天治核心成长股票型证券投资基金 2006年年度报告摘要

基金管理人:天治基金管理有限公司　　基金托管人:交通银行股份有限公司

重要提示

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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2007年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

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。

一、基金简介

(一)基金基本资料

基金简称:天治核心

交易代码:163503

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2006年1月20日

报告期末基金份额总额:80,765,647.10份

基金合同存续期:不定期

(二)基金产品说明

基金投资目标:通过将部分资产投资于品质优良、成长潜力高于平均水平的中小型上市公司股票,并将部分资产用于复制大型上市公司股票指数(新华富时中国A200指数)的业绩表现,在控制相对市场风险的前提下,追求中长期的资本增值。

基金投资策略:本基金以股票品种为主要投资标的,以"核心－卫星"策略作为股票投资的总体策略。"核心－卫星"策略是指将股票资产分为核心组合和卫星组合,核心组合通过跟踪指数进行被动投资,控制投资组合相对于市场的风险;卫星组合通过优选股票进行主动投资,追求超越市场平均水平的收益。本基金的核心组合用于跟踪大型公司股票指数(新华富时中国A200指数),卫星组合用于优选中小型成长公司股票。

业绩比较基准:新华富时中国A全指×75%＋新华富时中国国债指数×25%

风险收益特征:本基金为具有中等风险、中高收益的股票型基金,风险收益特征介于大盘平衡型基金和小盘成长型基金之间。

(三)基金管理人

名　称:天治基金管理有限公司

信息披露负责人:张丽红

联系电话:021－64371155

传　真:021－64713618

电子信箱:zhanglh@chinanature.com.cn

(四)基金托管人

名　称:交通银行股份有限公司

信息披露负责人:张咏东

联系电话:021－68888917

传　真:021－58408836

电子信箱:zhangyd@bankcomm.com

(五)本年度报告的披露

登载年度报告正文的基金管理人网址:www.chinanature.com.cn

本基金年度报告的置备地点:基金管理人及基金托管人的办公场所

二、主要财务指标、基金净值表现及收益分配情况

(一)主要财务指标

主要财务指标	2006年1月20日(基金合同生效日)日至12月31日
基金本期净收益	52,806,440.66元
基金份额本期净收益	0.4098元
期末可供分配基金收益	8,445,235.45元
期末可供分配基金份额收益	0.1046元
期末基金资产净值	91,955,693.23元
期末基金份额净值	1.1385元
基金加权平均净值收益率	36.62%
本期基金份额净值增长率	75.78%
基金份额累计净值增长率	75.78%

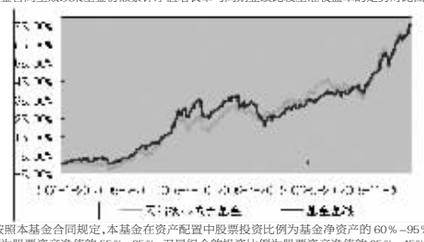
上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(二)基金净值表现

1、　基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率比较表

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)
过去三个月	22.48%	1.55%	25.98%	1.03%	－3.50%	0.52%
过去六个月	36.84%	1.38%	28.51%	1.05%	8.33%	0.33%
自基金合同生效起至今	75.78%	1.32%	75.76%	1.07%	0.02%	0.25%

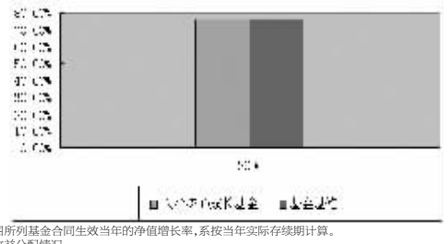
2、自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的走势对比图



注1:按照本基金合同规定,本基金在资产配置中股票投资比例为基金净资产的60%－95%,其中,核心组合的投资比例为股票资产净值的55%－65%,卫星组合的投资比例为股票资产净值的35%－45%;债券投资比例为基金净资产的0%－40%,现金以及到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具不低于基金净资产的5%。本基金应自2006年1月20日基金合同生效日起六个月内,达到本基金合同第17条规定的投资比例限制。截至本报告期末,本基金符合上述要求。

注2:自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年。

3、自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准历年收益率的对比



注:本图所列基金合同生效当年的净值增长率,系按当年实际存续期计算。

(三)收益分配情况

年度	每10份基金份额分红数(元)	备注
2006年1月20日至12月31日	5.600	2006年共分配二次
合计	5.600	

三、管理人报告

(一)基金管理人及基金经理情况

1、本基金管理人——天治基金管理有限公司于2003年5月成立,注册资本1亿元,注册地为上海。公司由吉林省信托投资有限责任公司、中国吉林森林工业(集团)总公司、吉林省汉维实业有限公司、吉林市国有资产经营有限公司四家股东共同出资发起设立,各股东出资比例分别为40%、20%、20%、20%。本基金管理人旗下共有四只开放式基金,除本基金外,另外三只基金—天治财富增长证券投资基金、天治品质优选混合型证券投资基金、天治天得利货币市场基金的基金合同分别于2004年6月29日、2005年1月12日、2006年7月5日生效。

2、基金经理简介

余明元先生:经济学博士,证券、基金从业经验6年。曾任职于国元证券研发中心、投资部,期间主要从事证券分析、研究和投资管理等工作。2003年2月起就职于天治基金管理有限公司投资管理部。

吴鹏先生:经济学硕士,证券、基金从业经验6年。历任东北证券有限责任公司研究员、投资经理,亚洲证券有限责任公司研究员,湘财证券有限责任公司资深研究员,天治基金管理有限公司研究发展部研究员、天治核心成长股票型证券投资基金基金经理助理。现任天治基金管理有限公司研究发展部副总监兼天治核心成长股票型证券投资基金基金经理。

(二)报告期内基金运作的遵规守信情况说明

在本报告期内,本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《天治核心成长股票型证券投资基金基金合同》的约定,本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产,为基金份额持有人谋求利益。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

(三)报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2006年国内经济继续强劲增长,投资、消费和出口需求继续保持强劲,从而拉动整个实体经济继续加速增长,通货膨胀水平仍然相对较低。在国内经济持续增长、人民币升值的大背景下,加上全球多年的低利率环境和流动性过剩,海外资本正通过各种渠道进入中国,市场资金充裕。

中国证券市场在经历了多年的低迷之后,以股权分置改革为契机,市场各方面都发生了巨变,开始了一轮牛市。全流通问题的解决为市场奠定了坚实基础,使大股东和流通股股东的利益得到了相对统一,也使市场的估值水平迅速与国际接轨。股权分置改革的巨大成功将在中国证券史上写下浓重的一笔。

本基金因预计到2006年市场会持续走牛,因此操作上针对牛市的特点及时调整了持仓结构,保持了股票仓位的较高水平,减少防御型品种,增加持有进攻型品种。我们坚持"好行业好公司"的投资策略,在2006年行业配置上我们依然选择金融(尤其是证券股)、地产、钢铁、机械装备、能源、食品饮料、商业零售等几个行业的优质股进行重点投资。

业绩表现方面,2006年本基金的基金份额净值增长率为75.78%,同期业绩比较基准收益率为75.76%。本基金在本报告期有6个月建仓期的前提下业绩表现略高于同期业绩比较基准,并在当年基金合同生效的基金中投资业绩排名前列。

(四)2007年宏观经济和证券市场展望

2007年以来的经济数据显示,国内经济仍然延续比较良好的态势,企业利润温和回升的趋势显著,权威机构预测未来10年中国经济增长年均8%以上,未来10－20年是中国经济发展的黄金时期,反映在股市上一定是中长期牛市。尽管由于宏观调控,投资增长有所回落,但投资还会继续维持高水平增长,公用事业、铁路等国家鼓励投资的行业投资增长率基本稳定,房地产、电力等支柱产业投资略有增长。从趋势上看,消费对经济增长的贡献将继续提高,对外贸易有望保持稍高于20%的速度增长。"十一五规划"纲要反映了中国的中期政策目标,新的规划更加注重增长的质量和效率,对农村建设和创建和谐社会给予了高度的关注。

宏观经济的良好预期为证券市场走好奠定了基础。优质上市公司受益于经济增长的持续性,业绩也将持续增长。证券市场制度建设和完善提升了市场的可参与度。流动性充裕是推动证券市场走好的重要外部因素。人民币升值加剧了流动性的扩张,流动性充裕带来了资产估值水平的提升。

展望2007年A股市场,我们依然积极和乐观。人民币长期升值、资源价格重估、消费升级、国家提倡的自主创新和"十一五规划"中大力支持、优先发展产业依然应该是我们2007年的投资主题。

从行业配置层面来说,消费服务业和优势制造业依然是我们需要看重配置的行业。我们重点看好受益于人民币长期升值的房地产和金融行业;看好受益于居民收入增长和消费升级的商业贸易、食品饮料、旅游、医药和传媒行业;看好受益于"十一五规划"的铁路运输装备、输变电设备以及3G通讯设备行业;关注在国际市场上具有一定自主创新能力和国际竞争力的工程机械、机床、重卡、客车和化工新材料行业。

四、托管人报告

2006年,交通银行在天治核心成长股票型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议,依法安全保管了基金资产,勤勉尽责地履行了基金托管人的义务,不存在损害基金持有人利益的行为。

2006年,按照《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、基金托管协议,本托管人对基金管理人——天治基金管理有限公司在天治核心成长股票型证券投资基金投资运作方面进行了监督,对基金资产净值、基金份额净值和费用计算上进行了认真复核,未发现基金管理人有损害基金持有人利益的行为。

2006年,由天治核心成长股票型证券投资基金管理人——天治基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天治核心成长股票型证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

交通银行股份有限公司资产托管部

2007年3月20日

五、审计报告

本基金的审计机构安永大华会计师事务所有限责任公司审计了天治核心成长股票型证券投资基金2006年12月31日的资产负债表和2006年1月20日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间的经营业绩表、基金净值变动表及基金收益分配表以及财务报表附注,认为上述财务报表已经按照企业会计准则、《金融企业会计制度》和《证券投资基金会计核算办法》的规定编制,在所有重大方面公允反映了天治核心成长股票型证券投资基金2006年12月31日的财务状况以及2006年1月20日(基金合同生效日)至2006年12月31日止期间的经营成果、净值变动及收益分配情况。注册会计师出具了安永大华业字(2007)第054号无保留意见的审计报告。

六、财务会计报告

(一)年度会计报表

天治核心成长股票型证券投资基金资产负债表

(单位:元)

项目	2006年12月31日
资产:	
银行存款	494,729.722
清算备付金	9,880,395.577
交易保证金	750,000.000
应收证券清算款	0.000
应收股利	0.00
应收利息	4,020.233
应收申购款	2,189,904.955
其他应收款	0.00
股票投资市值	80,088,382.699
其中:股票投资成本	70,711,902.622
债券投资市值	0.00
其中:债券投资成本	0.00
权证投资	0.00
其中:权证投资成本	0.00
买入返售证券	0.00
待摊费用	186,528.21
其他资产	0.00
资产总计	93,593,961.37
负债:	
应付证券清算款	0.00
应付赎回款	430,469.988
应付赎回费	1,622.399
应付管理人报酬	74,285.533
应付托管费	15,476.155
应付佣金	286,414.099
应付利息	0.00
应付收益	0.00
其他应付款	750,000.00
预提费用	80,000.00
其他负债	0.00
负债合计	1,638,268.14
持有人权益:	
实收基金	80,765,647.100
未实现利得	2,744,810.688
未分配收益	8,445,235.455
持有人权益合计	91,955,693.233
负债及持有人权益总计	93,593,961.37

天治核心成长股票型证券投资基金经营业绩表及收益分配表

(单位:元)

项目	2006年1月20日－2006年12月31日
一、收入	55,292,575.65
1、股票差价收入	52,398,408.199
2、债券差价收入	－274,085.699
3、权证差价收入	113,641.199
4、债券利息收入	438,921.788
5、存款利息收入	432,633.688
6、股利收入	1,547,249.433
7、买入返售证券收入	174,103.000
8、其他收入	461,704.077
二、费用	2,486,134.99
1、基金管理人报酬	1,674,751.000
2、基金托管费	348,906.458
3、利息支出	0.001
4、卖出回购证券支出	5,993.81
5、其他费用	456,483.70
其中:信息披露费	353,471.79
审计费用	80,000.00
三、基金净收益	52,806,440.66
加:未实现利得	9,376,480.07
四、基金经营业绩	62,182,920.73
本期基金净收益	52,806,440.66
加:期初基金净收益	0.00
加:本期损益平准金	－16,021,872.58
可供分配基金净收益	36,784,568.08
减:本期已分配基金净收益	28,339,332.63
期末基金净收益	8,445,235.45

天治核心成长股票型证券投资基金基金净值变动表

(单位:元)

项　目	2006年1月20日－2006年12月31日
一、期初基金净值	313,493,538.86
二、本期经营活动:	
基金净收益	52,806,440.66
未实现利得	9,376,480.07
经营活动产生的基金净值变动数	62,182,920.73
三、本期基金单位交易:	
基金申购款	113,896,996.60
基金赎回款	－369,278,430.33
基金单位交易产生的基金净值变动数	－255,381,433.73
四、本期间持有人分配收益:	
向基金持有人分配收益产生的基金净值变动数	－28,339,332.63
五、期末基金净值	91,955,693.23

(二)年度会计报表附注

1、主要会计政策、会计估计及其变更

1.1 编制基金会计报表所遵循的主要会计制度及其他有关规定

本基金的会计报表按照中华人民共和国财政部发布的《企业会计准则》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号》(年度报告的内容与格式)、《证券投资基金信息披露编报规则》及中国证券监督管理委员会允许的如主要会计政策所述的基金行业的实务操作约定而编制。

1.2 会计年度

为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表的实际编制期间为2006年1月20日(基金合同生效日)至2006年12月31日。

1.3 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

1.4 记账基础和计价原则

本基金的会计核算以权责发生制为记账基础,除股票投资、交易所上市债券投资、上市权证投资按市值计价以及未上市权证按公允价值计价外,其余报表项目均以历史成本计价。

1.5 基金资产的估值原则

——上市股票,按其估值日在证券交易所的收盘价估值;估值日无交易的,以最近一个交易日的收盘价估值。

——未上市股票的估值:送股、转增股、配股和增发新股,按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的收盘价估值;首次发行的股票,按成本价估值。

——上市流通的权证,按估值日该权证在证券交易所的收盘价估值;该日无交易的权证,以最近一个交易日的收盘价估值。

——未上市流通的权证,在综合考虑了市场情况、标的股票价格、行权价格、剩余期限、市场无风险利率、标的证券价格波动等因素下,按照最能反映权证公允价值的价格估值。

——配股权证,从配股除权日起到配股确认日止,若收盘价高于配股价,则按收盘价和配股价的差额进行估值;若收盘价等于或低于配股价,则估值为零。

——证券交易所市场实行净价交易的债券,按估值日收盘价估值;估值日没有交易的,按最近交易日的收盘价估值。

——证券交易所市场未实行净价交易的债券,按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值;估值日没有交易的,按最近交易日债券收盘价计算得到的净价估值。

——未上市债券和在银行间同业市场交易的债券,按成本价估值。

——如有确凿证据表明按上述方法对基金进行估值不能客观反映其公允价值,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映基金资产公允价值的方法估值。

——如有新增事项或变更事项,按国家最新规定估值。

1.6 证券投资的成本计价方法

——股票投资

买入股票于成交日确认为股票投资,股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账;因股权分置改革而获得非流通股股东支付的现金对价,于股权分置改革方案实施后的股票复牌日,冲减股票投资成本。

卖出股票于成交日确认股票差价收入,出售股票的成本按移动加权平均法于成交日结转。

——债券投资

买入证券交易所交易的债券于成交日确认为债券投资;买入银行间同业市场交易的债券差价收入于实际收到全部价款时确认。债券差价收入按应收取全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额确认。

——债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提。

——存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示。

——权证差价收入于卖出权证成交日确认,并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账。

——股利收入按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额于除息日确认。

——买入返售证券收入按融出资金额及约定利率,在返售期限内采用直线法逐日计提。

——其他收入于实际收到款项时确认。

1.9 费用的确认和计量

1.9.1 基金管理人报酬:根据《天治核心成长股票型证券投资基金基金合同》的规定,基金管理人报酬按前一日基金资产净值1.2%的年费率逐日计提。

1.9.2 基金托管费:根据《天治核心成长股票型证券投资基金基金合同》的规定,基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率逐日计提。

1.9.3 卖出回购证券支出:卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率,在回购期限内采用直线法逐日计提。

1.9.4 证券交易费用

1.9.5 基金信息披露费用

1.9.6 基金份额持有人大会费用

1.9.7 与基金相关的会计师费律师费

1.9.8 基金上市的费用

1.9.9 按照国家有关规定可以列入的其他费用

上述1.9.4至1.9.9项费用由基金管理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。如果影响基金份额净值小数点后第五位的,则采用待摊或预提的方法。根据《天治核心成长股票型证券投资基金基金合同生效公告》的约定,本基金发行中所发生的律师费、会计师费及法定信息披露费等费用从基金发行费用中列支,即由本基金管理人天治基金管理有限公司承担,而不另从基金资产支付。

1.10 基金的收益分配政策

①每一基金份额享有同等分配权;

②基金收益分配比例按有关规定制定,年度收益分配比例不低于基金年度已实现收益的50%;

③基金投资当期亏损,则不进行收益分配;

④基金当年收益应先弥补以前年度亏损后,才可进行当年收益分配;

⑤基金收益分配后基金份额净值不能低于面值;

⑥基金份额登记在注册登记系统的投资者可以选择现金分红或红利再投资;基金份额登记在证券登记结算系统的投资者只能选择现金分红;本基金分红的默认方式为现金分红;投资人选择红利再投资时,分配的基金收益以权益登记日的基金份额净值为基准自动转换为基金份额进行再投资;

⑦基金收益每年最多分配6次,但若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配;

⑧法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

2、关联方关系及关联方交易

2.1 关联方关系

关联方名称	与本基金关系
天治基金管理有限公司	基金管理人、销售机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
吉林省信托投资有限责任公司	基金管理人的股东
中国吉林森林工业(集团)总公司	基金管理人的股东
吉林省汉维实业有限公司	基金管理人的股东
吉林市国有资产经营有限公司	基金管理人的股东

2.2 关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.2.1 本基金在会计期间未通过关联方席位进行交易。

2.2.2 基金管理人报酬

基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计算。计算方法如下:

H＝E×1.2%÷当年天数;

H为每日应计提的基金管理费;

E为前一日基金资产净值

本基金在会计期间需支付基金管理费1,674,751.00元,每日计提并于下月的2个工作日内支付,至2006年12月31日已支付1,600,465.47元,尚有余款74,285.53元未付。

2.2.3 基金托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计算。计算方法如下:

H＝E×0.25%÷当年天数;

H为每日应计提的基金托管费;

E为前一日基金资产净值

本基金在会计期间需支付基金托管费348,906.48元,每日计提并于下月的2个工作日内支付,至2006年12月31日已支付333,430.33元,尚有余款15,476.15元未付。

2.2.4 本基金在会计期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

2.2.5 基金管理公司、基金主要股东及其控制机构在2006年未持有本基金。

2.2.6 由关联方保管的银行存款余额及由此产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人交通银行股份有限公司保管,并按银行间同业利率计息。基金托管人于2006年12月31日保管的银行存款余额为494,729.72元。本报告期由基金托管人保管的银行存款产生的利息收入为61,469.75元。

3、报告期未流通转让受到限制的基金资产

本基金截至2006年12月31日止因新股中签原因而流通受限制的资产情况如下(具体流通日期以公司公告为准):

资产名称	数量(股)	总成本(元)	总市值(元)	估值方法	转让受限原因	流通日期
大秦铁路	70,840	350,658.00	573,804.00	市值	网下中签新股未上市	2007/02/01
北辰实业	21,570	51,768.00	144,087.60	市值	网下中签新股未上市	2007/01/16
中国银行	47,157	145,243.56	256,062.51	市值	网下中签新股未上市	2007/01/05
东源电器	4,419	34,821.72	62,352.09	市值	网下中签新股未上市	2007/01/18
雪莱特	3,130	21,471.80	58,750.10	市值	网下中签新股未上市	2007/01/25
中材科技	1,996	17,924.08	38,722.40	市值	网下中签新股未上市	2007/02/26
合计	149,112	621,887.16	1,133,778.70			

七、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合:

资产项目	市值(元)	占总资产比例
股票	80,088,382.69	85.57%
债券	0.00	0.00%
权证	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金	10,375,125.23	11.09%
其他资产	3,130,453.39	3.34%
合计	93,593,961.37	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合:

行业分类	市值(元)	市值占净值比例
A农、林、牧、渔业	235,931.32	0.26%
B采掘业	4,104,000.00	4.46%
C制造业	36,587,881.07	39.78%
C0食品、饮料	8,417,100.00	9.15%
C1纺织、服装、皮毛	12,990.00	0.01%
C2木材、家具	0.00	0.00%
C3造纸、印刷	0.00	0.00%
C4石油、化学、塑胶、塑料	0.00	0.00%
C5电子	1,973,250.10	2.15%
C6金属、非金属	15,633,788.88	17.00%
C7机械、设备、仪表	2,599,852.09	2.83%
C8医药、生物制品	4,197,300.00	4.56%
C99其他制造业	3,753,600.00	4.08%
D电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E建筑业	0.00	0.00%
F交通运输、仓储业	639,900.00	0.70%
G信息技术业	5,313,003.43	5.78%
H批发和零售贸易	2,086,690.00	2.27%
I金融、保险业	14,512,200.00	15.78%
J房地产业	13,482,776.87	14.66%
K社会服务业	1,024,800.00	1.11%
L传播与文化产业	2,101,200.00	2.29%
M综合类	0.00	0.00%
合计	80,088,382.69	87.09%

(三)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细:

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	市值占净值比例
1	600005	武钢股份	789,968	5,024,196.48	5.46%
2	600016	民生银行	484,000	4,936,800.00	5.37%
3	000858	五粮液	206,000	4,707,100.00	5.12%
4	600028	中国石化	450,000	4,104,000.00	4.46%
5	000969	安泰科技	345,000	3,753,600.00	4.08%
6	600837	伊利股份	140,000	3,710,000.00	4.03%
7	000002	万科A	240,000	3,705,600.00	4.03%
8	600456	宝钛股份	115,000	3,565,000.00	3.88%
9	601398	工商银行	550,000	3,410,000.00	3.71%
10	000402	金融街	200,000	3,370,000.00	3.66%

投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.chinanature.com.cn上的年度报告正文。

(四)报告期内股票投资组合的重大变动:

1、累计买入价值超出期末基金资产净值2%的股票明细:

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额(元)	占期末基金资产净值比
1	600016	民生银行	57,884,317.29	62.95%
2	600028	中国石化	31,463,939.37	34.22%
3	000063	中兴通讯	28,298,661.14	30.77%
4	600410	华胜天成	26,433,950.69	28.75%
5	600183	生益科技	25,053,829.99	27.25%
6	600036	招商银行	23,626,071.54	25.69%
7	600636	三爱富	21,263,176.79	23.12%
8	600299	星新材料	20,301,701.22	22.08%
9	600832	东方明珠	19,778,987.35	21.51%
10	600037	歌华有线	18,317,005.09	19.92%
11	600015	华夏银行	17,566,765.41	19.10%
12	000002	万科A	17,138,387.82	18.64%
13	000400	许继电气	16,576,577.30	18.03%
14	600581	八一钢铁	16,339,387.56	17.77%
15	600736	苏州高新	16,030,862.25	17.43%
16	002025	航天电器	15,786,293.78	17.17%
17	000858	五粮液	15,332,384.38	16.67%
18	600383	金地集团	15,134,853.75	16.46%
19	600005	武钢股份	14,696,809.54	15.98%
20	600033	福建高速	13,738,966.45	14.94%
21	600030	中信证券	12,945,615.41	14.08%
22	000402	金融街	12,221,447.62	13.29%
23	000410	沈阳机床	12,136,075.63	13.20%
24	600489	中金黄金	11,346,838.93	12.34%
25	600597	光明乳业	10,738,746.96	11.68%
26	000900	现代投资	10,444,282.31	11.36%
27	600362	江西铜业	10,390,595.17	11.30%
28	600900	长江电力	9,022,435.20	9.81%
29	600879	火箭股份	8,995,289.97	9.78%
30	600836	国投电力	8,891,095.35	9.67%
31	600205	S山东铝	8,862,120.75	9.64%
32	000089	深圳机场	8,822,633.46	9.59%
33	600416	湘电股份	8,647,987.55	9.40%
34	600710	常林股份	8,420,841.70	9.16%
35	600309	烟台万华	8,197,515.90	8.91%
36	600104	上海汽车	8,013,399.94	8.71%
37	600456	宝钛股份	7,999,295.27	8.70%
38	600269	赣粤高速	7,610,439.09	8.28%
39	601398	工商银行	7,233,536.96	7.87%
40	600585	海螺水泥	7,172,971.43	7.80%
41	600631	百联股份	7,026,917.65	7.64%
42	600580	卧龙电气	6,578,416.81	7.15%
43	600067	冠城大通	6,417,448.36	6.98%
44	600694	大商股份	6,273,631.45	6.82%
45	600331	宏达股份	6,265,386.56	6.81%
46	000928	*ST吉炭	6,062,152.10	6.59%
47	600887	伊利股份	5,933,773.67	6.45%
48	600598	北大荒	5,893,204.05	6.41%
49	600089	特变电工	5,823,806.20	6.33%
50	600795	国电电力	5,793,272.53	6.30%
51	000822	山东海化	5,769,043.53	6.27%
52	600777	新潮实业	5,738,667.98	6.24%
53	000157	中联重科	5,721,273.72	6.22%
54	002038	双鹭药业	5,714,849.53	6.21%
55	000619	海螺型材	5,617,485.48	6.11%
56	600348	国阳新能	5,566,438.23	6.05%
57	000024	招商地产	5,532,938.30	6.02%
58	000680	山推股份	5,470,326.02	5.95%
59	600050	中国联通	5,126,888.64	5.58%
60	000060	中金岭南	4,954,287.13	5.39%
61	600330	天通股份	4,949,119.39	5.38%
62	000758	中色股份	4,884,721.03	5.31%
63	601006	大秦铁路	4,734,175.05	5.15%
64	000686	S锦六陆	4,644,448.68	5.05%
65	600806	S交科技	4,601,717.23	5.00%
66	000012	南玻A	4,598,657.61	5.00%
67	000069	华侨城A	4,564,239.36	4.96%
68	000612	焦作万方	4,562,438.72	4.96%
69	600511	国药股份	4,377,700.23	4.76%
70	601988	中国银行	4,268,418.58	4.64%
71	000951	中国重汽	4,170,929.88	4.54%
72	600378	天科股份	4,113,247.18	4.47%
73	600019	宝钢股份	4,097,076.68	4.46%
74	600296	S兰铝	4,045,519.03	4.40%
75	000910	大亚科技	4,020,109.25	4.37%
76	000969	安泰科技	3,996,882.36	4.35%
77	600360	华微电子	3,949,926.54	4.30%
78	600198	大唐电信	3,857,130.52	4.19%
79	600888	新疆众和	3,832,299.25	4.17%
80	600468	百利电气	3,785,793.41	4.12%
81	600595	中孚实业	3,701,773.04	4.03%
82	002024	苏宁电器	3,491,342.79	3.80%
83	000930	丰原生化	3,463,523.37	3.77%
84	600596	新安股份	3,406,193.71	3.70%
85	000569	长城股份	3,343,403.63	3.64%
86	600064	南京高科	3,331,122.73	3.62%
87	600123	兰花科创	3,296,140.92	3.58%
88	600219	南山铝业	3,295,552.51	3.58%
89	600835	上海机电	3,190,298.23	3.47%
90	000709	唐钢股份	3,086,879.11	3.36%
91	600418	江淮汽车	2,996,737.96	3.26%
92	600487	亨通光电	2,992,671.66	3.25%
93	600312	平高电气	2,974,756.62	3.23%
94	002037	久联发展	2,835,993.42	3.08%
95	000987	广州友谊	2,830,067.50	3.08%
96	600138	中青旅	2,823,127.16	3.07%
97	600012	皖通高速	2,800,840.01	3.05%
98	600497	驰宏锌锗	2,798,336.04	3.04%
99	600881	亚泰集团	2,775,323.87	3.02%
100	600260	凯乐科技	2,676,374.89	2.91%
101	000970	中科三环	2,655,962.16	2.89%
102	600010	包钢股份	2,649,235.64	2.88%
103	000617	S济柴	2,607,293.20	2.84%
104	000027	深能源A	2,513,416.81	2.73%
105	000983	西山煤电	2,397,042.62	2.61%
106	000629	新钢钒	2,391,311.85	2.60%
107	000616	亿城股份	2,384,202.06	2.59%
108	002022	科华生物	2,366,731.73	2.57%
109	002008	大族激光	2,362,715.98	2.57%
110	600117	西宁特钢	2,358,