

财务报表附注 (续) 资产负债表 截至2010年12月31日止

(续上 D95 版) 2. 公允价值 根据上述投资策略,本基金通过对个股相对于收益率曲线被低估(或高估)的程度分析,结合个股的信用评级、市场流动性、估值、薪酬特点等,充分挖掘价值相对被低估的个股,以把握市场失效所带来的投资机会。

第九部分 基金的业绩比较基准 本基金业绩比较基准: 中信标普300指数*50%+中信国债指数*50% 如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

第十部分 基金的风险收益特征 本基金为一只稳健增长型的混合型基金,其风险收益特征从长期平均及预期来看,低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金,属于中等预期收益、中等风险程度的证券投资基金。

截至2010年12月31日止 基金资产组合情况

截至2010年12月31日止 基金资产组合情况