

## DISCLOSURE 信息披露

2008年 / 12月 23日 / 星期二

D007

(上接D006版)

(2)积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	15,278,148.00	0.33
C	制造业	71,494,198.46	1.56
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	51,274,666.90	1.12
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械设备、仪表	16,278,289.56	0.35
C8	医药、生物制品	3,941,242.00	0.09
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	1,506,331.71	0.03
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	11,531,213.12	0.25
H	批发和零售贸易	2,782,202.01	0.06
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
5	合计	102,592,093.30	2.24

(3)指数投资前五名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	600036	招商银行	13,776,679	242,745,083.98	5.29
2	601318	中国平安	4,662,113	155,108,499.51	3.38
3	600030	中信证券	5,737,562	142,062,035.12	3.10
4	601328	交通银行	20,539,787	122,947,526.26	2.68
5	600000	浦发银行	7,728,412	120,717,795.44	2.63

(4)积极投资前五名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	002008	大族激光	3,076,508	30,211,308.56	0.66
2	000418	小天鹅A	3,931,954	16,278,289.56	0.35
3	601958	金钼股份	1,282,800	15,278,148.00	0.33
4	002214	大立科技	1,351,962	12,018,942.18	0.26
5	002194	武汉凡谷	735,409	11,531,213.12	0.25

(5)债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	307,965,000.00	6.71
3	金融债券	-	-
4	其中：政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
8	合计	307,965,000.00	6.71

(2)基金投资前五名债券明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	002008	大族激光	3,076,508	30,211,308.56	0.66
2	000418	小天鹅A	3,931,954	16,278,289.56	0.35
3	601958	金钼股份	1,282,800	15,278,148.00	0.33
4	002214	大立科技	1,351,962	12,018,942.18	0.26
5	002194	武汉凡谷	735,409	11,531,213.12	0.25

(3)货币市场基金

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	031001	阿胶EJCI	139,285	1,378,921.50	0.03

(4)报告期末未持有资产的证券的情况

本基金报告期末未持有资产的证券的情况

(5)报告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

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产的净值比例(%)
1	031001	阿胶EJCI	139,285	1,378,921.50	0.03

(6) 投资组合报告附注

本公司报告期末前十名债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年内不存在受到公开谴责、处罚的情况。

本基金报告期末不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(7)其他资产

序号	名称	金额(元)
1	存放保证金	1,607,293.58
2	应收利息清算款	-
3	应收股利	2,291,331.04
4	应收利息	3,565,334.52
5	应收申购款	90,879,239.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
8	合计	98,343,193.78

(8)报告期末未持有的处于质押状态的可供出售金融资产

本基金报告期末未持有可供出售金融资产。

(9)报告期末未持有或极低受限前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末指投资或积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

(10)报告期末未持有资产的证券的情况

本基金报告期末未持有资产的证券的情况

(11)报告期末未持有或极低受限前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金报告期末指投资或积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

十四、基金的业绩  
 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金过往的业绩并不代表其未来表现。投资人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表  
 (截至时间2008年6月30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	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2008-1-1至2008-6-30	-44.23%	2.85%	-44.29%	2.93%	0.06%	-0.08%
2007-12-31至2008-6-30	154.07%	2.15%	148.39%	2.17%	5.68%	-0.02%
2007-1-1至2007-12-31	121.21%	1.29%	116.27%	1.32%	4.94%	-0.03%
2006-12-31至2007-1-1	-0.56%	1.08%	-1.80%	1.13%	1.24%	-0.05%
2006-12-31至2007-6-30	-8.90%	1.02%	-13.41%	1.00%	4.51%	0.02%
2006-12-31至2007-1-1	11.46%	0.85%	8.17%	0.86%	3.29%	-0.01%
2006-12-31至2007-6-30	-1.70%	0.73%	-8.76%	0.92%	7.06%	-0.69%

十五、费用概览

(一)基金运作的费用

1.基金费用的种类

(2)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%费率计提。计算方法如下：

 $H = E \times 1\% - 当年天数$ 

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，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管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

(3)基金运作的费用

基金管理人可适当调整基金管理费，此项调整不需要基金份额持有人大会通过。

(4)基金销售费用的费用

基金管理人提供两种申购费用的模式。投资者选择在申购时交纳的称为前端申购费，投资者选择在赎回时交纳的称为后端申购费或前端赎回费。

(1)前端收费模式的申购按申购金额采用比例费率，申购费率如下：