场推广服务。客户服务部：负责公司的客户服务。业务发展部：负责基金产品研发等新业务拓展。基金事务部：负责基金会计核算与估值、开放式基金注册登记等业务。信息技术部：负责公司信息系统的日常运行与维护。法律监察部：负责内部法律事务咨询、处理外部法律事务，检查公司管理及基金运作符合国家法律法规规定的情况，负责定期评估公司内部风险控制体系的完整性、有效性及合规性，检查公司内部控制制度的执行情况，并提出改进意见。风险管理部：负责投资、交易环节风险提示及控制，研究公司风险管理政策与方针，协调各部门风险管理层面风险事务。人力资源部：负责公司人力资源管理、薪酬制度、人员培训及人事档案等事务。行政管理部：负责公司后勤服务、公文档案管理等。公司财务部：负责公司财务事项。

16. 人员情况：

截至2010年12月31日，公司员工人数为142人。员工受教育程度分布：大专学历人员占7%。本科学历人员占37%，硕士学历人员占53%，博士以及博士后学历人员占3%。

17. 基金管理人业务情况简介：

截止2010年12月31日，公司共管理9只开放式基金，其中5只股票型基金，分别是华泰柏瑞盛世中国股票型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长股票型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业领先股票型证券投资基金和华泰柏瑞量化先行股票型证券投资基金；1只混合型基金，华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金；1只债券型基金，华泰柏瑞瑞字塔稳本增利债券型基金；1只货币型基金，华泰柏瑞货币市场证券投资基金和1只QDII基金，华泰柏瑞亚洲领导企业股票型证券投资基金。截至2010年12月31日，公司管理的基金资产规模为人民币195.31亿元，总份额规模为215.07亿份。

18. 本基金基金经理

张娅女士：7年证券（基金）从业经验，美国俄亥俄州肯特州立大学金融工程硕士、MBA，具有多年海内外金融从业经验，曾在芝加哥期货交易所、Danzas-AEI公司、SunGard Energy和联合证券工作，2004年加入本公司，从事投资研究和金融工程工作。2006年11月开始至今担任华泰柏瑞（朋友邦华泰）上证红利ETF基金的基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞瑞指数投资部总监。

柳军先生：11年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士。2000年至2001年在上海汽车集团财务有限公司从事财务工作。2001年至2004年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004年加入本公司，历任基金事务部总监、基金经理助理。2009年6月起任华泰柏瑞（朋友邦华泰）上证红利ETF基金的基金经理。2010年10月1日起任华泰柏瑞指数投资部副总监。

- （二）基金托管人
- 名称：中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）
 - 住所及办公地址：北京市西城区复兴门内大街1号
 - 首次注册登记日期：1983年10月31日
 - 变更注册登记日期：2004年8月26日
 - 注册资本：人民币贰仟伍佰叁拾捌亿叁仟玖佰壹拾陆万贰仟零玖元
 - 存续期间：持续经营
 - 法定代表人：肖 钢
 - 基金托管业务资格批准机关：中国证监会
 - 基金托管业务批准文号：中国证监会证监基金字〔1998〕24号
 - 托管及投资者服务部总经理：董杰
 - 托管部联系人：王圣明
 - 电话：010 66594911
 - 传真：010 66594791
 2. 基金托管部人员情况
 - 截至2010年12月月末，中国银行资产托管部共有员工130多人。
 - 业务经营情况：

截止2010年12月月末，中国银行已托管长盛创新先锋混合、长盛同盛封闭、长盛同智优势混合（LOF）、大成2012 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景安封闭、工银大盘蓝筹股票、工银核心价值股票、国泰沪深300 指数、国泰金鹿保本混合、国泰金鹏蓝筹混合、国泰区位优势股票、国投瑞银稳定增利债券、海富通股票、海富通货币、海富通精选贰号混合、海富通收益增长混合、海富通中证100 指数（LOF）、华宝兴业大盘精选股票、华宝兴业动力组合股票、华宝兴业先进成长股票、华夏策略混合、华夏大盘精选混合、华夏回报二号混合、华夏回报混合、华夏行业股票（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实成长收益混合、嘉实服务增值行业混合、嘉实沪深300 指数（LOF）、嘉实货币、嘉实稳健混合、嘉实研究精选股票、嘉实增长混合、嘉实债券、嘉实主题混合、嘉实回报混合、嘉实价值优势股票、金鹰成份优选股票、金鹰行业优势股票、银河成长股票、易方达平稳混合、易方达策略成长混合、易方达策略成长二号混合、易方达积极成长混合、易方达货币、易方达稳健收益债券、易方达深证100ETF、易方达中小盘股票、易方达深证100ETF 联接、万家180 指数、万家稳健增利债券、银华优势企业混合、银华优质增长股票、银华领先策略股票、景顺长城动力平衡混合、景顺长城成长股票、景顺长城优选股票（LOF）、泰信天天收益货币、泰信优势生活股票、泰信蓝筹精选股票、泰信债券增强收益、招商先锋混合、泰达宏利精选股票、泰达宏利集利债券、泰达宏利中证财富大盘股票、华泰柏瑞盛世中国股票、华泰柏瑞积极成长混合、华泰柏瑞价值增长股票、华泰柏瑞货币、华泰柏瑞量化先行股票型、南方高增长股票（LOF）、国富潜力组合股票、国富富鑫收益债券、国富成长动力股票、宝盈核心优势混合、招商行业领先股票、东方核心动力股票、华安行业轮动股票、摩根士丹利华鑫强收益债券型、诺德中小盘股票型、民生加银稳健成长股票型、博时反周期回报股票型、易方达岁丰添利债券型、富兰克林国海中小盘股票型、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金、工银全球股票（QDII）、嘉实海外中国股票（QDII）、银华全球优选（QDII-FOF）、长盛环球景气行业大盘精选股票型（QDII）、华泰柏瑞亚洲领导企业股票型（QDII）、信诚金砖四国积极配置（QDII）等95 只证券投资基金，覆盖了股票型、债券型、混合型、货币型等多种类型的基金和理财产品，满足了不同客户多元化的投资理财需求，基金托管规模位居同业前列。

- （三）上市推荐人
- 名称：西南证券股份有限公司
- 注册地址：重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢6楼
- 办公地址：重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦A幢6楼
- 法定代表人：王珠林
- 联系人：陈诚
- 电话：023 63786464
- 传真：023 63810422
- 客服电话：400-809-6096
- 公司网址：www.swsc.com.cn

一级交易商	客户服务热线	公司客服电话
长江证券股份有限公司	95579/4008-888-999	www.95579.com
德邦证券股份有限公司	400-888-8128	www.dobon.com.cn
广发证券股份有限公司	400-888-8393	www.gf.com.cn
东方证券股份有限公司	95575	www.df.com.cn
国信证券股份有限公司	95536	www.guosen.com.cn
国海证券股份有限公司	95597	www.gh.com.cn
华泰联合证券有限责任公司	95513	www.huatai.com
宏源证券股份有限公司	400-800-0562	www.hyc.com
山西证券股份有限公司	400-866-1618	www.sxj.com.cn
西南证券股份有限公司	400-809-6096	www.swin.com.cn
中国银河证券股份有限公司	400-888-8888	www.chinamob.com
中国建银投资证券有限责任公司	400-600-8008	www.cjic.com
中航证券有限公司	400-886-6567	www.atsec.com

- （四）基金服务机构
- 名称：普华永道中天会计师事务所有限公司
- 住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号亚厦大厦1604-1608室
- 办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
- 法定代表人：杨绍信
- 电话：021 23238888
- 传真：021 23238800
- 联系人：单峰
- 经办注册会计师：薛岚、单峰

- 六、基金合同摘要
- 基金合同的内容摘要详见附件：基金合同摘要。
- 七、基金财务状况

- （一）基金募集期间费用
- 本次基金募集期间所发生的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用从基金认购费中支付，不由基金资产承担。
- （二）基金上市前重要财务事项
- 本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
- （三）基金资产负债表
- 本基金截至2011年3月21日的资产负债表如下：

资 产	本报告期末	负债和所有者权益	本报告期末
资 产：		负 债：	
银行存款	5,054,475.08	短期借款	—
结算备付金	9,773,058.30	交易性金融负债	95.46
存出保证金	—	衍生金融负债	—
交易性金融资产	329,959,067.56	卖出回购金融资产款	—
其中：股票投资	329,959,067.56	应付证券清算款	—
债券投资	—	应付短期融资券	—
资产支持证券投资	—	应付管理人报酬	101,001.14
衍生金融资产	—	应付托管费	20,200.21
基金投资	—	应付销售服务费	—
买入返售金融资产	—	应付交易费	288,950.39
应收证券清算款	876,663.85	应付税费	—
应收利息	454.01	应付利息	—
应收股利	—	应付利润	—
应收申购款	—	其他负债	70,820.57
其他资产	—	负债合计	480,972.31
		所有者权益：	
		实收基金	348,427,447.00
		未分配利润	-3,244,700.51
		所有者权益合计	345,182,746.49
资产合计：	345,663,718.80	负债与所有者权益总计：	345,663,718.80

注：1、截至2011年3月21日，基金份额净值3.625元，基金份额总额95,229,161.00份。
2、本报告自2011年1月26日起至2011年3月21日止。本基金合同于2011年1月26日生效，截至本报告期末本基金合同生效未满半年。

八、基金投资组合

截至2011年3月21日，本基金的投资组合情况如下：

（一）基金资产组合情况			
项目	金额	占基金总资产的比例（%）	占基金总资产的比例（%）
权益投资	329,959,067.56	95.46	
其中：股票	329,959,067.56	95.46	
固定收益投资	—	—	
其中：债券	—	—	
资产支持证券	—	—	
金融衍生品投资	—	—	
买入返售金融资产	—	—	
其中：买入返售的买入返售金融资产	—	—	
银行存款和结算备付金合计	14,827,873.38	4.29	
其他各项资产	877,117.86	0.25	
合计	345,663,718.80	100.00	

二、按行业分类的股票投资组合			
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	5,062,749.00	1.47
B	采掘业	17,902,016.00	5.16
C	制造业	170,378,255.88	49.36
C0	食品、饮料	17,906,299.96	5.18
C1	纺织、服装、皮毛	8,144,079.00	2.36
C2	木材、家具	921,638.00	0.27
C3	造纸、印刷	3,263,876.00	0.95
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,009,251.43	5.57
C5	电子	10,324,807.10	2.91
C6	金属、非金属	26,187,878.12	7.30
C7	机械、设备、仪器	56,956,225.18	16.50
C8	医药、生物制品	24,952,040.49	7.23
C9	其他制造业	3,812,160.00	1.10
D	电力、煤气及水生产和供应业	17,109,702.07	4.96
E	建筑业	11,280,045.72	3.27
F	交通运输、仓储业	22,905,139.80	6.64
G	信息技术业	17,515,290.75	5.07
H	批发和零售业	19,705,442.75	5.71
I	金融、保险业	55,669,381.40	16.4
J	房地产业	14,289,768.00	4.14
K	社会服务业	3,939,219.83	2.03
L	传播与文化产业	3,014,545.00	0.87
M	综合类	18,233,511.36	5.28
合计		329,959,067.56	95.59

三、按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细				
序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）
1	600585	海螺水泥	142,724	5,160,899.84
2	601089	中国重工	294,300	3,881,817.00
3	601766	中国南车	426,800	3,286,360.00
4	600887	伊利股份	86,916	3,188,948.04
5	600795	国电电力	1,011,540	3,044,735.40
6	600739	辽宁成大	97,300	2,987,110.00
7	600088	祁门股份	224,400	2,977,396.00
8	600256	广汇股份	60,310	2,933,784.40
9	601299	中国铁建	355,300	2,746,460.00
10	600900	青岛啤酒	86,060	2,441,109.80

- 四、按债券品种分类的债券投资组合
- 截止2011年3月21日，本基金未持有债券。
- 五、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
- 截止2011年3月21日，本基金未持有债券。
- 六、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有权证。自基金合同生效日至2011年3月21日，本基金未投资过任何权证。
- 七、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有权证。自基金合同生效日至2011年3月21日，本基金未投资过任何权证。
- 八、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部资产支持证券投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有资产支持证券。
- 九、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十一、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十二、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十三、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十四、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十五、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十六、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十七、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十八、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 十九、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十一、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十二、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十三、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十四、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十五、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十六、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十七、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十八、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 二十九、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十一、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十二、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十三、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十四、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十五、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十六、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的全部权证投资明细
- 截止2011年3月21日，本基金未持有可转换债券。
- 三十七、按公允价值占