

# B076 信息披露 | Disclosure

## (上接B075版)

公司网址:www.dgzq.com.cn  
(90)国都证券有限责任公司  
注册(办公)地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层

法定代表人:常站  
联系人:李俊  
电话:010-84183331  
客服电话:400-818-8118  
公司网址:www.guodu.com  
(91)东海证券股份有限公司  
注册地址:江苏省常州市延陵西路23号投资广场18层  
办公地址:上海市浦东新区东方路1928号东海证券大厦  
法定代表人:宋科敏  
联系人:王一彦  
电话:021-20333333  
客服电话:96631;400-8888-588  
公司网址:www.longone.com.cn  
(92)国盛证券有限责任公司  
注册(办公)地址:江西省南昌市北京西路88号江信国际金融大厦  
法定代表人:马跃进  
联系人:周欣玲  
电话:0791-86281306  
客服电话:400-822-2111  
公司网址:www.gsstock.com  
(93)申万宏源证券股份有限公司  
注册(办公)地址:新疆乌鲁木齐市高新区(新市区)北京南路358号大成国际大厦20楼2006室  
法定代表人:韩志谦  
联系人:王怀春  
电话:0991-2307106  
客服电话:4008000562  
公司网址:www.swhysc.com  
(94)世纪证券有限责任公司  
注册(办公)地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼  
法定代表人:姜美华  
联系人:夏雯  
电话:0755-831199611  
客服电话:0755-83190690  
公司网址:www.csco.com.cn  
(95)金元证券股份有限公司  
注册地址:海口市南宝路36号证券大厦4楼  
办公地址:深圳市深南大道4001号时代金融中心大厦17楼  
法定代表人:陆涛  
联系人:马国涛  
电话:0755-830025022  
客服电话:4008-898-228  
公司网址:www.jyzq.cn  
(96)中航证券有限公司  
注册(办公)地址:江西省南昌市红谷滩新区红谷大道1619号国际金融大厦A座14楼  
法定代表人:王宜四  
联系人:史江蕊  
电话:010-64818301  
客服电话:400-8866-567  
公司网址:www.avicsec.com  
(97)德邦证券股份有限公司  
注册地址:上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼  
办公地址:上海市福山路500号城建国际中心26楼  
法定代表人:姚文平  
联系人:刘熠  
客服电话:400-8888-128  
公司网址:www.tebon.com.cn  
(98)西藏证券股份有限公司  
注册(办公)地址:西安市东大街232号信托大厦16-17层  
法定代表人:刘建武  
联系人:陈承华  
电话:029-87406168  
客服电话:95682  
公司网址:www.westsecu.com  
(99)华福证券有限责任公司  
注册(办公)地址:福州市鼓楼区温泉街道五四路157号7-8层  
法定代表人:黄金琳  
联系人:郭相兴  
电话:021-20655175  
客服电话:96326  
公司网址:www.hfzq.com.cn  
(100)华龙证券股份有限公司  
注册(办公)地址:甘肃省兰州市城关区东岗西路638号兰州财富中心21楼  
法定代表人:李晓安  
联系人:刘鹏怡  
电话:0931-4890208  
客服电话:0931-4890619  
公司网址:www.hlzgs.com  
(101)中国国际金融有限公司  
注册(办公)地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2层27层及28层  
法定代表人:毕明建(代)  
联系人:董薇婧  
电话:0755-83770601  
客服电话:010-65061166,0755-83196000  
公司网址:www.cicc.com.cn  
(102)财通证券股份有限公司  
注册(办公)地址:杭州市杭大路15号嘉华国际商务中心  
法定代表人:沈晓明  
联系人:周志华  
电话:0571-87789160  
客服电话:96336,40086-96336  
公司网址:www.ctsec.com  
(103)五矿证券有限公司  
注册地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元

办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心大厦47,48,49层  
法定代表人:赵立功  
联系人:王鹏宇  
电话:0755-83219194  
客服电话:40018-40028  
公司网址:www.wkzq.com.cn  
(104)华鑫证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)  
办公地址:上海市肇嘉浜路750号  
法定代表人:俞萍  
联系人:杨莉娟  
电话:021-64376936  
客服电话:4008-888-999  
公司网址:www.cfsc.com.cn  
(105)中国中投证券有限责任公司  
注册(办公)地址:深圳福田区益田路6003号荣超商务中心A座第4、第18-21层  
法定代表人:高涛  
联系人:万玉琳  
电话:0755-82026907  
客服电话:96632;400-600-8008  
公司网址:www.china-invs.cn  
(106)中山证券有限责任公司  
注册及办公地址:深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层  
法定代表人:黄诚  
业务联系人:罗艺琳  
电话:0755-82570586  
客服电话:4001-022-011  
公司网址:www.zszq.com  
(107)日信证券有限责任公司  
注册(办公)地址:内蒙古自治区内蒙古呼和浩特市锡林南路18号  
法定代表人:孔佑杰  
联系人:陈希彬  
电话:010-88086930  
客服电话:010-88096830  
公司网址:www.rxzq.com.cn  
(108)联讯证券股份有限公司  
注册(办公)地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼

法定代表人:徐刚  
联系人:彭彦  
电话:0752-2119700  
客服电话:95664  
公司网址:www.lxzq.com.cn  
(109)江海证券有限公司  
注册(办公)地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区顺水街66号  
法定代表人:孙名扬  
联系人:晋俊  
电话:0451-85863226  
客服电话:400-666-2788  
公司网址:www.jhzq.com.cn  
(110)九州证券股份有限公司  
注册地址:青海省西宁市南川工业园区创业路108号  
办公地址:北京市朝阳区安立路30号仰山公园东一72号楼  
法定代表人:魏先鋒  
联系人:张薇婧  
电话:010-57672000,0755-33331188-8807  
客服电话:95305  
公司网址:www.jzsec.com  
(111)国金证券股份有限公司  
注册(办公)地址:四川省成都市东城根上街95号  
法定代表人:冉云  
联系人:刘怡薇、贾鹏  
电话:028-86690067,028-86690068  
客服电话:96310  
公司网址:www.gjzq.com.cn  
(112)中国民族证券有限责任公司  
注册地址:北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼  
办公地址:北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观A座40F-43F  
法定代表人:何亚刚

联系人:李小微  
电话:010-59355930  
客服电话:4008896818  
公司网址:www.ef618.com  
(113)华宝证券有限责任公司  
注册(办公)地址:上海市陆家嘴环路未来资产大厦27层  
法定代表人:陈林  
联系人:宋歌  
电话:021-50122086  
客服电话:021-38929098,400-820-9898  
公司网址:www.cnhbstock.com  
(114)爱建证券有限责任公司  
注册(办公)地址:上海市浦东新区世纪大道1600号32楼  
法定代表人:钱华  
联系人:王霖  
电话:021-32229898-25125  
客服电话:4001962502  
公司网址:www.aijz.com  
(115)英大证券有限责任公司  
注册(办公)地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层  
法定代表人:吴俊  
联系人:吴尔辉  
电话:0756-83007159  
客服电话:4008-188-688  
公司网址:www.ydsc.com.cn  
(116)华融证券股份有限公司  
注册(办公)地址:北京市西城区金融大街8号  
法定代表人:杨忠志  
联系人:李慧灵  
电话:010-85566100  
客服电话:96390;400-898-9999  
公司网址:www.hasec.com.cn  
(117)天风证券股份有限公司  
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼  
办公地址:湖北省武汉市武昌区中南路99号保利广场A座37楼  
法定代表人:余磊  
联系人:夏雯  
联系电话:13971536830  
客服电话:4008005000  
公司网址:www.tfzq.com  
(118)首创证券股份有限公司  
注册(办公)地址:北京市西城区德胜门外大街115号德胜尚城E座  
法定代表人:吴涛  
联系人:李宇  
电话:010-59366070  
客服电话:4006200620  
公司网址:http://www.sczq.com.cn/  
(119)宏信证券有限责任公司  
注册(办公)地址:四川省成都市人民南路二段十八号川信大厦10楼  
法定代表人:吴玉明  
联系人:杨磊  
电话:028-86199041  
客服电话:4008-366-366  
公司网址:www.hxzq.cn  
(120)太平洋证券股份有限公司  
注册(办公)地址:云南省昆明市青年路389号志远大厦18层  
法定代表人:李长伟  
联系人:唐田田  
电话:010-88321717  
客服电话:0871-68898130  
公司网址:www.tpyzq.com  
(121)开源证券股份有限公司  
注册(办公)地址:西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层  
法定代表人:李刚  
联系人:袁伟涛  
电话:029-63387289  
客服电话:400-860-8866  
公司网址:www.kysec.com  
(122)杭州科瑞瑞基金销售有限公司  
注册地址:杭州市下城区武林时代商务中心1604室  
办公地址:杭州市下城区上塘路15号武林时代20楼  
法定代表人:陈刚  
联系人:李璇  
联系电话:0571-85267500  
客服电话:0571-86655920  
公司网址:www.cd121.com  
(123)中证金牛(北京)投资咨询有限公司  
注册地址:北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室  
办公地址:北京市宣武门外大街甲一号新华社第三工作区A座5层  
法定代表人:钱昊旻  
联系人:朴甜甜  
联系电话:010-59336492  
客服电话:4008-909-998  
公司网址:www.jinc.com  
(124)浙江金观诚财富管理有限公司  
注册地址:拱墅区霞湾巷239号8楼4楼403室  
办公地址:杭州市教工路18号EAC欧美中心A座D区8层  
法定代表人:徐黎云  
联系电话:0571-56028617  
客服电话:400-068-0058  
公司网址:www.jincheng-fund.com  
(125)凤凰金信(银川)投资管理有限公司  
注册地址:宁夏回族自治区银川市金凤区阅海中央商务区万寿路142号14层

办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼  
法定代表人:程刚  
联系人:张旭  
联系电话:010-58160168  
客服电话:400-810-5819  
公司网址:www.jengf.com  
(126)上海东夏财富管理管理有限公司  
注册地址:上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室  
办公地址:北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座3层  
法定代表人:李一梅  
客服电话:400-817-5666  
公司网址:www.amcfortune.com  
(127)华泰联合证券有限责任公司  
注册(办公)地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层(01A、02、03、04)、17A、18A、24A、25A、26A  
法定代表人:马晓明  
联系人:施晓芸  
电话:0755-82492193  
客服电话:95613(全国)、400-888-565  
公司网址:www.lhzq.com  
(128)中信证券(浙江)有限责任公司  
注册(办公)地址:浙江省杭州市滨江区江南大道688号恒鑫大厦主楼19-20层  
法定代表人:沈晓明  
联系人:丁思聪  
电话:0571-87112510  
客服电话:96698  
公司网址:www.bigsun.com.cn  
(129)齐鲁证券有限公司  
注册(办公)地址:山东省济南市经一路20518号  
法定代表人:李玮  
联系人:王霖  
电话:0531-688889157  
客服电话:95638  
公司网址:www.qizq.com.cn  
(130)海银基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区银城中路8号402室  
办公地址:上海市浦东新区银城中路8号4楼  
法定代表人:刘惠  
联系人:毛林  
电话:0531-688889157  
客服电话:95638  
公司网址:www.hqzq.com.cn  
(131)海银基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道141号1218号1楼202室  
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F  
法定代表人:陈柏青  
联系人:韩晓彬  
电话:0571-26888888-37494  
客服电话:4000-766-123  
公司网址:www.fund123.cn  
(134)北京乐融多源投资咨询有限公司  
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层  
法定代表人:董浩  
电话:010-56176115  
客服电话:400-100-3391  
公司网址:www.bjyfund.com  
(132)济安财富(北京)基金销售有限公司  
注册地址:北京市朝阳区东三环中路16号院1号楼3层307  
办公地址:北京市朝阳区太阳宫中路16号院1号楼3层307  
法定代表人:杨健  
联系人:李海婧  
联系电话:010-65309516  
客服电话:400-673-7010  
公司网址:www.jianfortune.com  
(133)蚂蚁(杭州)基金销售有限公司  
注册地址:杭州市余杭区仓前街道141号1218号1楼202室  
办公地址:浙江省杭州市西湖区万塘路18号黄龙时代广场B座6F  
法定代表人:陈柏青  
联系人:韩晓彬  
电话:0571-26888888-37494  
客服电话:4000-766-123  
公司网址:www.fund123.cn  
(134)北京乐融多源投资咨询有限公司  
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号温特莱中心A座16层  
法定代表人:董浩  
电话:010-56409010  
客服电话:400-068-1176  
公司网址:www.jimufund.com  
(135)上海云湾投资管理有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区新金桥路27号13号楼2层  
办公地址:上海市浦东新区锦康路308号6号楼6楼  
法定代表人:戴圣铨  
联系人:戴圣铨  
电话:021-20538888

客服电话:4008201515  
公司网址:www.zhengtongfunds.com  
(136)申银万国证券股份有限公司  
注册(办公)地址:上海市常熟路171号  
法定代表人:储晓明  
联系人:曹静  
联系电话:021-54047892  
公司网址:www.sywg.com  
(137)宜信普泽投资顾问(北京)有限公司  
注册地址:北京市朝阳区建国路89号5号楼1层1809  
办公地址:北京市朝阳区建国路89号soho现代城C座18层1809  
法定代表人:戎兵  
联系人:魏晨  
联系电话:010-52413395  
客服电话:400-6099-200  
公司网址:www.yixinfund.com  
(138)南京苏宁基金销售有限公司  
注册地址:南京玄武区苏宁大道1-5号  
办公地址:南京玄武区苏宁大道1-5号  
法定代表人:王峰  
联系人:张慧  
联系电话:025-66996699  
客服电话:95177  
公司网址:www.snjin.com  
(139)深圳信诚基金销售有限公司  
注册地址:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室  
办公地址:深圳市福田区中心区东南国际时代财富大厦49A  
法定代表人:周文  
联系人:殷浩然  
联系电话:010-84865370  
客服电话:0755-23946579  
公司网址:www.scpetfund.com  
(140)上海挖财基金销售有限公司  
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区杨高南路799号5层01、02、03室  
办公地址:上海市徐汇区汇平南路68号金座东方财富大厦  
法定代表人:冷飞  
联系人:孙琦  
联系电话:021-50810687  
客服电话:021-50810687  
公司网址:www.snjin.com  
(141)西藏东方财富证券股份有限公司  
注册地址:拉萨市北京中路101号  
办公地址:上海市徐汇区汇平南路68号金座东方财富大厦  
法定代表人:陈宏  
联系人:付佳  
联系电话:021-23586603  
客服电话:95357  
公司网址:http://www.sczq.com.cn/  
公司网址:www.18.cn  
(142)民商基金销售(上海)有限公司  
注册地址:上海黄浦区北京东路666号H区(东座)6楼A31室  
办公地址:上海市浦东新区张杨路707号生命人寿大厦32楼  
法定代表人:袁彬  
联系人:杨一昕  
联系电话:021-50292031  
客服电话:021-50292031  
公司网址:www.wq.com.cn  
(145)联储证券有限责任公司  
注册地址:广东省深圳市福田区北路华强北圣廷苑酒店B座26楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路333号金外滩大厦3楼  
法定代表人:沙常明  
联系人:丁倩云  
联系方式:010-56177851  
客服电话:400-620-6868  
公司网址:www.lczq.com  
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基金,并及时公告。

(二)注册登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
地址:北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人:周明  
电话:4008058068  
传真:(0755)215087122  
联系人:赵亦清  
(三)律师事务所和经办律师  
名称:广东岭南律师事务所  
住所:广州市新海西路135号中山大学西門科技园601-605室  
法定代表人:邓海海  
电话:020-94036397  
传真:020-94113152  
经办律师:戴国民、何官益  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
名称:中审众环会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:武汉市武昌区东湖路169号众环大厦2-9层  
法定代表人:石文先  
电话:027 86770649  
传真:027 85424329  
邮编:430077  
经办注册会计师:王兵、龚静伟  
四、基金的名称  
本基金名称:金鹰中小盘精选证券投资基金  
五、基金的类型  
本基金类型:契约型开放式  
六、基金的投资目标  
本基金投资具有较高成长性和良好基本面的中小盘股票,通过积极的投资组合管理,在控制风险的前提下谋求基金资产的长期稳定增值。  
七、基金的投资方向  
本基金的投资方向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、债券及中国证监会允许基金资产投资的其他金融工具。  
本基金的投资策略主要投资于具有较高成长性且良好基本面的、流通市值在市場平均市值之下的小盘股票(流通市值排名前20%(含20%)的新上市股票一年內不列入流通市值市場平均值的计算)。本基金的其他股票投资还包括新股申购、股票增发申购等。  
本基金的债券投资包括国内依法公开发行、上市的国家债券、金融债、企业(公司)债(包括可转债)等债券。  
本基金的股票投资占基金资产总值的比例为50%到80%。债券投资占基金资产总值的比例为20%到40%。现金及基金资产净值比例不超过10%。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。  
八、基金的投资策略  
(一)决策依据  
本基金投资决策依据包括:  
(1)宏观经济形势及前景、有关政策趋向;  
(2)行业发展现状与前景;  
(3)上市公司基本及发展前景;  
(4)证券市场走势及预期;  
(5)股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。  
(二)决策程序  
(1)基金管理人将研究部门基于对宏观经济、政策及证券市场的现状和发展趋势的深入分析研究,和对各别资产收益能力和风险大小的合理预期,向投资决策委员会提交投资建议,投资建议包括总体资产配置建议、类别资产配置建议、个股/券种投资建议;  
(2)投资决策委员会根据本基金的投资目标,结合对本基金投资相关因素的全局考虑,确定本基金的投资策略,制定总体资产配置计划;  
(3)本基金基金经理根据投资决策委员会制定的基金总体资产配置计划,考虑研究部门的相关建议,拟定投资计划,报投资决策委员会批准;  
(4)本基金基金经理根据投资决策委员会批准的投资计划,制定具体投资方案。

(三)组合原则  
本基金的投资组合必须符合以下比例规定:  
(1)本基金投资于股票、债券的比例,不得低于基金资产总值的80%;  
(2)本基金投资于国家债券的比例,不得低于基金资产净值的10%;  
(3)本基金持有一家上市公司的股票,不得超过基金资产净值的10%;  
(4)本基金与由本基金管理人管理的其他基金持有一家上市公司发行的证券总和,不得超过该证券的10%;  
(5)运用基金资产参与股票发行申购,所申报的金额不得超过本基金的总资产,本基金所申报的股票数量不得超过该发行股票公司该次发行的股票发行总量;  
(6)基金投资于中小盘股票的比例不低于本基金股票投资总额的90%;  
(7)本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的15%;  
(8)本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%;  
(9)本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过本基金资产净值的15%;  
(10)因证券市场波动、上市公司股票停牌、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金不符合前款所规定比例限制的,基金管理人不得主动新增流动性受限资产的投资;  
(11)基金与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易的,可接受质押品的资质要求应当与基金合同约定的交易对手保持一致;  
(11)本基金应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;  
(12)有法律法规、中国证监会及本基金合同所规定的其他比例限制;  
(13)法律法规或监管部门对上述比例另有规定时从其规定。  
(四)本基金股票投资策略  
本基金采取主动的股票投资策略,在专业研究的基础上,将系统的选股方法与积极的投资操作相结合,选择具有较高成长性、基本面良好的股票构建股票投资

组合,把握投资机会,实现收益。  
股票投资组合包括中小盘股票组合和其他股票组合。中小盘股票组合通过选择具有较高成长性、基本面良好的小盘股,依据有效分散的原则构建。其他股票投资主要是参与有较高投资价值的新股申购、股票增发申购以及根据市场情况的短期股票投资。  
(五)本基金债券投资策略  
采取稳健的混合管理投资策略,根据对利率、收益率走势的预测,考虑债券信用等级、期限、品种、流动性等因素,依据修正久期、凸性等指标,构建债券组合。  
九、基金的业绩比较基准  
中证700指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%  
十、基金的风险收益特征  
本基金属于风险适中、预期收益较高的证券投资基金品种。  
十一、基金的投资组合报告  
本基金管理人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。  
本基金的托管人根据本基金合同的规定,复核了本报告中的内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本投资组合报告有关数据截止日为2019年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	276,112,587.48	67.49
其中:股票	276,112,587.48	67.49	
2	固定收益投资	95,641,000.00	23.36
其中:债券	95,641,000.00	23.36	
资产支持证券	--	--	
3	贵金属投资	--	--
4	金融衍生品投资	--	--
5	买入返售金融资产	--	--
其中:买断式回购的买入返售金融资产	--	--	
6	银行存款和结算备付金合计	29,268,728.12	7.15
7	其他各项资产	8,207,960.75	2.01
8	合计	409,120,276.35	100.00

注:其他资产包括:交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款。

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

(1)报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	--	--
B	采矿业	--	--
C	制造业	151,129,949.67	37.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,037,132.28	4.94
E	建筑业	--	--
F	批发和零售业	--	--
G	交通运输、仓储和邮政业	--	--
H	住宿和餐饮业	--	--
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,388,606.68	12.42
J	金融业	134,343.00	0.03
K	房地产业	36,609,995.96	9.02
L	租赁和商务服务业	5,517,144.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	--	--
O	居民服务、修理和其他服务业	--	--
P	教育	--	--
Q	卫生和社会工作	--	--
R	文化、体育和娱乐业	12,355,272.00	3.04
S	综合	--	--
合计		276,112,587.48	68.08

(2)报告期末按行业分类的港股投资股票投资组合

本基金本报告期末未通过港股通投资股票。  
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股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601155	新城控股	810,633	36,600,079.96	9.02
2	603711	香飘飘	1,122,220	36,798,816.00	8.83
3	603517	德棉食品	660,106	32,490,417.32	8.01
4	600881	四川能源	1,522,543	20,037,132.28	4.94
5	300271	华宇软件	873,486	18,579,269.92	4.58
6	000811	美轮环境	1,406,500	12,818,160.00	3.16
7	002174	新疆美尚	532,577	12,675,332.69	3.13
8	002014	永新股份	1,574,000	12,497,560.00	3.08
9	600677	中国彩玻	693,600	12,325,272.00	3.04
10	300339	阔创软件	916,900	11,854,224.00	2.92

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	国家债券	15,477,000.00	3.82
2	央行票据	--	--
3	金融债券	80,064,000.00	19.74
其中:政策性金融债	80,064,000.00	19.74	
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	--	--
6	中期票据	--	--
7	可转债(可交换债)	--	--
8	其他债券	--	--
9	同业存单	--	--
10	合计	95,541,000.00	23.66

注:本基金本报告期末仅持有两只债券。

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

本基金本报告期末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贵金属投资明细

本基金本报告期末未投资贵金属。

8.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

本基金本报告期末未投资权证。

9.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资股指期货。

(2)本基金投资股指期货的投资政策

10.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本期国债期货投资政策

(2)报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

11.投资组合报告附注

(1)本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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、处罚的情况。

(2)报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

(3)其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	226,190.04
2	应收证券清算款	6,477,465.33
3	应收股利	--
4	应收利息	908,146.19
5	应收申购款	596,129.19
6	其他应收款	--
7	待摊费用	--
8	其他	--
9	合计	8,207,960.75

(4)报告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。

(5)报告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不存在流通受限情况。

(6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩  
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。基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

(一)投资收益比较  
本基金合同生效日为2004年5月27日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示:

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
2004.5.27-2004.12.31	-6.71%	0.82%	-13.57%	1.11%	7.86%	-0.29%
2005.1.1-2005.12.31	-5.11%	1.07%	-7.98%	1.19%	2.87%	1.2%
2006.1.1-2006.12.31	86.40%	1.20%	67.98%	1.15%	18.51%	0.05%
2007.1.1-2007.12.31	54.47%	1.62%	122.43%	1.90%	-67.96%	0.80%
2008.1.1-2008.12.31	-35.03%	2.27%	-50.04%	2.47%	15.01%	-0.20%
2009.1.1-2009.12.31	80.48%	1.65%	80.89%	1.63%	-0.41%	0.02%
2010.1.1-2010.12.3						