

地址:长春市自由大路 1138 号
法定代表人:靳正冲
电话:0431 83066709
传真:0431 83066795
客户服务电话:0431 96688
网址:www.nase.cn

65 上海证券有限责任公司
注册地址:上海市九江路 111 号
法定代表人:蒋元真
电话:021 62470304
传真:021 65213164
客户服务电话:800-6200-071
网址:www.962518.cn

66 神州证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街 2 号 A 座 8 层
法定代表人:冯金明
电话:010 83561186、83561189
传真:010 83561195
客户服务电话:400-698-0898
网址:www.szsc.cn

67 招商证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区
法定代表人:宫滨
电话:0510 82831662
传真:0510 82830162
客户服务电话:400-888-5288
网址:www.glscc.com.cn

68 浙商证券股份有限公司
注册地址:浙江省杭州市杭大路 1 号黄龙世纪广场 A6-7
法定代表人:吴承根
电话:057187901053
传真:057187901913 客户服务电话:0571-967777
网址:www.stocke.com.cn

69 平安证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路大中华国际交易广场 4 楼 B 座 408016168
电话:0755-82400862
客户服务电话:4008816168
网址:www.pingan.com

70 平安证券有限责任公司
注册地址:安徽省合肥市长江中路 357 号
法定代表人:李工
电话:0551 8616666
传真:0551 8161666
客户服务电话:0551 5161671
网址:www.huazq.com

71 国海证券股份有限公司
注册地址:广西南宁市滨湖路 46 号
法定代表人:李维佳
电话:0771 8532962
传真:0771 8532963
客户服务电话:全国 400-8888-100 广西:96100
网址:www.guohai.com.cn

72 财信证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段 80 号顺天国际财信中心 26-27
电话:0731 8403343
传真:0731 8403349
客户服务电话:0731 4403343
网址:www.cfzq.com

73 东莞证券有限责任公司
注册地址:东莞市莞城区可园南路 1 号金源中心 30 楼
法定代表人:曾辉群
电话:0769 22119353
传真:0769 22119423
客户服务电话:961130
网址:www.dgzq.com.cn

74 中原证券股份有限公司
注册地址:郑州市经二路 15 号中汇国贸 11 楼
法定代表人:石保上
电话:0371 65588670
传真:0371 65588670
客户服务电话:0371 967218
网址:www.cncsw.com

75 国都证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区东直门北路赛格广场 45 层
法定代表人:王少华
电话:010 84183389
传真:010 64882980
客户服务电话:800-810-8809
网址:www.guodu.com

76 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市广东路 23 号投资广场 18 楼
法定代表人:李伟成
电话:021 50586660-8636
传真:021 50586660-8611
客户服务电话:021 83254550
网址:www.hongtong.com.cn

77 中银国际证券有限责任公司
地址:上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39F
电话:021 68404646
传真:021 58883554
客户服务电话:4006208888
网址:www.bocicmb.com

78 华泰证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路 228 号
法定代表人:顾伟
电话:0411 3013908
传真:0411 4930707
客户服务电话:0471 9061529
网址:www.htsec.com.cn

79 湘财证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路 15 号
法定代表人:曾爱龙
电话:0731 8289771
传真:0731 8289395
客户服务电话:0731 962088
网址:www.xbstock.com

80 宏源证券股份有限公司
注册地址:新疆乌鲁木齐市经济技术开发区 2 号
法定代表人:李永成
电话:0991 962662
公司网址:www.hcyuan.com

81 齐鲁证券有限公司
注册地址:山东省济南市经十路 128 号
法定代表人:李伟
电话:0531 81283735
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

82 湘财证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 41 楼
法定代表人:卢长才
电话:0755 83195911
传真:0755 83195945
客户服务电话:0755 83195911
公司网址:www.xbstock.com

83 第一创业证券股份有限公司
注册地址:广东省深圳市福田区笋岗路中民时代广场 B 座 25、26 号
法定代表人:刘学民
电话:0755-25823253
传真:0755-25831718
客户服务电话:0755-25823253
公司网址:www.firstcapital.com.cn

84 华融证券股份有限公司
注册地址:江西省南昌市北京路 291 号
法定代表人:李航
电话:0791 6768763
客户服务电话:0791 6768763
网址:www.hstock.com

85 锦桥证券有限责任公司
注册地址:上海市普陀区曹杨路 510 号南半幢 9 楼
法定代表人:王军
电话:021 68761981
客户服务电话:021 68761661-8125
网址:www.jbqz.com

76 西部证券股份有限公司
注册地址:陕西省西安市东大街 232 号陕西信託大厦 16-17 层
法定代表人:刘国斌
电话:029 87406112
客户服务电话:960708
网址:www.westsec.com.cn

77 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区新天大 7.8 层
法定代表人:黄隽林
电话:0591 87278071
传真:0591 87338160
客户服务电话:0931 96326
网址:www.gfzq.com.cn

78 华龙证券股份有限公司
注册地址:甘肃省兰州市静宁路 308 号
法定代表人:李晓安
电话:0931 4890100
传真:0931 4890118
客户服务电话:0931 4890100
网址:www.hlzq.com.cn

79 中国国际金融有限公司
注册地址:中国北京建国门内大街 1 号国贸大厦 2 座 28 层
法定代表人:李志刚
电话:010 65051156
客户服务电话:010 65051166
网址:www.cic.com.cn

80 瑞银证券有限责任公司
注册地址:北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 12 层、15 层
法定代表人:王炳
电话:010 89226788
传真:010 89226799
客户服务电话:400-887-8827
网址:www.ubssecurities.com

81 华国证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区益田路与中环路交界美兰商务大厦 C 栋 18 楼
法定代表人:陈明辉
电话:0755 82065231
传真:0755 82065639
客户服务电话:4006-008-008
网址:www.cjcs.cn

82 方正证券股份有限公司
注册地址:深圳市福田区益田路 6000 号新世界中心 29 层
法定代表人:吴灵光
电话:0755 82943755
传真:0755 82940411
客户服务电话:0755 82943750
网址:www.fzsc.com.cn

83 红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路 155 号附 1 号红塔大厦 9 楼
法定代表人:袁雨村
电话:0871 3877930
传真:0871 3878827
客户服务电话:0871 3577930
网址:www.hongtazq.com

84 日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路 18 号
法定代表人:孔志光
电话:0471-6292587
传真:0471-6292477
客户服务电话:010 88086630
网址:www.rxzq.com.cn

85 江海证券有限责任公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路 56 号
法定代表人:孙名扬

| 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 | 23,367,273.65 | 0.29 |
| B | 采掘业 | 733,731,019.25 | 9.01 |
| C | 制造业 | 5,393,308,689.33 | 66.26 |
| CD | 食品、饮料 | 528,124,039.30 | 6.49 |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | 40,201,928.10 | 0.49 |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石化、化学、塑胶、塑料 | 849,073,403.32 | 10.43 |
| C5 | 电子 | 247,722,357.93 | 3.04 |
| C6 | 金属、非金属 | 625,274,002.67 | 7.68 |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 1,637,362,561.91 | 20.12 |
| C8 | 医药、生物制品 | 1,178,566,382.53 | 14.48 |
| C99 | 其他制造业 | 286,984,017.83 | 3.53 |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 81,766,000.00 | 1.00 |
| E | 建筑业 | 135,729,250.20 | 1.67 |
| F | 交通运输、仓储业 | 13,880,462.40 | 0.17 |
| G | 信息技术业 | 370,758,224.24 | 4.56 |
| H | 批发和零售贸易 | 144,226,752.89 | 1.77 |
| I | 金融、保险业 | 471,264,265.20 | 5.79 |
| J | 房地产业 | - | - |
| K | 社会服务业 | 29,778,390.96 | 0.37 |
| L | 传播与文化业 | - | - |
| M | 综合类 | 73,300,531.70 | 0.90 |
| | 合计 | 17,471,510,850.82 | 91.80 |

3、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 股票名称 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|----------------|---------------|
| 1 | 000538 | 云南白药 | 5,226,208 | 291,622,406.40 | 3.58 |
| 2 | 600276 | 恒瑞医药 | 6,195,580 | 284,129,298.80 | 3.49 |
| 3 | 002161 | 远望谷 | 12,464,688 | 278,959,717.44 | 3.43 |
| 4 | 000425 | 徐工机械 | 6,809,385 | 238,393,870.65 | 2.93 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 1,300,000 | 233,805,000.00 | 2.87 |
| 6 | 600518 | 康美药业 | 16,000,000 | 229,760,000.00 | 2.82 |
| 7 | 760436 | 片仔癀 | 3,817,310 | 229,725,715.80 | 2.82 |
| 8 | 000983 | 西山煤电 | 8,000,000 | 212,240,000.00 | 2.61 |
| 9 | 600261 | 阳光照明 | 5,607,532 | 179,889,626.56 | 2.21 |
| 10 | 600160 | 三友股份 | 7,150,000 | 178,535,500.00 | 2.19 |

4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----|-----------|---------------|---------------|
| 1 | 国债券类 | 27,419,420.00 | 0.34 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| 3.1 | 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 | 27,419,420.00 | 0.34 |

5、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量 (股) | 公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|--------|---------|---------------|---------------|
| 1 | 010112 | 21国债02 | 161,480 | 16,160,918.40 | 0.20 |
| 2 | 010110 | 21国债09 | 112,540 | 11,258,501.60 | 0.14 |

6、报告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
截止本报告期末,本基金未持有资产支持证券。

7、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
截止本报告期末,本基金未持有权证。

8、投资组合报告附注
8.1 本报告期末,本基金前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查,在本报告编制日前一个月内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。
8.2 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。
8.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额 (元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 6,807,955.03 |
| 2 | 应收证券清算款 | 4,484,704.88 |
| 3 | 应收利息 | 2,821,500.00 |
| 4 | 应收股利 | 531,992.81 |
| 5 | 应收申购款 | 537,789.58 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 15,183,942.30 |

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
截止本报告期末,本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
截止本报告期末,本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

十二、基金的投资
本基金管理人依照相关法律法规、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金最低收益,基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。

(一) 基金净值表现
历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较
(截止 2010 年 12 月 31 日)

| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率与业绩比较基准之差② | 业绩比较基准收益率③ | 净值增长率与业绩比较基准之差④ | ①-③ | ②-④ |
|--------------------------------------|---------|-----------------|------------|-----------------|--------|--------|
| 自 2007 年 4 月 10 日至 2007 年 12 月 31 日止 | 73.04% | 1.77% | 52.40% | 1.84% | 20.64% | -0.07% |
| 自 2008 年 1 月 1 日起至 2008 年 12 月 31 日止 | -57.68% | 2.59% | -52.65% | 2.53% | -5.03% | 0.06% |
| 自 2009 年 1 月 1 日起至 2009 年 12 月 31 日止 | 84.31% | 1.66% | 76.94% | 1.74% | 7.37% | -0.08% |
| 自 2010 年 1 月 1 日起至 2010 年 12 月 31 日止 | 1.69% | 1.33% | 7.41% | 1.37% | -5.72% | -0.04% |

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览
(一) 与基金运作有关的费用
1. 基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提,计算方法如下:
 $H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日的基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

2. 基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提,计算方法如下:
 $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$
H 为每日应计提的基金托管费
E 为前一日的基金资产净值
基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 2 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

(二) 与基金销售有关的费用
1. 申购费
a 投资者选择交纳前端申购费,申购费按申购金额采用比例费率,投资人在一天之内如果有 multiple 申购,申购费按单笔分别计算,具体费率如下:

| 申购金额 (M) | 申购费率 |
|-------------|----------|
| M<100 元 | 1.50% |
| 100≤M<500 元 | 1.00% |
| M≥500 元 | 每笔 100 元 |

b 投资者选择交纳后端申购费,申购费率按持有时间递减,申购费率见下表:

| 持有期限 Y | 后端申购费率 |
|----------|--------|
| Y<1 年 | 1.80% |
| 1年≤Y<2 年 | 1.50% |