## 万家公用事业行业股票型证券投资基金 2010 年年度报告摘要

基金管理人: 万家基金管理有限公司

送出日期,2011年3月30日 \$1 重要提示 基金管理人的董事会、董事保证本报告所教资料不存忠康记载、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一以上独立董事签字同意、并由董事长签处、 基金任息人之通银行股份有限公司根据本基金合同规定、广2011年3月29日复核了本报告中的转分指标、净值表现、 利润分配情况、财务会计报告,投资组合报告等均容,保证复核内容不存在虚影记载、误导性除述或者重大遗漏。 基金管理人路以或实信用,勤修定劳的规则管理报记用基金资产但不保证基金一定差别。 基金管理人路以或实信用,勤修定劳的规则管理报记用基金资产但不保证基金一定差别。 基金管理人作品,被与不供表其未来表现。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设则书及其更 新。

2.1 基金基本	情况		§2 基金简介		
基金名称			万家公用事业行业股票型证券投资基	应	
基金简称			万家公用事业行业股票 (LOF)		
基金主代码			161903		
基金运作方式			上市型契约开放式 (LOF)		
基金合同生效日			2005年7月15日		
基金管理人			万家基金管理有限公司		
基金托管人			交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总	額		1,360,345,729.93 份		
基金合同存续期		无			
基金份额上市的证券	<b> </b> 交易所		深圳证券交易所		
上市日期			2005年8月15日		
2.2 基金产品	说明				
投资目标			本基金主要运用增强型指数化投资方法,通过主要投资于国内与居民日常生活息息相关的 公用事业上市公司所发行的股票,谋求基金资产的长期稳定增值。		
投资策略			本基金采用指数优化投资方法,基于巨潮公共服务指数或份股的盈利状况,分红水平、价值 评估等方面作为研究因素,实施指数增强投资管理,寻找高质量的公用事业上市公司构造股 票投资组合,力束实现状态的当期收益和隐壁的资本增值。		
业绩比较基准			80%×巨潮公共服务指数收益率+20%×同业存款利率		
风险收益特征		本基金是一只指数增强股票型基金,主要投资于国内与居民日常生活息息相关的公用事业上市公司股票,长期平均的预期风险和收益高于混合型基金或债券型基金。			
2.3 基金管理	11人和基金托管人		•		
	项目		基金管理人	基金托管人	
名称	Trans.		金管理有限公司	交通银行股份有限公司	
	姓名	兰剑		张咏东	

ICHADADCERFOLDADA	40C/GC/GE/EJ	021-30019010		021-32109999	
	电子邮箱	lanj@wjasset.com		zhangyd@bankcor	nm.com
客户服务电话	•	4008880800		95559	
传真		021-38619888	021-62701216		
2.4 信息披露	方式				
登载基金年度报告正3	文的管理人互联网网址		http://www.wjasset.com		
基金年度报告备置地点	Ę.		基金管理人办公场所		
3.1 主要会计	数据和财务指标	§3 主要财务指标	和基金净值表现		金额单位:人民币
3.1.1 期间数据和指标		2010年	2009年		2008年
本期已实现收益		-100.907.935.14	109.	815.295.06	-240.819.163.

期本基金計劃時間 注: (a) 本期已实现收益指基金本期利息收入.投资收益.其他收入. 不含公允价值变或收益. 的标程关费用后的余额.2 期利润为本期已实现收益加上本期处允价值变或收益; (2) 所述基金址對排除不包括持有人认则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; (a) 期末可埃分配利润果用来资产价值资料未分配利润中含头配利剂中已买现部分的缺低数。

阶段	份额争值增长率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	10.39%	2.01%	8.36%	1.54%	2.03%	0.47%
过去6个月	21.12%	1.65%	17.61%	1.35%	3.51%	0.30%
过去1年	-3.57%	1.58%	-8.71%	1.36%	5.14%	0.229
过去3年	-20.38%	1.98%	-32.92%	1.86%	12.54%	0.129
过去5年	167.73%	1.81%	115.86%	1.77%	51.87%	0.04%
自基金合同生效起 至今	162.78%	1.74%	119.89%	1.70%	42.89%	0.04%

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 法。本基金成立于2005年7月15日,建仓期为大个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合法律法规和基金合同要求。报告期末各项资产配置比例符合法律法规和基金合同四级。

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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	毎 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	0.260	17,240,883.35	5,546,063.78	22,786,947.13	-		
2009年	0.000	0.00	0.00	0.00	-		
2008年	0.000	0.00	0.00	0.00	-		
合计	0.260	17.240.883.35	5,546,063.78	22,786,947.13	-		
§4 管理人报告							
41 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

E监基金字 [2002] [44 号文批准设立。公司现股东为齐鲁证券有限公司、上海久事省国有资产投资控股有限公司,住所地及办公地点均为上海市浦东新区福山路 450号,注册资本证明在达到中山北市国由自对广发股配取自限公司,任所地及办公地点均为上海市消耗疾形区 福山縣 450号;注册资本(2元人民币、目前管理人只开放关基金,外别为万军 188 转级定并投资基金,万家 持强级运债券型证券 投资基金。万家公用事也作业股票型证券投资基金。万家该价市市场证券投资基金、万家和遗槽长混合型证券投资基金、万家 对曾要灵活医理路合型证券投资基金。万家能选股票型证券投资基金和万家稳健增利债券型证券投资基金、 41.2 基金经理(成基金经理小组)及基金经理助理局介

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
KE/D	BFC:99*	任职日期	离任日期	HESSSAME-FRR	19091
鞠英利	本基金基金经理、 万家和谐基金经理	2008年9月27日	-	11年	南开大学企业管理博士,曾任汕头证 券上海总部研究中心投资主管,港海 证券上商资产管理服投资主管,华海 证券省限责任公司投资经理、上海鑫 地投资管理有限公司证券投资部总 经股资管理有限公司证券投资部总 经现实。
32 1 (CED D)	3 BH L 1 12 rigr / 12 L 1 3 BH	#松口 せない 生み地			

注:1. 任职日期以及實任日期的以基金公告为准。
2. 证券从业含义遵从行业协会 低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室下遭獲守信情况的谈判
本基金管理人所被责金合同、临券收货基金送、 低券投资基金运作管理办法 筹法律、法规和监管部门的相关规定。依照诚实信用、勤勉尽责、安全就交的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益。没有损罪基金持有人利益的行为。
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
本公司严格遵循公平交易的原则,在投资管理活动中公平对待不同基金品种,无直接或间接在不同投资组合之间进行和监验验的方分,报告期内无异常交易。
公司根据中国证监会 征券投资基金管理公司公平交易制度指导意见的要求,制订和完善了公平交易内部控制制度,通过制度、成准和技术手段保证公平交易原则的实现。同时,公司通过对投资交易行为的监控、分析评估朱加强对公平交易

过餐箱课报的监督。 4.3. 本校發租合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 在本港店期, 我公司没有和本基金投资风格相似的其他投资组合品种。 4.3. 异常之易行为的专项规则 报告期内无异常交易

报告期外无异常交易 4.4 管理人对报告期内法金的投资策略和业绩表现的说明 4.4.1 报告期内法金投资策略和运作分析 2010 年到国 18世 5 成为全球聚٠٠ 版表大的市场之一,上海综合指数自开盘的 3289 点下跌至 2808 点,跌幅达 14.31%。 2010 年到国 180 带场成为全球聚٠٠ 版表生的市场之一,为国经济总量首次超过日本成为全球第二大经济体、在国际上产生较大反响。然而,我国证券市场表现似乎与经济的强劲增长不一致,主要原因在于,宏观经济增长恢复得到确认之后的流动 地位现状。

进行长期战略性投资。 2010年国内国际环境错综复杂,是波动较大,分岐较大的一年。本基金投资过程中,在基金合同规定的范围内积极投资,努力把匯市场仍运行旅路,以持有人利益最大化的原则指导下,为基金址缴的增长而持续努力。

收益。
46 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明
1.参与估值浓程各方及人员 载小组 約职责分工、专业胜任能力和相关工作经历
基金管理人
公司或立丁估值委员会、定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时
修订估值方法。估值委员会主要由分管基金估值业务的公司领导。督督长、基金估值业务的负责人、监察稽核部负责人、研
家发展能而发,等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法
规,并具有丰富的实践经验。

北管银行

托管银行 托管银行根据法律法规要求履行估值及净值计算等复核和核查的责任。

托管银行眼贴注触是来聚了履行估值及净值计算等复核和核查的责任。 会计师事务所对基金管理公司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。 2.基金经理参与或决定估值的程度 基金经理参与成决定估值的程度 3.参与估值旅程各方之间存在的任何重大利益冲突 参与估值旅程各方之间存在的任何重大利益冲突 参与估值旅程各方之间存在的任何重大利益冲突 4.已签约的任何定价服务的性质与程度 本基金管理人与中央阻衡定估算有限担任公司签署了 伊佛收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。 4.7 管理人对报告期内基金利润分配信息的说明 根据基金信用规定:基金收益条件后分份额净值不能低于基金価值,基金当期收益应先弥补前期亏损后,才可进行 当期收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多6次,基金每次收益分配比例最低不 低于已来则收益分配。在符合有关基金分红条件的前提下,基金收益每年至少分配一次,最多6次,基金每次收益分配比例最低不

5時代上央東映在的 60%。 60世 - 14 日 - 14 大議会以 2009 年 12 月 31 日 5 基準日 进行了利润分配 - 50 10 任 5 日 10 份基金份額減 0.26 元。 2010 年 4 基金 銀末可分配收益方负。

\$5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 2010 年度,基金托管人立下空外 出土工 5.1 报告期内本基金托管人連與守信情况声明
2010年度,基金托管人在万家公用事业行业股票型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
有关油祛炭 基金合同,托管协议,是职尽并贴履行,托管人应定的义务。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建康守信。净值计算,利润分配等情况的说明
2010年度,万寒基金管理有限公司左尔等公用事业行业股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算,基金份
额申與赎回价格的计算,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了17次收益分配,分配金额为22.786.947.13元,符合基金合同的规定。
5.3 托管人均本年度报告中财务信息等内容的真实,推确的还整发表资现。
2010年度,由万家基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关万家公用事业行业股票型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、财务会计报告用发小客。投资组合报告"零内容真实,准确、完整。
基金 2010年年度财务会计报告告发发失年期会计时事务所审计、注册会计师签字出具了安水年明 2011)审字第
60778298\_B04号标准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合文。
7.1 资产负债表

7.1 资产项债表 会计主体:万家公用事业行业股票型证券投资基金 报告截止日:2010 年 12 月 31 日

2010年	12	月	31	H
单位:人民币元		人	夏核后	于次

单位:人民币元				
资/ss	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	28,592,311.15	66,213,437.64		
结算备付金	88.897.765.87	77.186.861.51		
存出保证金	1.097.976.06	1.014.589.03		
交易性金融资产	975.035.086.58	621.807.665.58		
其中:股票投资	975,035,086.58	621,807,665.58		
基金投资	=	=		
债券投资	0.00	0.00		
资产支持证券投资	0.00	0.00		
衍生金融资产	0.00	0.00		
买人返售金融资产	0.00	0.00		
应收证券清算款	0.00	4.192.558.16		
应收利息	33-544.44	52.167.82		
应收股利	0.00	0.00		
应收申购款	462,343.96	317,879.78		
递延所得税资产	-	-		
其他资产	0.00	0.00		
资产总计	1.094.119.028.06	770.785.159.52		
负债和所有者权益	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	0.00	0.00		
交易性金融负债	0.00	0.00		
衍生金融负债	0.00	0.00		
卖出回购金融资产款	0.00	0.00		
应付证券清算款	0.00	925,459.53		
应付赎回款	527,758.70	2,737,540.14		
应付管理人报酬	1,190,762.46	849,403.74		
应付托管费	183-194.24	130.677.49		
应付销售服务费	0.00	0.00		
应付交易费用	1.592.535.95	2.134.519.46		
应交税费	0.00	0.00		
应付利息	0.00	0.00		
应付利润	0.00	0.00		
递延所得税负债	-	-		
其他负债	621.862.95	618-355.69		
负债合计	4.116.114.30	7.395.956.05		
所有者权益:		.13531930000		
实收基金	766.771.188.32	502.908.321.73		
未分配利润	323,231,725.44	260,480,881.74		
所有者权益合计	1,090,002,913.76	763,389,203.47		
负债和所有者权益总计	1,094,119,028.06	770,785,159.52		
JAHRITHOT TO GETABLISH	1,094,119,028.06	//0,/83,139.32		

注:报告截止日 2010年 12 月 31 日, 悉至以(10年 17.2 利润表 大計主條:万家公用事业行业股票型证券投资基金 \* 4年年期: 2010年 1 月 1 日至 2010年 12 月 31 日

本报告期:2010年1月1日至2	010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1月1日至2009年12月31日
一、收人	1.627.260.66	192.054.257.54
1.利息收入	1,465,368.41	810,096.96
其中:存款利息收入	1,465,368.41	810,096.96
债券利息收入	0.00	0.00
资产支持证券利息收人	0.00	0.00
买人返售金融资产收人	0.00	0.00
其他利息收入	0.00	0.00
2.投资收益 锁失以""填列)	-77.019.079.62	126.071.142.59
其中:股票投资收益	-83,020,877.38	122,965,101.09
基金投资收益	=	=
债券投资收益	0.00	0.00
资产支持证券投资收益	0.00	0.00
衍生工具收益	0.00	0.00
股利收益	6.001.797.76	3,106,041.50
3.公允价值变动收益 惯失以 ""号填列)	76,974,465.46	64.461.391.81
4.汇兑收益 惯失以""号填列)	-	=
5.其他收入 锁失以 ="号填列)	206,506.41	711,626.18
减:二、费用	25,560,730.34	17,777,570.67
1.管理人报酬	11,643,594.26	6,937,300.35
2.托管费	1,791,322.15	1.067.276.92
3.销售服务费	0.00	0.00
4.交易费用	11.677.343.14	9.334.670.40
5.利息支出	0.00	0.00
其中:卖出回购金融资产支出	0.00	0.00
6.其他费用	448,470.79	438,323.00
三、利润总额 医损总额以 ="号填列)	-23,933,469.68	174,276,686.87
减:所得税费用	-	-
四、净利润(争亏损以""号填列)	-23.933.469.68	174.276.686.87

7.3 所有者权益 偡金净值 )变动表 会计主体:万家公用事业行业股票型证券投资基金 本据生期,2010年1月1日至2010年12日31日

平版日期:2010 年 1 万 1 口主.	2010 - 12 /1 31 🖂		单位:人民币元		
項目	:	本期 2010年1月1日至2010年12月3	1 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)	502.908.321.73	260.480.881.74	763.389.203.47		
二、本期经营活动产生的基金净值变动 数 (本期利润)	=	-23.933.469.68	-23.933.469.68		
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)	263.862.866.59	109.471.260.51	373.334.127.10		
其中:1.基金申购款	416.757.404.64	176.077.008.79	592.834.413.43		
2.基金赎回款	-152.894.538.05	-66.605.748.28	-219.500.286.33		
四、本期向基金份额持有人分配利润产 生的基金净值变动 (争值减少以""号填 列)	=	-22,786,947.13	-22,786,947.13		
五、期末所有者权益(基金净值)	766,771,188.32	323,231,725.44	1,090,002,913.76		
項目	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)	303,266,323.97	-26,853,254.64	276,413,069.33		
二、本期经营活动产生的基金净值变动 数 (本期利润)	-	174,276,686.87	174,276,686.87		
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)	199,641,997.76	113,057,449.51	312,699,447.27		
其中:1.基金申购款	639,513,757.26	302,722,621.19	942,236,378.45		
2.基金赎回款	-439,871,759.50	-189,665,171.68	-629,536,931.18		
四、本期向基金份額持有人分配利润产 生的基金净值变动(净值减少以二"号填 列)	-	0.00	0.00		

7.41 法企业体情况。
7.41 法企业体情况。
7.41 法企业体情况。
7.41 法企业体情况。
7.42 会计标及特征
7.41 法企业体情况。
7.42 公主企业体情况。
7.43 公主企业体情况。
7.44 公主企业体情况。
7.45 公主企业体制度。
7.45 公主企业体制度、
7.45 公主企

金田等於此准,明欽郡、国家稅务怠局研究决定,自 2008 年 4 月 24 日起,调整证券 般票 )交易印花稅稅率,由原先的 调整为 194; 绘国务院批准,财政部、国家稅务怠局研究决定,自 2008 年 9 月 19 日起,调整由出让方按证券 般票 )交易印花稅稅率 申切花稅、受让方不再征稅、稅率不受; 根据财政部、国家稅务怠局稅稅字 2003 103 号文 筷于股权分置试点改革有关稅收政策问题的通知」的规定,股权分 這过租中因非抵過股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。 担期投资。但1945年,他可以经济

全点主法。正式175%。 根据财政部、国家税务总局财税字 2004 78 号文 关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自 2004 年 1 月 1 日起, 对证券投资基金 封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金 管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免证营业税 和企业所得税: 根據財務部。国家稅多总局财稅字 2005 103 号文 铁于股权分置试点改革有关税收取策问题的通知的规定。股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东设付的股份,如金率收入 暂免取洗通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份,如金率收入 暂免取洗通股股东运输物企业所得税。根据财政部、国家稅务总局财稅 2008 11 号文 铁于企业所得税结于优惠政策的通知 的规定。对证券投资基金从证券市场中取得约收入,包括立实股票。债券的差价收入,股权的股息、红利收入。债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

6月13日記,近岸沙投送金人上市公司/布置取得的级 危工师内等人 [75]19中级发展中行选出,通常多人上市公司/布置取得的级 危工师内等人 [75]19日以 通安 2016 1 編成 5016 1 编文 50

关联方名称	与本基金的关系
家基金管理有限公司	基金管理人,发起人,基金销售机构
通银行股份有限公司	基金托管人,基金代销机构
鲁证券有限公司	基金管理人股东,基金代销机构
海久事公司	基金管理人股东
圳市中航投资管理有限公司	基金管理人股东
东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人股东
国证券登记结算有限公司	基金注册与登记过户人
注:下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款	矿立。

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易 7.4.7.1.1 股票交易

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

應證券 3,009,383,560,70 38,959

本期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。
74.71.3 债券交易。
74.71.3 债券交易。
74.71.4 债券回购交易。
74.71.4 债券回购交易。
74.71.4 债券回购交易。
74.71.5 应支付关联方的佣金

本期 10年1月1日至2010年12月31日

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

中,女信翰眼鸠综产律师费 1.716.45493 1.332,907.08 注:基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.30%的年费率计提。计算方法如下; H=Exl 1.30%-当年天数 H 为每日应文付的基金管理费 医 为前一日的基金资产净值 基金管理费每日计提,该日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送管理费划桁指令,基金托管

核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。 74.7.2.2 基金托管费

上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日 本期 2010年1月1日至2010年12月31日 

抹特的那些的搬店基金的搬店。 注:基金管理人于2010年度投2009年度申购及赎回本基金价網时所适用的费率与本基金公告的费率一致 7-47-42 报告期末除基金管理人之外的其他关联方形资本基金价值况 本基金除基金管理人之外的其他关联方于2010年年末及2009年年末均未投资本基金。 7-47-5 由关联方接管的银行存款金额及当期产生的利息收入 本期 2010年1月1日至2010年12月31日

| 2009年1月1日第2009年1月3日日 | 第本条額 | 当新利息収入 | 第本条額 | 12.892,311.15 | 28.77.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.87.2724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29.8724 | 29

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

	N(区区页1511至万大的区积12页组口		金额单位:人民币:
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	0.00	0.00
В	采掘业	0.00	0.00
C	制造业	87.909.200.00	8.07
CO	食品、饮料	0.00	0.00
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00
C2	木材、家具	0.00	0.00
C3	造纸、印刷	0.00	0.00
C4	石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00
C5	电子	0.00	0.00
C6	金属、非金属	0.00	0.00
C7	机械、设备、仪表	87,909,200.00	8.07
C8	医药、生物制品	0.00	0.00
C99	其他制造业	0.00	0.00
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00
E	建筑业	0.00	0.00
F	交通运输、仓储业	0.00	0.00
G	信息技术业	0.00	0.00
Н	批发和零售贸易	0.00	0.00
I	金融、保险业	0.00	0.00
J	房地产业	0.00	0.00
K	社会服务业	0.00	0.00
L	传播与文化产业	0.00	0.00
M	综合类	0.00	0.00
	合计	87,909,200.00	8.07

序号	股票代码	股票名称	数量 優)	公允价值	占基金资产净值比例 66)
1	600123	兰花科创	1,200,000	56,496,000.00	5.18
2	600188	兖州煤业	1.699.962	48.261.921.18	4.43
3	600971	恒源煤电	900.000	46.764.000.00	4.29
4	600221	海南航空	5.000.000	44.850.000.00	4.11
5	600508	上海能源	1,499,901	42.432.199.29	3.89
6	600395	盘江股份	1,100,000	35,805,000.00	3.28
7	600125	铁龙物流	2,400,000	34,608,000.00	3.18
8	000983	西山煤电	1,199,973	32,027,279.37	2.94
9	000571	新大洲 A	4.999.976	31,699,847.84	2.91
10	600880	博瑞传播	1.499.889	29.367.826.62	2.69
8.3.2	2 积极投资按公	公允价值占基金资产	争值比例大小排序的前五名	(股票投资明细	金额单位:人民币
序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比例 %)

					並似于世:八尺
序号	股票代码	股票名称	数量 段)	公允价值	占基金资产净值比( %)
1	600468	百利电气	2.020.000	72.639.200.00	
2	600843	上工申贝	1,000,000	15,270,000.00	
8.4	报告期内股票投	资组合的重大变动	前股票明细,应阅读登载于 值2%或前20名的股票明	基金管理人网站的年度报告I 细	E文 金額单位:人民

5	600050	中国联通	109.983.051.90	14.41
6	601678	滨化股份	99,698,842.29	13.06
7	600029	南方航空	97.897.275.04	12.82
8	600188	疟州煤业	96,433,960.86	12.63
9	000933	神火股份	89 - 129 - 431.55	11.68
10	600508	上海能源	82,346,235.99	10.79
11	600843	上工申贝	74.464.974.85	9.75
12	600583	海油工程	74,354,681.34	9.74
13	000571	新大洲 A	71.765.078.00	9.40
14	601666	平煤股份	68,842,738.85	9.02
15	000917	电广传媒	65.339.071.77	8.56
16	601111	中国国航	64,228,976.39	8.41
17	600880	博瑞传播	61-483-314.90	8.05
18	600804	鹏博士	61,406,944.77	8.04
19	600509	天富热电	61-235-455.49	8.02
20	600900	长江电力	60,066,471.89	7.87
21	601006	大泰铁路	57.195.994.55	7.49
22	600348	国阳新能	57,137,705.71	7.48
23	000839	中信国安	54-046-217.47	7.08
24	601699	器安环能 歌华有线	53,332,854.77	6.99
25	600037	歌平有权 郑州健由	52.575.776.87 49.713.502.27	6.89
	600121 000937	郑州煤电 金牛能源	49,713,502.27 49,595,062.62	6.51
27 28	000937 002013	並干能源 中航精机	49.595.062.62 49.050.054.96	6.50
28	002013 600960	中航精机 滨州活塞	49,050,054.96 48.880.625.81	6.43
30	600960	广电网络	48.880.625.81 48,440,432.40	6.40
		中煤能源		
31	601898 600874	包址环保	44.597.141.96 44.354.959.17	5.84 5.81
33	600874	新华侍樓	43,407,274,16	5.81
34	601001	大同煤业	43,407,274.16	5.48
35	600270	外运发展	41,440.680.15	5.43
36	600035	楚天高速	41,059,291.96	5.38
37	300080	新大新材	40, 163, 413 05	5.26
38	600137	浪莎股份	39,967,222.58	5.24
39	600236	桂冠电力	39,296,007.52	5.15
40	600269	韓粤高速	38,953,935,33	5.10
41	000159	国际实业	38,831,568.61	5.09
42	600193	创兴置业	38.613.892.62	5.06
43	000983	西山煤电	37,406,314.29	4.90
44	600428	中远航运	37,163,689,35	4.87
45	002128	露天煤业	35,811,648.72	4.69
46	600971	恒源煤电	35.490.084.57	4.65
47	600323	南海发展	34,764,629.84	4.55
48	000548	湖南投资	33.918.844.31	4.44
49	600395	盘江股份	33,076,352.13	4.33
50	600350	山东基建	32.956.919.41	4.32
51	600649	城投控股	32,785,923.93	4.29
52	600106	重庆路桥	31.893.671.44	4.18
53	600863	内蒙华电	31,565,609.40	4.13
54	000968	煤气化	31.009.017.77	4.06
55	600028	中国石化	30,645,711.25	4.01
56	600997	开滤股份	29.450.360.80	3.86
57	601808	中海油服	28,631,623.69	3.75
58	600644	乐山电力	27.616.239.34	3.62
59	000780	平庄能源	27,221,341.22	3.57
60	600176	中国玻纤	26.534.618.09	3.48
61	002226	江南化工	26,331,528.84	3.45
62	600026	中海发展	25.814.401.47	3.38
63	601107	四川成渝	23,418,171.88	3.07
64	002298	鑫龙电器	22.149.487.71	2.90
65	600004	白云机场	21,711,838.57	2.84
66	000793	华闻传媒	21-163-668.72	2.77
67	000905	厦门港务	20,695,036.39	2.71
68	600008	首创股份	20-632-420.71	2.70
69	600087	长航油运	20,214,740.85	2.65
70	000301	东方市场	19.853.769.07	2.60
71	600033	福建高速	19,775,288.17	2.59

注:本项买人金额均按买人成交金额 戗交单价乘以成交数量 填列,不考虑相关交易费用

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	600256	广汇股份	142,537,111.20	18.
2	600050	中国联通	122 - 802 - 159.68	16.
3	000933	神火股份	110.254.093.56	14
4	600029	南方航空	101,716,862.30	13
5	600221	海南航空	101,450,374.82	13
6	600123	兰花科创	88.682.056.37	П
7	600125	铁龙物流	87,913,063.60	11
8	601678	滨化股份	85,553,299.38	11
9	601111	中国国航	69.572.436.55	9
10	600188	兖州煤业	68,786,171.15	9
11	600509	天富热电	66,172,638.39	8
12	600583	海油工程	62,823,326.71	8
13	000917	电广传媒	62,262,564.91	8
14	600804	脱坡十	59,034,013.43	7
15	600843	上工申贝	58,546,746.14	7
16	601006	大秦铁路	57,434,383.44	7
17	600900	长江电力	56,549,803.14	7
18	000839	中信国安	53,369,926,67	
19	601666	平煤股份	51,585,941.00	6
20	002013	中航精机	49.421.618.76	6
_				
21	600960	滨州活塞	49.096.057.89	6
22	600348	国阳新能	48.532.430.90	6
23	600508	上海能源	48,484,401.51	6
24	002226	江南化工	47,108,213.56	6
25	000159	国际实业	44,921,596.00	
26	600880	博瑞传播	43.841.045.96	5
27	601699	潞安环能	42,885,995.22	5
28	600106	重庆路桥	42,144,947.08	5
29	600037	歌华有线	41,765,681.06	5
30	300080	新大新材	40,999,279.54	5
31	600323	南海发展	40,615,899.48	5
32	600028	中国石化	40,331,328.59	5
33	600523	贵航股份	39,271,760.40	5
34	600137	浪莎股份	39.168.472.73	5
35	600121	郑州煤电	38,867,685.16	5
36	600193	创兴置业	38.838.669.97	5
37	600035	楚天高速	38,554,170.75	5
38	600831	广电网络	38.505.788.53	5
39	600468	百利电气	38-151-377.80	5
40	600236	桂冠电力	37,988,370.72	4
41	600428	中远航运	37,146,217,27	4
42	600269	赣粤高速	37.034.737.02	4
43	600209	创业环保	36,688,069.27	4
44	000937	金牛能源	35,372,804.36	4
45	600649	域投控股	34,272,419.24	4
_				
46	600270	外运发展	33,989,944.76	4
47	601001	大同煤业	33,360,656.05	4
48	000571	新大洲 A	32,864,626.65	4
49	601857	中国石油	32,000,035.50	4
50	601898	中煤能源	31,237,682.26	4
51	600350	山东基建	30,722,807.88	4
52	000968	煤气化	30,262,948.82	3
53	000983	西山煤电	26,756,705.26	3
54	600176	中国玻纤	24,760,862.03	3
55	000548	湖南投资	24.565.687.84	3
56	600009	上海机场	24,409,792.13	3
57	601808	中海油服	23,246,217.38	3
58	600087	长航油运	21,443,034.80	2
59	600644	乐山电力	21,319,914.00	2
60	600026	中海发展	21,080,849.40	2
61	000905	厦门港务	20,946,035.58	2
62	000793	华闻传媒	20,190,903.96	2
63	600717	天津港	20,085,778.23	2
64	002298	鑫龙电器	19,823,564.85	2
65	600004	白云机场	19,682,767.46	2
66	002128	露天煤业	19,534,430.10	2
57	600395	盘江股份	19,416,489.73	2
68	600033	福建高速	19,402,321.93	2
_				
69	000546	光华控股	18.618.748.72	2
70	000301	东方市场	18,515,284.60	2
71	600825	新华传媒	18,331,267.42	2
72	600863	内蒙华电	18,243,706.97	2
73	002302	西部建设	16,940,944.87	2
24	600012	皖通高速	16.768.879.36	2
74				
75	600997	开滦股份 首创股份	16.158.144.29 15,915,616.73	2

本基金本报告期末无前身投资 名6 期末按公斤值点基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细 本基金本报告期末无债券投资 名7 期末按公价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 本基金本报告期末未持有资产支持证券 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

8.9.2 本基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。 8.9.3 其他各项资产构成

单位:人民币:

			持有人结构				
持有人户数 (产	<ul><li>户均持有的基金份额</li></ul>	机构投资	机构投资者		个人投资者		
		持有份额	占总份额比例	持有份額		占总份额比例	
35,	852 37,943.37	804-168-262.7	59.11%	5	556 - 177 - 467.18	40.89	
9.2 期末_	上市基金前十名持有人						
序号	持有人名称		持有份额(份)		占上市	总份额比例	
1	徐杰		3,	216,398.00		7.71	
2	王明瑞		1,	504,299.00		3.60	
3	王海英			943,195.00		2.26%	
4	上海证券有限责任公司			887,300.00		2.13	
5	王毓璋			527,410.00		1.26	
6	晁广华			451,900.00		1.08	
7	胡培安			356,240.00		0.85	
8	李清亮			351,520.00		0.84	
9	谢永祥			296,451.00		0.71	
10	王育和			293.834.00		0.70	

§10 开放式基金份额变动

\$11 重大事件揭示 报告期内未召开基金份额持有人大会。 112 基金管理人、基金任管人的专门基金任管部门的重大人事变动 基金管理人。 基金管理人。 1. 然中国证券监督管理委员会证监许可 **b**010 **b**74 号文核准,钱华先生担任我公司副总经理职务,我公司于 **2010** 年 3 20 日在 低势相 投坡布 穷菜基金管理有限公司关于明任公司副总经理的公告。 2、2010 年 9 月 18 日发布 **仍**家基金管理有限公司关于公司副总经理该任的公告》,钱华先生不再担任公司副总经理职

本权占别外行自人到引,造盐行自制,还文生基人的人事实动。 13. 涉及基金管理人、基金特产、基金杆管业务的诉讼事项。 14. 基金投资解除的改变 报告期内基金投资解除的改变。 11.5 为基金进行推订的会计帧事务所情况

11.5 为基金进行审计的会计师事务所语的: 自2009年4月起,基基德前语发火排明会计师事务所为本基金提供审计服务。 本基金 2010年度需向安米定明会计师事务所交付审计费 70.000.00 元。 11.6 管理人,托管人及其高级管理人员受偿查或处罚等情况 本报告期价管理人,托管人的计管业务都 12 建相关高级管理人员未受到任何处罚。

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

		80090,000		155.ALT 2 50*140 F		
券商名称	交易单元数量	成交金額	占当期股票 成交总额的 比例	佣金	占当期佣金 总量的比例	备注
齐鲁证券	1	3,009,383,560.70	38.95%	2,557,960.32	39.35%	-
中银国际	1	1.620.806.894.65	20.98%	1.316.923.06	20.26%	-
国泰君安	1	1.309.887.833.36	16.96%	1.113.395.03	17.13%	-
江南证券	1	1.230.574.086.97	15.93%	1.045.981.37	16.09%	-
兴业证券	1	349.296.258.49	4.52%	296.900.14	4.57%	-
银河证券	2	205,639,658.87	2.66%	169,710.30	2.61%	-
	艮据中国证券监督			交易席位制度有关问:		

份额单位:份