

(上接D6)

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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	09001042	09央行票据42	1,400,000	137,676,000.00	1.71
2	09001046	09央行票据46	1,200,000	117,996,000.00	1.46
3	09001030	09央行票据30	1,000,000	98,400,000.00	1.22
4	07101085	07央行票据85	440,000	44,343,200.00	0.55
5	09001048	09央行票据48	200,000	19,662,000.00	0.24

6.本基金未公告的未持续支付的待摊费用。

7.基金合同终止权。

8.投资组合报告附注。

①报告期内本基金的前10名持有人的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名发行的证券未出现因涉嫌违法违规、被立案侦查或强制退市的公司。

报告期内本基金投资的前10名持有人之二:五粮液(代码:000888)。于2009年9月9日公告,因公司涉嫌违反证券法规定,证监会决定立案调查。

本基金基金管理人对证券投资实行集中管理,并根据法律法规的规定将基金投资的严格限制贯穿于投资决策、流程控制和交易执行等各个环节,严格执行公司内部制度,并定期向监管部门报告,在上述事件发生时及时对其对基金财产的影响进行分析,并根据基金财产状况、经营成果和现金流量产生重大的实质性影响,所以不影响对本基金公司和公司的投资判断。

C.本基金投资的前十名股东中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

D.其他产品构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,390,543.42
2	应收证券清算款	7,251,832.20
3	应收利息	-
4	应收股利	4,805,524.84
5	应收申购款	5,257,230.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	21,705,131.06

D.本基金报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

E.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

F.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

G.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

H.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

I.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

J.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

K.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

L.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

M.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

N.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

O.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

P.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

Q.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

R.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

S.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

T.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

U.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

V.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

W.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

X.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

Y.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

Z.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

AA.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

BB.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

CC.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

DD.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

EE.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

FF.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

GG.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

HH.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

II.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

JJ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

KK.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

LL.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

MM.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

NN.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

OO.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

PP.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

QQ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

RR.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

SS.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

TT.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

UU.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

VV.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

WW.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

XX.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

YY.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

ZZ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

AA.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

BB.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

CC.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

DD.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

EE.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

FF.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

GG.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

HH.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

JJ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

KK.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

LL.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

MM.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

NN.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

OO.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

PP.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

QQ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

RR.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

UU.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

VV.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

WW.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

XX.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

YY.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

ZZ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

AA.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

BB.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

CC.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

DD.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

EE.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

FF.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

GG.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

HH.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

JJ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

KK.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

LL.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

MM.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

NN.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

OO.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

PP.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

QQ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

RR.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

UU.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

VV.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

WW.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

XX.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

YY.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

ZZ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

AA.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

BB.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

CC.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

DD.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

EE.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

FF.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

GG.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

HH.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

JJ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

KK.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

LL.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

MM.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

NN.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

OO.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

PP.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

QQ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

RR.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

UU.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

VV.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

WW.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

XX.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

YY.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

ZZ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

AA.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

BB.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

CC.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

DD.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

EE.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

FF.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

GG.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

HH.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

JJ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

KK.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

LL.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

MM.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

NN.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

OO.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

PP.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

QQ.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

RR.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

UU.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

VV.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。

WW.本基金报告期末持有的十名股票中不存在流通受限的情况。