万家 180 指数证券投资基金更新招募说明书摘要

(2010 年第 1 号)

基金管理人:万家基金管理有限公司

基金托管人:中国银行股份有限公司

本基金根据 2002 年 11 月 27 日中国证券监督管理委员会《关于同意天同 180 指数证券投资基金设立的批复》(证监基金字[2002]88 号)的核准,进行募集。本基金的基金合同于 2003 年 3 月 17 日正式生效。

【重要提示】

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本基金招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

本基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为 2010 年 3 月 17 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2009 年 12 月 31 日。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:万家基金管理有限公司

住所:上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼

办公地址:上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼

法定代表人:孙国茂

总经理:李振伟

成立日期:2002 年 8 月 23 日

批准设立机关:中国证券监督管理委员会

批准设立文号:中国证监会证监基金字[2002]44 号

组织形式:有限责任公司

注册资本:1 亿元人民币

存续期间:持续经营

经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

联系人:兰剑

电话:021-38619810

传真:021-38619888

电子邮箱:lanj@wjasset.com

(二)主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

董事长孙国茂先生,中共党员,中央财经大学经济学博士,加拿大不列颠哥伦比亚大学高级访问学者,教授级研究员。曾任天同证券有限责任公司总经理助理、业务总监、齐鲁证券有限公司董事、总经理等职,现兼任齐鲁证券有限公司董事。

董事毕玉国先生,中共党员,研究生,高级会计师,曾任莱钢集团莱钢股份公司炼铁厂财务科科长,莱钢集团莱钢股份公司财务处成本科科长,莱钢集团财务部副部长,莱钢驻日照钢铁有限公司财务总监,齐鲁证券经纪有限公司计划财务部总经理。现任齐鲁证券有限公司副总经理兼财务负责人。

董事李振伟先生,中共党员,大学本科,学士学位,高级经济师。1998 年 6 月起从事证券监管工作,先后任证监会济南证管办党委办公室、上市处主任科员,证监会济南证管办上市处、机构处副处长,证监会山东证监局机构处副处长、处长等职。现任本公司董事、总经理。

董事陈晓龙先生,中共党员,研究生,硕士学位,经济师。曾任上海久事公司资产管理二部总经理助理、上海浦江镇投资发展有限公司副总经理等职,现任上海久事公司资产经营部副经理。

董事魏颖晖先生,中共党员,大学本科,学士学位,经济师,曾任职于江西长运股份有限公司、江南证券有限责任公司,现任江南信托投资股份有限公司资金部经理。

独立董事任辉先生,中共党员,大学本科学历,教授、博士生导师。历任山东菏泽商业局会计科长、山东经济学院院长等职,现任山东省人民政府参事。

独立董事易宪容先生,博士,教授级研究员,曾任湖南师范大学教师、香港大学经济金融学院合作研究研究员、台湾清华大学经济系合作研究研究员、中国社会科学院财贸所研究员、中国社会科学院金融所研究员,现任中国社会科学金融所教授、研究员。

独立董事陈增敬先生,中国民主建国会会员,博士,教授,曾任山东大学数学院讲师、教授、法国国家信息与自动化研究所博士后、加拿大西安大略大学保险系访问学者、兼职教授,现任山东大学金融研究院常务副院长兼数学院副院长。

独立董事刘福垣先生,中共党员,博士,博士生导师,教授,研究员,曾任中国社会科学院农村经济研究所、副所长、研究生院农经系主任;中国社会科学院科研局学术秘书(负责经济学科领域);国务院特区办公室研究室副主任;浙江省宁波市副市长;国家计划委员会、国家发展改革委员会经济研究所所长、宏观经济研究院副院长兼经济体制改革与管理研究所所长等职,现任中国人力资源开发研究会会长和中国区域经济研究会常务副会长。

2、基金管理人监事会成员

监事会主席柳亚男先生,1954 年生,中共党员,硕士研究生,高级经济师。历任中国人民银行烟台分行办公室副主任、中国人民银行威海分行办公室主任、中国人民银行山东省分行金管处副处长、山东证券(天同证券)有限责任公司总裁、副董事长等职。2002 年至 2007 年 12 月任本公司董事长,2007 年 12 月起任本公司监事会主席。

监事孙江先生,1965 年生,中共党员,本科学历,企业法律顾问。先后任职于华东政法学院法律系、上海上菱电器股份有限公司。现任职于上海久事公司。

监事余萌先生,1963 年生,中共党员,研究生学历、学士学位,高级经济师,曾任江西农行德兴市支行科长、江西省农行国际业务部科长、副总经理、中国长城资产管理公司处长等职,2003 年 11 月至今任江南信托投资有限公司副总裁、常务副总裁。

监事李学军先生,1960 年生,中共党员,硕士。曾任中国人民银行潍坊市分行电脑部副主任、潍坊证券公司副总经理、天同证券淄博管理总部总经理、天同证券潍坊分公司总经理、齐鲁证券经纪业务总部总经理等职。2009 年 1 月起任万家基金管理有限公司综合及人力资源管理部总监。

监事张岱云先生,1970 年生,中共党员,工商管理硕士,经济师,曾任交通银行上海分行个人金融业务部消费信贷科副科长、信用卡部市场科副科长、个人理财中心主任等职,2005 年 5 月至今任万家基金管理有限公司银行渠道部总经理。

3、基金管理人高管人员

董事长:孙国茂先生(简介请参见"基金管理人董事会成员")

总经理:李振伟先生(简介请参见"基金管理人董事会成员")

副总经理:杨峰先生,1963 年生,理学博士,中共党员。历任山东大学助教、讲师、副教授等职,2000 年 7 月至 2002 年北京大学博士后流动站、深圳证券交易所博士后工作站博士后,2002 年 3 月至 2004 年 3 月在泰达荷银基金管理有限公司任组织与战略规划部总经理、公司职工监事等职,2004 年 3 月至 2005 年 9 月在大成基金管理有限公司任规划发展部副总监(总监级)主持工作,2005 年 9 月起任万家基金管理有限公司总经理助理,2008 年 4 月起任公司副总经理。

副总经理:钱华先生,1964 年生,中共党员,硕士学位、EMBA。钱华同志自 1991 年起从事金融、证券、基金等行业工作,先后任中国人民银行总行政研究室研究员、中国华阳金融租赁有限公司国际业务部副经理、国泰证券有限公司基金部副总经理、国泰基金管理有限公司投资总监、国联安基金管理有限公司副总经理、安信证券股份有限公司拟任副总裁等职务,2008 年 6 月起加入万家基金管理公司,2010 年 3 月起任公司副总经理。

督察长:甘世雄先生,1963 年生,中共党员,工商管理硕士(MBA)。曾任山东金泰集团股份有限公司副总裁、天同证券有限责任公司业务总监、投资银行总部总经理,从事股份制改造及股票发行、购并重组工作多年。2004 年加入万家基金管理有限公司,担任公司督察长。

4、本基金基金经理

现任基金经理:

欧庆铃,男,理学博士,曾任华南理工大学应用数学系副教授、广州证券有限责任公司任研究中心常务副总经理、金鹰基金管理有限公司研究副总监等职。2007 年 5 月起加入万家基金管理有限公司,任本基金基金经理。

吴涛,男,1970 年生,硕士学位,曾任天同证券有限责任公司上海营业部副总经理、天同证券有限责任公司深圳营业部总经理、南方总部副总经理等职,2002 年起任万家基金管理有限公司监察稽核部总监,负责公司投资风险管理、监察稽核等工作。2010 年 3 月起任本基金基金经理。

历任基金经理:

杨宇,本基金成立日起至 2004 年 7 月;

朱良,2004 年 7 月至 2005 年 5 月;

肖侃宁,2005 年 5 月至 2006 年 2 月;

潘江,2006 年 2 月至 2007 年 5 月

5、投资决策委员会成员

委员会主任:李振伟

委员:杨峰、钱华、娄明、欧庆铃、张旭伟、迟巍

李振伟先生,万家基金管理有限公司总经理

杨峰先生,万家基金管理有限公司副总经理

钱华先生,万家基金管理有限公司副总经理

娄明先生,万家基金管理有限公司总经理助理

欧庆铃先生,万家基金管理有公司基金管理部总监、万家 180 基金、万家精选基金基金经理

张旭伟先生,万家基金管理有公司基金管理部副总监、万家增强收益债券基金、万家稳健增利债券基金基金经理

迟巍女士,万家基金管理有限公司研究部副总监

上述人员之间不存在近亲属关系

二、基金托管人

(一)基本情况

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

法定代表人:肖 钢

基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字【1998】24 号

托管及投资者服务部总经理:董杰

托管部门联系人:唐州徽

电话:(010)66594855

传真:(010)66594942

发展概况:

1912 年 2 月,经孙中山先生批准,中国银行正式成立。从 1912 年至 1949 年,中国银行先后行使中央银行、国际汇兑银行和外贸专业银行职能,坚持以服务大众、振兴民族金融业为己任,稳健经营,锐意进取,各项业务取得了长足发展。新中国成立后,中国银行成为国家外汇外贸专业银行,为国家对外经贸发展和国内经济建设作出了重大贡献。1994 年,中国银行改为国有独资商业银行。2003 年,中国银行开始股份制改造。2004 年 8 月,中国银行股份有限公司挂牌成立。2006 年 6 月、7 月,先后在香港联交所和上海证券交易所成功挂牌上市,成为首家在内地和香港发行上市的中国商业银行。中国银行是中国国际化和多元化程度最高的银行,在中国内地、香港、澳门及 29 个国家为客户提供全面的金融服务。主要经营商业银行业务,包括公司金融业务、个人金融业务和金融市场业务,并通过全资附属机构中银国际控股集团开展投资银行业务,通过全资子公司中银集团保险有限公司及其附属和联营公司经营保险业务,通过控股中银基金管理有限公司从事基金管理业务,通过全资子公司中银集团投资有限公司从事直接投资和投资管理业务,通过中银航空租赁私人有限公司经营飞机租赁业务。按核心资本计算,2009 年中国银行在英国《银行家》杂志"世界 1000 家大银行"排名中列第十一位。

在近百年的发展历程中,中国银行始终秉承追求卓越的精神,稳健经营的理念,客户至上的宗旨和严谨细致的作风,得到了业界和客户的广泛认可和赞誉,树立了卓越的品牌形象,中国银行被 The Banker(英国《银行家》)评为"2009 年中国年度银行",被 Euromoney(《欧洲货币》)评为"2009 年度最佳私人银行",被 Global Finance(《环球金融》)评为"2009 年度中国最佳外汇交易银行",被 Trade Finance(《贸易金融》)评选为"中国本土最佳贸易服务银行",被 The Asset(《财资》)评为"中国最佳贸易融资银行",被 Finance Asia(《金融亚洲》)评为"中国最佳私人银行、中国最佳贸易融资银行、中国最佳外汇交易银行"。面对新的历史机遇,中国银行将坚持可持续发展,向着国际一流银行的战略目标不断迈进。

(二)主要人员情况

肖钢先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司董事长、党委书记。自 2003 年 3 月起任中国银行董事长、党委书记、行长,自 1996 年 10 月起任中国人民银行行长助理,期间曾兼任中国人民银行计划资金司司长、货币政策司司长、广东省分行行长及国家外汇管理局广东省分局局长。1989 年 10 月至 1996 年 10 月,历任中国人民银行政策研究室副主任、主任、中国外汇交易中心总裁、计划资金司司长等职。肖先生出生于 1958 年 8 月,1981 年毕业于湖南财经学院,1996 年获得中国人民大学法学硕士学位。

李礼辉先生,自 2004 年 8 月起担任中国银行股份有限公司副董事长、党委副书记、行长。2002 年 9 月至 2004 年 8 月担任海南省副省长。1994 年 7 月至 2002 年 9 月担任中国工商银行副行长。1988 年至 1994 年 7 月历任中国工商银行国际业务部总经理、新加坡代表处首席代表、福建省分行副行长等职。李先生出生于 1952 年 5 月,1977 年毕业于厦门大学经济系财政金融专业,1999 年获得北京大学光华管理学院金融学专业博士研究生学历和经济学博士学位。

李早航先生,自 2004 年 8 月起任中国银行股份有限公司执行董事。2000 年 11 月加入中国银行并自此担任中国银行副行长。于 1980 年 11 月至 2000 年 11 月任职于中国建设银行,曾工作于多个岗位,先后担任分行行长、总行多个部门的总经理及副行长。1978 年毕业于南京信息工程大学。2002 年 6 月起担任中银香港控股非执行董事。

董杰先生,自 2007 年 11 月 27 日起担任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。自 2005 年 9 月起任中国银行天津市分行副行长、党委委员,1983 年 7 月至 2005 年 9 月历任中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理、党委委员等职。董先生出生于 1962 年 11 月,获得西南财经大学博士学位。

(三)证券投资基金托管情况

截止 2010 年 3 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 2020 生命周期混合、大成蓝筹稳健混合、大成优选封闭、大成景宏封闭、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(二期)、国泰金鹏蓝筹混合、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、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、金鹰成份优选股票、银河成长股票、易方达平稳增长混合、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、万家 180 指数、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、景顺长城优选股票、景顺长城货币、景顺长城鼎益股票(LOF)、泰信天天收益货币、泰信优质生活股票、招商先锋混合、泰达荷银精选股票、泰达荷银集利债券、友邦华泰盛世中国股票、友邦华泰积极成长混合、友邦华泰价值增长股票、南方高增长股票(LOF)、国富潜力组合股票、国富强化收益债券、宝盈核心优势混合、国富成长动力股票、泰信蓝筹精选股票、友邦华泰货币、国泰区位优势股票、招商行业领先股票、东方核心动力股票、金鹰行业优势股票、泰信债券增强收益、万家稳健增利债券、嘉实回报混合、海富通中证 100 指数(LOF)、易方达深证 100ETF 联接、摩根士丹利华鑫强收益债券型、工银全球股票(QDII)、嘉实海外中国股票(QDII)、银华全球优选(QDII-FOF)等 81 只证券投资基金,覆盖了股票型、债券型、混合型、货币市场型等多种类型的基金和理财品种,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、相关服务机构

(一)销售机构

1、直销机构:万家基金管理有限公司

办公地址:上海市浦东新区福山路 450 号新天国际大厦 23 楼

电话:021-38619999

客户服务电话:400-888-0800;021-68644599

传真:021-38619968

联系人:姚燕

网址:www.wjasset.com

2、代销机构:

(1)名称:中国银行股份有限公司

客户服务统一咨询电话:95566

传真:(010)66594946

网址:www.boc.cn

(2)中国工商银行股份有限公司

电话:(010)66107900

传真:(010)66107914

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(3)中国建设银行股份有限公司

客服电话:95533(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.ccb.com

(4)中国农业银行

客户服务电话:95599

中国农业银行网站:www.abchina.com、www.95599.cn

(5)中国邮政储蓄银行有限责任公司

客服电话:11185(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.cpsrb.com

(6)名称:交通银行股份有限公司

电话:021-6888891,95559

网址:www.bankcomm.com

(7)招商银行股份有限公司

公司客服电话:95555(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.cmbchina.com

(8)名称:中信银行股份有限公司

电话:010-65541405

传真:010-65541281

(9)名称:深圳发展银行股份有限公司

联系电话:(0755)82088888

传真号码:0755-82080714

客服电话:0755-82080409

公司网址:http://www.sdb.com.cn

(10)兴业银行股份有限公司

联系电话:(021)52629999

客户服务电话:95561

公司网址: www.cib.com.cn

(11)华夏银行股份有限公司

客服电话:95577(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.hxb.com.cn

公司地址:北京市东城区建国门内大街 22 号

(12)民生银行股份有限公司

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(13)光大银行股份有限公司

客户服务电话:95595

网址:www.cebbank.com

(14)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

电话:010-65183888-86080

传真:010-65182261

(15)名称:国泰君安证券股份有限公司

电话:021-62580818-213

传真:021-62569400

(16)名称:中国银河证券股份有限公司

电话:010-66568888 66568587

传真:010-66568536

(17)名称:海通证券股份有限公司

电话:021-53594566

传真:021-53858500

(18)名称:国信证券有限责任公司

电话:0755-82130833-2181

传真:0755-82133302

(19)名称:招商证券股份有限公司

电话:0755-82943511

传真:0755-82943237

(20)名称:兴业证券股份有限公司

电话:021-68419974

传真:021-68419867

(21)名称:湘财证券有限责任公司

电话:021-68634518-8631

传真:021-68865938

(22)东方证券股份有限公司

电话:021-50367888

传真:021-50366868

客户服务热线:021-962506

(23)名称:广发证券股份有限公司

电话:020-87555888-875

传真:020-87557985

客户服务热线:020-87555888 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网址:www.gf.com.cn

(24)民生证券有限责任公司

联系电话:010-85252605

传真电话:010-85252655

客服电话: 0371-67639999

公司网址: www.mszq.com

(25)联合证券有限责任公司

客服电话:400-8888-555,0755-25125666

公司网站:www.lhzq.com

(26)江海证券经纪有限责任公司

客服电话:400-666-2288

网址:www.jhzq.com.cn

(27)山西证券股份有限公司

客服热线:400-666-1618

网址:http://www.i618.com.cn/

(28)上海浦东发展银行股份有限公司

咨询电话:95528

公司网址:www.spdb.com.cn

(29)信达证券股份有限公司

客服热线: 400-800-8899

网址:www.cindasc.com

(30)广发华福证券有限责任公司

客服电话:96326(福建省外请先拨 0591)

网址:www.gfhfzq.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二) 基金注册与登记过户机构

名称: 中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

电话:0755-82084015

传真:0755-82084010

联系人:刘玉生

(三)会计师事务所

名称:安永华明会计师事务所

住所:北京市东长安街 1 号东方广场东方经贸城安永大楼 16 层(邮编:100738)

办公地址:上海市长乐路 989 号世纪商贸广场 23 楼(邮编:200031)

法定代表人:葛明

联系电话:(021)22288888

传真:(021)22280000

联系人:徐艳

经办注册会计师:徐艳,方侃

(四)律师事务所

名称:上海知亦行律师事务所

地址:上海浦东南路 500 号国家开发银行大厦 6 楼

电话:58734119、50797371

联系人:杨翊杰、华涛

四、基金的名称

万家 180 指数证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式。

六、基金的投资目标

本基金通过运用指数化投资方法,力求基金的股票组合收益率拟合上证 180 指数的增长率。伴随中国经济增长和资本市场的发展,实现利用指数化投资方法谋求基金资产长期增值的目标。

七、基金的投资方向

本基金资产的股票指数化投资部分主要投资于组成上证 180 指数的成份股票,包括:上证 180 指数包含的 180 只成份股、预期将要被选入上证 180 指数的股票、一级市场申购的新股;本基金资产的债券投资部分主要投资于国债、优质企业债、金融债以及债券回购。

八、基金的投资策略和投资组合

(一)投资策略

本基金以跟踪目标指数为原则,实现与市场同步成长为基本理念。指数化投资是一种充分考虑投资者利益的投资方法,采取拟合目标指数收益率的投资策略,分散投资于目标指数所包含的股票中,力求股票组合的收益率拟合目标指数所代表的资本市场的平均收益率。

(二)基金的指数投资组合

指数投资组合包括上证 180 成份股票、预期选入上证 180 指数的股票、一级市场申购的新股以及现金。

1、指数投资组合的构建

本基金将采用指数复制法构造投资组合,当成份股发生新增、剔除或因公司行为导致指数权重发生变化时,指数投资组合将做出相应调整。

2、指数投资组合的跟踪误差的控制

本基金选择了两个评价跟踪误差的量化指标:一是拟合偏离度,这是一个日平均跟踪误差指标;另一个是指数投资相对收益率,这是相对累计收益率指标。

拟合偏离度的控制目标定为 0.5%,指数投资相对收益率(年累计偏差)的控制目标定为 2%。如果拟合偏离度或指数投资相对收益率超过了其控制目标,风险控制小组应将分析报告和调整方案上报给投资决策委员会审议,经审议批准后的组合调整方案交基金经理执行。

九、基金的业绩比较基准

本基金成立之日起至 2005 年 12 月 31 日的业绩比较基准为:75%×上证 180 指数+25%中信国债指数

自 2006 年元月 1 日起,业绩比较基准变更为:95%×上证 180 指数+5%×银行同业存款利率

十、基金的风险收益特征

本基金追踪上证 180 指数,是一种风险适中、长期资本收益稳健的投资产品,并具有长期稳定的投资风格

十一、投资组合报告

万家基金管理人的董事会及董事保证本报告所载数据不存在虚假记载、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责任。

本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同的规定,已于 2010 年 1 月 20 日复核了本投资组合报告的内容。

本投资组合报告所载数据截至 2009 年 12 月 31 日,本报告中所列财务数据已经审计。

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	7,049,309,599.29	92.93
	其中:股票	7,049,309,599.29	92.93
2	固定收益投资	1,547,448.00	0.02
	其中:债券	1,547,448.00	0.02
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	1,233,933.34	0.02
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	472,053,896.20	6.22
6	其他资产	61,508,579.73	0.81
7	合计	7,585,653,456.56	100.00

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	42,599,109.75	0.56
B	采掘业	1,002,988,122.66	13.25
C	制造业	1,421,816,206.31	18.79
C0	食品、饮料	208,883,447.90	2.76
C1	纺织、服装、皮毛	35,276,594.44	0.47
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	93,922,372.96	1.24
C5	电子	13,592,890.72	0.18
C6	金属、非金属	544,592,014.67	7.20
C7	机械、设备、仪表	393,228,648.54	5.20
C8	医药、生物制品	114,382,794.31	1.51
C99	其他制造业	17,937,442.77	0.24
D	电力、煤气及水的生产和供应业	264,207,595.67	3.49
E	建筑业	145,856,802.75	1.93
F	交通运输、仓储业	362,649,111.18	4.79
G	信息技术业	156,163,065.08	2.06
H	批发和零售贸易	188,495,939.87	2.49
I	金融、保险业	2,993,794,162.63	39.56
J	房地产业	294,439,793.76	3.89
K	社会服务业	32,522,025.94	0.43
L	传播与文化产业	17,283,405.81	0.23
M	综合类	126,494,257.88	1.67
	合计	7,049,309,599.29	93.16

注:本报告期内,本基金的股票投资全部为指数化投资,无积极投资。

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

代码	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	600036	招商银行	21,292,883	384,336,538.15	5.08
2	601328	交通银行	32,961,124	308,186,509.40	4.07
3	601318	中国平安	5,420,900	298,637,381.00	3.95
4	600016	民生银行	36,398,649	287,913,313.59	3.80
5	601166	兴业银行	6,547,516	263,930,369.96	3.49
6	600030	中信证券	8,200,000	260,514,000.00	3.44
7	600000	浦发银行	10,381,289	225,170,158.41	2.98
8	601088	中国神华	6,155,053	214,318,945.46	2.83
9	601169	北京银行	8,219,750	158,969,965.00	2.10
10	601601	中国太保	6,026,803	154,406,692.86	2.04

注:本报告期内,本基金的股票投资全部为指数化投资,无积极投资。

4 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	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	1,547,448.00	0.02
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	-	-
8	合计	1,547,448.00	0.02

5 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	126019	09长虹债	21,140	1,547,448.00	0.02

6 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。

7 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

金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	580027	长虹 CWB1	403,774	1,233,933.34	0.02

8 投资组合报告附注

8.1 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在报告编制日前一年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 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	71,849.12
2	应收证券清算款	60,126,035.33
3	应收股利	0.00
4	应收利息	90,681.79
5	应收申购款	1,195,355.24
6	其他应收款	0.00
7	待摊费用	24,658.25
8	其他	0.00
9	合计	61,508,579.73

8.4 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。

8.5 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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2009 年 12 月 31 日。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。

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

万家 180 指数基金历史各时间段净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较列表(截至 2009 年 12 月 31 日)

阶段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
2009年	83.81%	1.91%	86.16%	1.96%	-2.35%	-0.05%
2008年	-63.32%	2.87%	-64.23%	2.91%	0.91%	-0.04%
2007年	142.57%	2.06%	141.09%	2.16%	1.48%	-0.10%
2006年	124.90%	1.30%	112.41%	1.32%	12.49%	-0.02%
2005年	-4.96%	1.00%	-2.75%	0.98%	-2.21%	0.02%
2004年	-9.25%	0.99%	-13.23%	1.00%	3.98%	-0.01%
2003年 3 月 17 日至 12 月 31 日	0.46%	0.71%	3.15%	0.81%	-2.69%	-0.10%
成立至今	218.64%	1.75%	196.79%	1.79%	21.85%	-0.04%

基金业绩比较基准增长率=95%*上证 180 指数增长率+5%*银行同业存款利率

2、万家 180 指数基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2003 年 3 月 17 日至 2009 年 12 月 31 日)

注:本基金成立于 2003 年 3 月 17 日,建仓期为三个月,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要求。

十三、基金费用概览

(一)与基金运作有关的费用种类

1、基金管理人的管理费;

2、基金托管人的托管费;

3、基金信息披露费用;

4、基金份额持有人大会费用;

5、与基金相关的会计师费和律师费;

6、证券交易费和税收;

7、基金分红手续费;

8、注册登记费;

9、按照国家有关规定可以列入的其他费用。

(二)基金运作费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.0%年费率计算,主要用于支付管理人管理本基金的运作成本和向其他服务提供人支付的费用。计算方法如下:

$H=E\times1.0\%\div$当年天数;

H 为每日应支付的基金管理费;

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付,由基金托管人复核后于次月的前两个工作日内,根据基金管理人向基金托管人发送的划付指令,从基金资产中支付给基金管理人以及服务提供人;若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计算。计算方法如下:

$H=E\times0.20\%\div$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

基金托管费每日计算,逐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基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月的前两个工作日内从基金资产中支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

3、上述(一)中 3 至 9 项费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额支付,列入当期基金费用。

(三)与基金销售有关的费用

1、本基金申购费率

申购金额 M	申购费率
M<50 万	1.5%
50 万≤M<200 万	1.2%
200 万≤M<500 万	1.0%
M≥500 万	按笔收取,1000 元/笔

2、本基金的赎回费率按实际持有期递减。具体为:

持有期限	赎回费率
D<1 年	0.5%
1 年≤D<3 年	0.25%
D≥3 年	0%

3、基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率,调整后的申购费率和赎回费率在最新的公开说明书中列示。上述费率如发生变更,基金管理人还应最迟于新的费率实施前三个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(四)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。

(五)基金管理费和基金托管费的调整

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,对基金管理人于 2009 年 4 月 30 日刊登的本基金 2009 年第 1 号更新招募说明书进行了更新,并根据本基金管理人在本基金成立后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新内容如下:

1.在重要提示部分,明确了更新招募说明书内容的截止日期及有关财务数据的截止日期。

2、在"三、基金管理人"部分,更新了公司法定代表人、联系人等信息,新增了高管人员、基金经理等信息。

3.在"四、基金托管人"部分,更新了有关基金托管人的有关内容。

4.在"五、相关服务机构"部分,增加了部分代销机构。

5. 在"七、基金份额的申购与赎回"部分,增加了"定期定额投资计划"业务代销机构。

6.在"八、基金的投资"部分补充了本基金最近一期(2009 年第四季度)投资组合报告内容。

7.在"九、基金的业绩"部分更新了基金成立以来的投资业绩。

8.在"二十一、其他应披露事项"部分更新了本基金最近一次招募说明书更新以来的公告事项。

万家基金管理有限公司

2010 年 4 月 30 日

证券代码:000507 证券简称:粤 富 华 公告编号:2010-012

珠海经济特区富华集团股份有限公司 2010 年第一季度报告

§1 重要提示

1.1 本公司董事局、监事会及董事、监事、高级管理人员保证本报告所载资料不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性负个别及连带责任。

1.2 公司第一季度财务报告未经会计师事务所审计。

1.3 公司董事局主席杨润贵先生、总裁欧辉生先生及财务总监杨光辉先生声明:保证季度报告中财务报告的真实、完整。

§2 公司基本情况

2.1 主要会计数据及财务指标

单位:元

	本报告期末	上年度期末	增减变动(%)
总资产(元)	1,980,428,276.73	1,724,920,497.27	14.81%
归属于上市公司股东的所有者权益(元)	1,241,940,128.12	1,259,330,068.26	-1.38%
股本(股)	344,997,420.00	344,997,420.00	0.00%
归属于上市公司股东的每股净资产(元/股)	3.5999	3.6503	-1.38%
	本报告期	上年同期	增减变动(%)
营业总收入(元)	51,752,089.87	34,712,791.70	49.09%
归属于上市公司股东的净利润(元)	-17,389,940.14	-23,771,192.76	-26.84%
经营活动产生的现金流量净额(元)	217,336,079.00	-13,554,385.74	-1,703.44%
每股经营活动产生的现金流量净额(元/股)	0.6300	-0.0393	-1,703.44%
基本每股收益(元/股)	-0.0504	-0.0689	903.79%
稀释每股收益(元/股)	-0.0504	-0.0689	903.79%
加权平均净资产收益率(%)	-1.39%	-2.05%	0.66%
扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率(%)	-1.16%	-2.29%	1.13%

非经常性损益项目	年初至报告期期末金额
计入当期损益的政府补助,但与公司正常经营业务密切相关,符合国家政策规定、按照一定标准定额或定量持续享受的政府补助除外	19,499.00
除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益	-2,818,061.42
除上述各项之外的其他营业外收入和支出	-83,321.26
所得税影响额	22,576.71
合计	-2,859,306.97

对重要非经常性损益项目的说明

除同公司正常经营业务相关的有效套期保值业务外,持有交易性金融资产、交易性金融负债产生的公允价值变动损益,以及处置交易性金融资产、交易性金融负债和可供出售金融资产取得的投资收益-282 万元主要是指公司本报告期证券投资损益,包括处置交易性金融资产投资收益-187 万元,公允价值变动损益-94 万元。

2.2 报告期末股东总人数及前十名无限售条件股东持股情况表

单位:股

报告期末股东总数(户)	50,874	
前十名无限售条件流通股股东持股情况		
股东名称(全称)	期末持有无限售条件流通股的数量	种类
珠海市人民政府国有资产监督管理委员会	56,568,194	人民币普通股
中国工商银行-广发聚丰股票型证券投资基金	8,155,853	人民币普通股
中国工商银行-招商核心价值混合型证券投资基金	4,907,054	人民币普通股
广发证券股份有限公司	3,398,266	人民币普通股
中国化纤总公司	2,544,546	人民币普通股
上海博轩装饰设计工程有限公司	2,409,297	人民币普通股
中国工商银行-中银动态策略股票型证券投资基金	1,796,234	人民币普通股
赵小明	1,624,658	人民币普通股
深圳市斯曼达科技有限公司	1,091,100	人民币普通股
邹信昌	1,024,096	人民币普通股

§3 重要事项

3.1 公司主要会计报表项目、财务指标大幅度变动的情况及原因

√ 适用 □ 不适用

项 目	2010 年 3 月 31 日	2009 年 12 月 31 日	变动%
货币资金	389,552,177.55	236,879,056.73	64.45%
交易性金融资产	38,004,730.36	20,245,162.39	87.72%
应收票据	2,869,035.81	1,989,776.10	44.19%
预付款项	46,465,680.05	16,717,426.76	177.95%
在建工程	44,155,684.66	18,458,845.26	139.21%
开发支出	18,318,521.12	10,176,244.41	80.01%
预收款项	2,801,249.74	2,019,735.03	38.69%
应交税费	7,526,128.96	12,177,798.14	-38.20%
应付股利	5,858,918.60	13,212,783.82	-55.66%
其他流动负债	670,452.01	324,778.46	106.43%
长期借款	41,300,000.00	15,300,000.00	169.93%
专项应付款	249,098,700.00	-	100.00%
少数股东损益	6,879,320.97	180,311.87	3715.23%
项 目	2010 年 1-3 月份	2009 年 1-3 月份	变动%
营业收入	51,752,089.87	34,712,791.70	49.09%
营业成本	47,291,744.68	35,357,891.89	33.75%
资产减值损失	-2,554,186.71	-543,580.94	369.88%
公允价值变动收益	-944,633.54	6,322,762.72	-114.94%
投资收益	-1,879,630.42	-5,392,898.30	-65.15%

变动原因说明:

1、货币资金和专项应付款增加的主要原因是公司本报告期收到搬迁补偿款所致;

2、交易性金融资产增加的主要原因是公司本报告期增加证券投资所致;

3、应收票据增加的主要原因是公司本报告期开展业务收到银行承兑汇票所致;

4、预付款项增加的主要原因是公司本报告期风电项目支付设备定金所致;

5、在建工程增加的主要原因是公司本报告期收购汇通物流公司,增加汇通物流公司在建工程所致;

6、开发支出增加的主要原因是公司本报告期结转薄型电子布的织造及后处理关键技术研究项目投入的固定资产等所致;

7、预收款项增加的主要原因是公司本报告期预收货款增加所致;

8、应交税费减少的主要原因是公司本报告期缴纳各项税费所致;

9、应付股利减少的主要原因是公司本报告期支付珠海市国资委股利所致;

10、其他流动负债增加的主要原因公司本报告期预提销售费用所致;

11、长期借款增加的主要原因公司本报告期向金融机构融资所致;

12、少数股东损益增加的主要原因是公司本报告期收到少数股东对风能公司注资款所致。

13、营业收入、营业成本增加的主要原因是子公司富华复材公司本报告期扩大销售所致;

14、资产减值损失转回增加的主要原因是公司本报告期存货市场价值回升转回存货跌价损失所致;

15、公允价值变动收益变动的主要原因是受证券市场影响,公司本报告期持有的证券投资出现亏损所致;

16、投资收益亏损减少的主要原因是公司本报告期联营企业裕富通聚酯有限公司亏损减少及证券投资亏损减少所致。

3.2 重大事项进展情况及其影响和解决方案的分析说明

√ 适用 □ 不适用

1、根据公司 2009 年 1 月 13 日召开的第七届董事局第三次会议决议,公司对高栏岛风电场项目进行投资。2010 年 1 月,双方股东按比例对项目公司珠海富华风能开发有限公司增加注册资本金,公司按 95%的股权比例增加出资 12730 万元,本次增资完成后,注册资本增加到 1.39 亿元。目前项目正常推进。

2、报告期内,珠海高栏港商业中心项目正式开工建设,并已支付地价款及前期开发费用约 2000 万元。

3、根据公司 2009 年 12 月 28 日召开的第七届董事局第十五次会议审议通过,公司对全资企业珠海富华进出口有限公司增资人民币 3783.1 万元,使其注册资本增加到人民币 5000 万元,并将其更名为"珠海港物流发展有限公司"。报告期内,珠海富华进出口有限公司增资手续已完成,名称核准手续仍在进行中。

4、经 2009 年 12 月 28 日召开的第七届董事局第十五次会议审议通过,公司同意珠海富华进出口有限公司出资 3927 万元收购珠海汇通物流有限公司。截止 2010 年 2 月 5 日,珠海汇通物流有限公司工商变更手续已办理完毕,成为公司全资企业。

5、根据武汉烽火富华电气有限公司的《公司章程》和《投资合作协议书》,电力集团公司分两期实缴完成出资,2010 年 1 月,电力集团公司完成第二次出资 800 万元,其中认缴出资 430 万元作为注册资本,另外的 370 万元溢价部分作为该公司的资本公积。

6、珠海富华复合材料有限公司已于 2010 年 3 月 3 日收到珠海市财政局支付的首期搬迁补偿金人民币 24909.87 万元(相当于搬迁补偿总金额的二分之一)。根据《搬迁补偿协议》的约定,其余款项人民币 24909.87 万元将于原富华复材兰埔厂区用地出让成功之日起七个月内支付完毕。

7、公司持有 20%股权的珠海新源热力有限公司高栏港经济区集中供热项目于 2010 年 3 月 22 日正式投产。

8、2010 年 3 月,公司持股 50%的珠海可口可乐饮料有限公司计划投入 5000 万元扩建厂房,以解决因仓库场地容量不足而到外租用仓库的问题,从而降低经营成本。该建设工期预计至 2011 年终结束,所需资金来源:一是经营活动产生的流动资金;二是银行贷款。

9、2010 年 1 月 15 日公司收到珠海市人民政府国有资产监督管理委员会(以下简称"珠海国资委")发来的《关于无偿划转富华集团股份有限公司市属国有股权的通知》:经珠海市政府同意,珠海市国资委将持有的本公司 16.4%股权(56,568,194 股)无偿划转给珠海港控股集团有限公司持有。目前,该事项尚待国务院国资委批复。

10、2010 年 3 月 9 日,珠海市人民政府国有资产监督管理委员会所持我公司全部股份(56,568,194 股,占公司总股本的 16.4%)解除限售手续办理完毕,可上市流通。

11、公司下属企业珠海经济特区电力开发集团股份有限公司持股 3%的珠海 LNG 项目在 2010 年 4 月获得国家发改委立项批准,目前各方正加紧推进项目建设前期的准备工作。

12、2010 年 1 月,珠海港控股集团有限公司与珠海经济特区富华物业管理公司签署《房屋委托租赁管理协议》,珠海港控股集团有限公司采取总承包的方式,授权由珠海经济特区富华物业管理公司全权负责租赁经营管理。委托期限:2010 年 1 月 1 日—2012 年 12 月 31 日。承包费用:第一年 145 万元;第二年 160 万元,第三年 180 万元。鉴于公司董事局主席杨润贵先生同时担任珠海港控股集团有限公司董事长,项交易属于关联交易,其所涉金额未达到董事局会议审议和单独披露的标准。

3.3 公司、股东及实际控制人承诺事项履行情况

√ 适用 □ 不适用

承诺事项	承诺人	承诺内容	履行情况
股改承诺	珠海市人民政府国有资产监督管理委员会	1、珠海市人民政府国有资产监督管理委员会:承诺事项:(1)遵守法律、法规和规章的规定,履行法定承诺义务;(2)在前述承诺期(法定限售期一年)期满后,24 个月内不通过证券交易所出售其所持股份;(3)在粤富华股权分置改革实施后的 5 年内,通过二级市场卖出所持有粤富华股票的价格不低于近 5 年的最高交易价格 9.97 元;(4)对置入上市公司的功控集团未来三年经营业绩做出承诺,如果功控集团的净利润在 2006 年,或者 2007 年,或者 2008 年中的任何一年少于 7500 万元时,对粤富华流通股股东(即,本次股权分置改革方案实施后,无限售条件的流通股股东)按照差额比例追送股份;(5)对未明确表示同意参与本次股权分置改革的非流通股股东(珠海经济特区红塔仁恒纸业公司、珠海科技奖励基金会、珠海教育基金会、大华基金、发展银行、农行珠海分行联社及珠海义海公司)及由于存在股权质押、冻结等情形无法执行对价安排的非流通股股东(珠海经济特区冠华轻纺总公司、深圳市中科招商创业投资管理有限公司、重庆超思信息材料股份有限公司)先行代为垫付对价安排;珠海市纺织工业集团公司:承诺事项(1)遵守法律、法规和规章的规定,履行法定承诺义务;(2)纺织集团承诺在其法定限售期满后,通过证券交易所挂牌交易出售原非流通股股份,出售数量占公司股份总数的比例在十二个月内不得超过百分之五,在二十四个月内不得超过百分之十。	1、报告期末发生违反第 3 项承诺的情况;2、第 1、2、4、5 项承诺已履行完毕。
股份限售承诺	无	无	无
收购报告书或权益变动报告书中所作承诺	无	无	无
重大资产重组时所作承诺	无	无	无
发行时所作承诺	无	无	无
其他承诺(含追加承诺)	无	无	无

3.4 预测年初至下一报告期期末的累计净利润可能为亏损或者与上年同期相比发生大幅度变动的警示及原因说明

□ 适用 √ 不适用

3.5 其他需说明的重大事项

3.5.1 证券投资情况

√ 适用 □ 不适用

单位:元

序号	证券品种	证券代码	证券简称	初始投资金额(元)	期末持有数量(股)	期末账面值(元)	占期末证券总投资比例(%)	报告期损益(元)
1	股票	000039	中集集团	10,022,474.84	700,000.00	9,884,000.00	26.01%	-138,474.84
2	股票	000066	长城电脑	8,635,672.50	510,093.00	9,242,885.16	24.32%	607,212.66
3	股票	000970	中科三环	2,295,307.08	200,000.00	2,444,000.00	6.43%	148,692.92
4	股票	600824	益民商业	2,229,609.29	200,000.00	2,270,000.00	5.97%	40,390.71
5	股票	600779	水井坊	2,174,786.81	100,000.00	2,139,000.00	5.63%	-35,786.81
6	股票	002210	飞马国际	1,732,686.92	129,100.00	1,749,305.00	4.60%	16,618.08
7	股票	600760	东安黑豹	1,730,744.84	200,000.00	1,748,000.00	4.60%	17,255.16
8	股票	000024	招商地产	1,484,649.85	60,000.00	1,450,800.00	3.82%	-33,849.85
9	股票	000800	一汽轿车	1,407,697.50	60,000.00	1,323,600.00	3.48%	-84,097.50
10	股票	600183	生益科技	1,180,690.00	100,000.00	1,216,000.00	3.20%	35,310.00
期末持有的其他证券投资				4,308,081.08	-	4,537,140.00	11.94%	229,058.92
报告期已出售证券投资损益				-	-	-	-	-3,620,390.87
合计				37,202,400.71	-	38,004,730.16	100%	-2,818,061.42

证券投资情况说明

证券投资为公司在交易性金融资产科目核算的股票和基金投资,期末账面值按深圳证券交易所和上海证券交易所在 2010 年 3 月 31 日股票、基金的收盘价计量。

3.5.2 报告期接待调研、沟通、采访等活动情况表

接待时间	接待地点	接待方式	接待对象	谈论的主要内容及提供的资料
2010年 01 月 11 日	公司	面谈	广发证券	介绍公司主要业务经营情况
2010年 03 月 03 日	公司	面谈	鹏华基金、天弘基金、广发证券	介绍公司主要业务经营情况
2010年 03 月 05 日	公司	面谈	上海义信投资有限公司	介绍公司主要业务经营情况
2010年 03 月 11 日	公司	面谈	金鹰基金	介绍公司主要业务经营情况
2010年 03 月 12 日	公司	面谈	南方基金管理有限公司、中信证券股份有限公司	介绍公司主要业务经营情况
2010年 03 月 18 日	公司	面谈	友邦华泰基金	介绍公司主要业务经营情况
2010年 03 月 31 日	公司	电话沟通、邮件咨询	投资者数十人	介绍公司主要业务经营情况

3.5.3 其他重大事项的说明

□ 适用 √ 不适用

3.6 衍生品投资情况

□ 适用 √ 不适用

3.6.1 报告期末衍生品投资的持仓情况

□ 适用 √ 不适用