新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

2010 年度报告摘要

基金管理人:新华基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一一年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司资产托管部根据本基金合同规定,于2011年3月25日复核了本报告中的财务指标、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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。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说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2010年01月01日起至2010年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	新华泛资源优势混合
基金主代码	519091
交易代码	519091
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009年7月13日
基金管理人	新华基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,120,729,581.65份

2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制风险的前提下,通过重点精选与集中配置具有社会资源和自然资源(泛资源)优势的股票,实现基金净值增长,以求持续地超越业绩比较基准。
投资策略	本基金采用"自下而上"结合"自上而下"的投资策略,通过股票选择、行业配置,结合自上而下的战术性大类资产配置策略,进行积极投资管理。
业绩比较基准	60%×沪深300指数 + 40%×上证国债指数
风险收益特征	本基金为混合型基金,属于证券投资基金中的中高等风险品种,预期风险和收益高于债券型、货币型基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		新华基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	齐岩	蒋松云
	联系电话	010-88423386	010-66105799
	电子邮箱	qiyan@ncfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008198866	95588
传真		010-88423310	010-66106904

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.nfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2010年	2009年7月13日(基金合同生效日)至2009年12月31日
本期已实现收益	50,865,334.53	-14,812,879.49
本期利润	-26,374,503.52	64,800,690.58
加权平均基金份额本期利润	-0.0170	0.0239
本期基金份额净值增长率	-2.14%	2.6000%
3.1.2 期末数据和指标	2010年末	2009年末
期末可供分配利润	5,007,274.37	-3,826,205.07
期末基金资产净值	1,125,736,856.02	1,861,694,794.02
期末基金份额净值	1.004	1.026

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益;

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如基金申购费赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、对期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1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

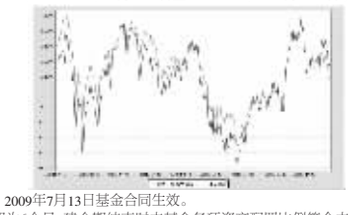
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	7.61%	1.24%	4.00%	1.06%	3.61%	0.18%
过去六个月	19.67%	1.17%	13.33%	0.93%	6.34%	0.24%
过去一年	-2.14%	1.28%	-5.83%	0.95%	3.69%	0.33%
自基金成立起至今	0.40%	1.39%	-1.91%	1.08%	2.31%	0.31%

注:1、本基金股票投资部分的业绩比较基准采用沪深300指数,债券投资部分的业绩比较基准采用上证国债指数,复合业绩比较基准为:60%*沪深300指数+40%*上证国债指数

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2009年7月13日至2010年12月31日)

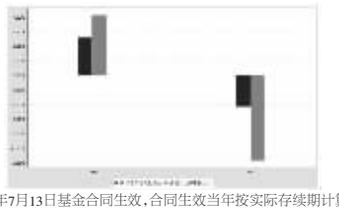


注:1、本基金于 2009年7月13日基金合同生效。

2、本基金建仓期为6个月,建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及投资组合的比例范围。

3.2.3 自基金合同生效以来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

新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金
自基金合同生效以来每年净值增长率图



注:本基金于 2009年7月13日基金合同生效,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3过去三年基金的利润分配情况

本基金于2009年7月13日基金合同生效,至2010年12月31日未进行过利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 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

新华基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会批复,于2004年12月9日注册成立。注册地为重庆市,是我国西部首家基金管理公司。

截至2010年12月31日,新华基金管理有限公司旗下管理着五只开放式基金,即新华优选分红混合型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金、新华钻石品质企业股票型证券投资基金和新华行业周期轮换股票型证券投资基金。

4.1.2基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

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
		任职日期	离任日期		
崔建波	本基金基金经理、新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理	2010-03-24	-	15	经济学硕士,历任天津中融证券投资咨询公司研究员、申银万国天津佟楼营业部投资经纪顾问部经理、海融资讯系统有限公司研究员、和讯信息科技有限公司证券研究部、理财服务部经理、北方国际信托股份有限公司投资部信托高级投资经理。现任新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理,新华行业周期轮换股票型证券投资基金基金经理。
王卫东	本基金基金经理、新华优选成长股票型证券投资基金基金经理;投资总监;副总经理	2009-07-13	2010-10-08	17	硕士,先后供职于广东发展银行海南证券业务部,任经理;广发证券公司海口海甸岛营业部,负责营业部管理并从事投资银行工作;广发证券公司投资理财部和自营部,任经理;华龙证券有限责任公司投资理财总部,任总经理;青岛海东清置业有限公司,任总经理。现任新华基金管理有限公司投资总监,副总经理,新华优选成长股票型证券投资基金基金经理,新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日为准。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券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运作遵规守信情况的说明

本报告期,新华基金管理有限公司作为新华泛资源优势灵活配置型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华泛资源优势灵活配置型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规,无损害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

本报告期内,基金管理人一直坚持公平交易原则,在投资决策和交易执行等各个环节保证公平交易原则的严格执行。

4.3.2本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内,基金管理人未管理与本基金风格相似的投资组合。

4.3.3异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2010年的行情分为两个阶段,1-3季度以大消费类和中小市值股票上涨为主,其中四月份"国八条"的出台,使得市场出现大幅度下跌,直到7月份初那企稳,这段时间是全年唯一值得低仓位操作的时段;国庆之后以资源类股票补涨为主。投资策略上,前期重配的行业以银行为主,当时的逻辑是2009年其他行业均经历了大幅的反弹过程,银行涨幅较少,同时银行的估值较低,对应2009年只有十几倍市盈率,对应2010年的市盈率则普遍在10倍左右甚至更低,而业绩上银行的增速较快、确定性强,所以当时重配了银行,从长期价值投资角度讲,这无疑是正确的,但当时忽视了市场流动性较差,创业板的开创使得市场对中小市值的炒作力度也大幅超预期,等后来发现这一问题时,为时较晚;另外,在"国八条"出来后,市场短期内大幅下跌,操作上难度较大,也没有减仓充分,所以在前三季度,基金业绩不是很理想。到了第四季度,我们提前预判了"第四季度前半期配置以有色、煤炭资源股为主,后半期再回归到大消费类",在操作上,我们还同时兼顾了对整个2011年的行情研判并作一定程度的提前布局,第四季度这些操作的效果尚未充分体现,但在2011年到目前为止,效果较好,我们将不断总结经验、汲取教训,努力不断完善投研工作,取得更好的投资业绩、更好的为广大基金持有人服务。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

截至2010年12月31日,本基金份额净值为1.004元,本报告期份额净值增长率为-2.14%,同期比较基准的增长率为-5.83%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2011年,是中国经济全面步入新一轮经济繁荣的元年,这种繁荣更多的体现经济增长质量和行业分布广度上,而并不一定体现在速度上超预期。这种繁荣将带来两方面的影响,一是各行业的利润增速都比较可观,超预期和低于预期的幅度都较小;二是货币政策上将维持比较紧的状态,同时实体经济对流动性的吸纳能力也会逐步增强,故资本市场流动性偏紧。基于以上判断,我们认为2011年市场整体以窄幅波动为主,各个行业均有机会,上半年周期类股票机会较多,下半年则很有可能消费类会获得超额收益

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

4.6.1有关参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工

4.6.1.1 估值工作小组的职责分工

公司建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由运作保障部负责人、基金会计、投资管理部、中央交易室、监察稽核部人员组成。每个成员都可以指定一个临时或者长期的授权人员。

估值工作小组职责:

① 制定估值制度并在必要时修改;

② 确保估值方法符合现行法规;

③ 批准证券估值的步骤和方法;

④ 对异常情况做出决策。

运作保障部负责人是估值工作小组的组长,运作保障部负责人在基金会计或者其他两个估值小组成员的建议下,可以提议召集估值工作小组会议。

估值决策由估值工作小组2/3或以上多数票通过。

4.6.1.2 基金会计的职责分工

基金会计负责日常证券资产估值。基金会计和公司投资管理部相互独立。在按照本估值制度和相关法规估值后,基金会计定期将证券估值表向估值工作小组报告,至少每月一次。

基金会计职责:

① 获得独立、完整的证券价格信息;

② 每日证券估值;

③ 检查价格波动并进行一般准确性评估;

④ 向交易员或基金经理核实价格异常波动,并在必要时向估值工作小组报告;

⑤ 对每日证券价格信息和估值结果进行记录;

⑥ 对估值调整和人工估值进行记录;

⑦ 向估值工作小组报送月度估值报告。

基金会计认为必要,可以提议召开估值工作小组会议。

4.6.1.3 投资管理部的职责分工

① 接受监察稽核部对所投资证券价格异常波动的问讯;

② 对停牌证券、价格异常波动证券、退市证券提出估值建议;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告;

④ 向估值工作小组报告任何他/她认为可能的估值偏差。

4.6.1.4 中央交易室的职责分工

① 对基金会计的证券价格信息需求做出即时回应;

② 通知基金会计关于证券停牌、价格突发性异常波动、退市等特定信息;

③ 评价并确认基金会计提供的估值报告。

4.6.1.5监察稽核部的职责分工

① 监督证券的整个估值过程;

② 确保估值工作小组制定的估值政策得到遵守;

③ 确保公司的估值制度和方法符合现行法律、法规的要求;

④ 评价现行估值方法是否恰当反应证券公允价格的风险;

⑤ 对于估值表中价格异常波动的证券向投资部问讯;

⑥ 对于认为不合适或者不再合适的估值方法提交估值工作小组讨论。

4.7管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内,本基金未进行利润分配。

§ 5 托管人报告

5.1报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2010年,本基金托管人在对新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2托管人对报告期内本基金运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2010年,新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的管理人——新华基金管理有限公司在新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对新华基金管理有限公司编制和披露的新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金2010年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

二〇一一年三月二十三日

§ 6 审计报告

本报告期基金财务报告经国富浩华会计师事务所有限公司审计,注册会计师刁云涛、李荣坤签字出具了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正文。

§ 7 年度财务报表

7.1资产负债表

会计主体:新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日:2010年12月31日

单位:人民币元

资 产	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	219,652,637.35	217,194,149.31
结算备付金	3,867,385.32	139,739.06
存出保证金	1,721,960.57	1,744,180.89
交易性金融资产	895,828,570.43	1,638,122,519.11
其中:股票投资	770,790,570.43	1,460,278,683.11
基金投资	-	-
债券投资	125,038,000.00	177,843,836.00
资产支持证券投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	23,200,000.00	12,278,653.19
应收利息	2,032,156.64	3,414,167.67
应收股利	-	-
应收申购款	146,878.71	75,742.32
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,146,449,589.02	1,872,969,151.55
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	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	14,448,407.71	1,611,328.49
应付赎回款	1,255,558.28	4,691,162.17
应付管理人报酬	1,470,249.80	2,477,643.08
应付托管费	245,041.63	412,940.51
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	2,619,271.93	1,592,234.40
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	674,203.65	489,048.88
负债合计	20,712,733.00	11,274,357.53
所有者权益:		
实收基金	1,120,729,581.65	1,814,125,130.30
未分配利润	5,007,274.37	47,569,663.72
所有者权益合计	1,125,736,856.02	1,861,694,794.02
负债和所有者权益总计	1,146,449,589.02	1,872,969,151.55

注:1、报告截止日2010年12月31日,基金份额净值1.004元,基金份额总额1,120,729,581.65份。

7.2利润表

会计主体:新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010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7月13日(基金合同生效日)至2009年12月31日
一、收入	14,398,775.31	95,145,213.16
1.利息收入	11,850,722.88	4,830,746.38
其中:存款利息收入	1,038,029.44	2,078,665.25
债券利息收入	10,812,693.44	2,752,081.13
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	78,956,426.14	8,894,146.36
其中:股票投资收益	64,713,316.65	6,389,813.04
基金投资收益	-	-
债券投资收益	5,362,982.98	-
资产支持证券投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	8,880,126.51	2,504,333.32
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-77,239,838.05	79,613,570.07
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	831,464.34	1,806,750.35
减:二、费用	40,773,278.83	30,344,522.58
1.管理人报酬	22,385,483.00	18,601,321.98
2.托管费	3,730,913.78	3,100,220.32
3.销售服务费	-	-
4.交易费用	14,238,817.16	8,401,918.82
5.利息支出	1,093.18	-
其中:卖出回购金融资产支出	1,093.18	-
6.其他费用	416,971.71	241,061.46
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-26,374,503.52	64,800,690.58
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-26,374,503.52	64,800,690.58

7.3所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:新华泛资源优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2010年1月1日至2010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		
	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)	1,814,125,130.30	47,569,663.72	1,861,694,794.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-26,374,503.52	-26,374,503.52
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)	-693,395,548.65	-16,187,885.83	-709,583,434.48
其中:1.基金申购款	173,423,408.06	-3,579,722.13	169,843,685.93
2.基金赎回款	-866,818,956.71	-12,608,163.70	-879,427,120.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,120,729,581.65	5,007,274.37	1,125,736,856.02
项目	上年度可比期间 2009年7月13日(基金合同生效日)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)	3,132,175,900.10	-	3,132,175,900.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	64,800,690.58	64,800,690.58
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)	-1,318,050,769.80	-17,231,026.86	-1,335,281,796.66
其中:1.基金申购款	88,324,268.07	-2,572,911.85	85,751,356.22
2.基金赎回款	-1,406,375,037.87	-14,658,115.01	-1,421,033,152.88
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,814,125,130.30	47,569,663.72	1,861,694,794.02

报告附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人:陈重,主管会计工作负责人:孙枝来,会计机构负责人:徐端骞

7.4报表附注

7.4.1报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2差错更正的说明

本基金报告期未发生差错更正。

7..4.3税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2004〕78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税〔2005〕11号文《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税〔2005〕102号文《关于股息红利个人所得税有关政策的通知》、财税〔2005〕103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税字〔2005〕107号文《关于利息红利个人所得税政策的补充通知》、自2008年4月24日起执行的《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》及其他相关税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)以发行基金方式募集资金,不属于营业税征收范围,不征收营业税。

(2)基金买卖股票、债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税,暂不征收企业所得税。对基金取得的股票的股息、红利收入,由上市公司在向基金派发股息、红利时暂减按50%计入个人应纳税所得额,依照现行税法规定代扣代缴个人所得税,暂不征收企业所得税。

(4)基金买卖股票于2008年4月24日前按照0.3%的税率缴纳股票交易印花税,自2008年4月24日起按0.1%的税率缴纳。经国务院批准,财政部、国家税务总局决定从2008年9月19日起,调整证券(股票)交易印花税征收方式,将现行的对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据按0.1%的税率对双方当事人征收证券(股票)交易印花税,调整为单边征税,即对买卖、继承、赠与所书立的A股、B股股权转让书据的出让按0.1%的税率征收证券(股票)交易印花税,对受让方不再征税。

(5)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价,暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

7.4.4关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
新华基金管理有限公司	基金管理人、基金发起人
新华信托股份有限公司	基金管理人股东
山东海化集团有限公司	基金管理人股东
上海大众环境产业有限公司	基金管理人股东
陕西蓝潼电子投资有限公司	基金管理人股东

注:2010年7月12日经中国证券监督管理委员会证监许可〔2010〕940号文件批复,山东海化集团有限公司将所持的公司30%股权全部转让给陕西蓝潼电子投资有限公司,同时批复股东上海隽基环境产业有限公司更名为上海大众环境产业有限公司。

7.4.5本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.5.1.1股票交易

本基金本报告期,均无通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.5.1.2权证交易

本基金本报告期,均无通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.5.1.3债券交易

本基金本报告期,均无通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.5.1.4债券回购交易

本基金本报告期,均无通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.5.2关联方报酬

7.4.5.2.1基金管理费

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7月13日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	22,385,483.00	18,601,321.98
其中:支付销售机构的客户维护费	7,684,988.72	11,035,007.16

注:基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.5%的年费率逐日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5%/当年天数

7.4.5.2.2基金托管费

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7月13日(基金合同生效日)至2009年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,730,913.78	3,100,220.32

注:基金托管费按前一日的基金资产净值0.25%的年费率逐日计提确认。

其计算公式为:日托管人报酬=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

7.4.5.3与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期未进行银行债券(含回购)交易。

7.4.5.4各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.5.4.2报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

报告期内,除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.5.5由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日		上年度可比期间 2009年7月13日(基金合同生效日)至2009年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	219,652,637.35	995,475.95	217,194,149.31	2,045,707.34

7.4.5.6本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在报告期内未参与关联方承销证券。

7.4.6期末(2010年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.6.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300146	汤臣倍健	2010-12-08	2011-03-15	网下认购新股	110.00	150.00	270,000	29,700,000.00	40,500,000.00	-
300135	宝利沥青	2010-10-14	2011-01-26	网下认购新股	36.46	45.84	148,698	5,421,529.08	6,816,316.32	-
601126	四方股份	2010-12-28	2011-03-31	网下认购新股	23.00	31.11	10,793	248,239.00	335,770.23	-
002488	金固股份	2010-10-13	2011-01-21	网下认购新股	22.00	24.41	49,200	1,082,400.00	1,200,972.00	-

7.4.6.1.2 受限证券类别:债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123001	09爱使债	2009-11-18	-	网下认购	100.00	100.00	200,000	20,000,000.00	20,000,000.00	具体上市时间尚未公告

7.4.6.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000413	宝石A	2010-12-27	拟改制重组	14.06	2011-01-06	15.40	1,804,081	21,945,559.91	25,365,378.86	-
000903	云内动力	2010-12-08	因媒体报道公司未经披露的重大事项	17.60	2011-01-07	18.80	1,160,354	18,403,254.47	20,422,230.40	-
000959	首钢股份	2010-10-29	筹划重大资产重组	4.42	-	-	2,800,000	12,485,271.65	12,376,000.00	具体复牌时间尚未公告
002430	杭氧股份	2010-12-31	临时股东大会	34.80	2011-01-04	35.55	300,395	8,279,716.41	10,453,746.00	-

7.4.6.3期末债券正回购交易中作为抵押的债券7.4.6.3.1银行间市场债券正回购

本基金本报告期未无银行间市场债券正回购。

7.4.6.3.2交易所市场债券正回购

本基金本报告期内未发生交易所市场债券正回购。

§ 8投资组合报告

8.1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	770,790,570.43	67.23
	其中:股票	770,790,570.43	67.23
2	固定收益投资	125,038,000.00	10.91
	其中:债券	125,038,000.00	10.91
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
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	223,520,022.67	19.50
6	其他各项资产	27,100,995.92	2.36
7	合计	1,146,449,589.02	100.00

8.2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	21,255,617.65	1.89
B	采掘业	-	-
C	制造业	388,121,607.26	34.48
C0	食品、饮料	120,872,700.02	10.74
C1	纺织、服装、皮毛	1,299,960.00	0.12
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	36,881,290.96	3.28
C4	石油、化学、塑胶、塑料	22,953,037.59	2.04
C5	电子	25,365,378.86	2.25
C6	金属、非金属	30,609,200.00	2.72
C7	机械、设备、仪表	67,207,533.95	5.97
C8	医药、生物制品	82,932,505.88	7.37
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	35,666,386.55	3.17
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	61,649,730.82	5.48
H	批发和零售贸易	35,113,395.16	3.12
I	金融、保险业	207,498,966.91	18.43
J	房地产业	15,161,435.40	1.35
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	6,323,430.68	0.56
M	综合类	-	-
	合计	770,790,570.43	68.47

8.3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

序号	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	4,099,951	52,520,372.31	4.67
2	600887	伊利股份	1,192,977	45,643,300.02	4.05
3	601318	中国平安	775,451	43,549,328.16	3.87
4	300006	莱美药业	1,159,872	42,544,104.96	3.78
5	300146	汤臣倍健	270,000	40,500,000.00	3.60
6	000602	金马集团	1,160,752	38,072,665.60	3.38
7	600187	国中水务	2,964,734	36,881,290.96	3.28
8	000001	深发展A	2,272,148	35,877,216.92	3.19
9	000712	锦龙股份	2,043,919	35,666,386.55	3.17
10	600519	贵州茅台	170,000	31,266,400.00	2.78

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读刊登于http://www.ncfund.com.cn网站的年度报告正文。

8.4报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	105,191,097.48	5.65
2	000001	深发展A	104,959,903.80	5.64
3	601088	中国神华	98,202,913.42	5.27
4	601601	中国太保	96,908,660.53	5.21
5	601166	兴业银行	88,309,626.04	4.74
6	000712	锦龙股份	78,036,437.53	4.19
7	600000	浦发银行	71,368,568.74	3.83
8	600028	中国石化	68,113,327.41	3.66
9	600050	中国联通	63,424,308.39	3.41
10	600510	黑牡丹	62,734,224.84	3.37
11	600887	伊利股份	60,909,681.34	3.27
12	601169	北京银行	57,687,201.96	3.10
13	600016	民生银行	52,141,261.03	2.80
14	600467	好当家	45,006,197.95	2.42
15	601318	中国平安	44,612,595.93	2.40
16	300006	莱美药业	43,595,793.69	2.34
17	600519	贵州茅台	42,501,985.38	2.28
18	000413	宝 石A	42,198,082.04	2.27