

(上海 C15 版)

2 招商银行股份有限公司
注册地:深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
法定代表人:傅育宁
客服电话:95555
网址:www.cmbchina.com

3 中国民生银行银行股份有限公司
注册地:北京市西城区金融大街 25 号
法定代表人:郭树清
客户服务电话:95533
网址:www.cmbchina.com

4) 交通银行股份有限公司
注册地:上海银城中路 188 号
办公地:上海市银城中路 188 号
法定代表人:胡建华
客户服务电话: 95559
网址:www.bankcomm.com

5) 中信银行股份有限公司
注册地:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 B 座
法定代表人: 孔丹
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

6) 兴业银行股份有限公司
注册地: 北京市西城区复兴门内大街 2 号
办公地:北京市西城区复兴门内大街 2 号
法定代表人: 周志怀
客户服务电话:95568
公司网站:www.cib.com.cn

7 中国工商银行股份有限公司
注册地: 北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人:李礼辉
客户服务电话:95588
银行网址:www.icbc.com.cn

8 中国国际金融有限责任公司
注册地:上海市浦东新区世纪大道 200 号中银大厦 30F
法定代表人:唐新宇
联系人:董正
客服电话:4006208888
网址:http://www.cicfinchina.com

9 国泰君安证券股份有限公司
注册地:上海市延平路 135 号
法定代表人:祝皓一
联系人:芮敬祺
客服电话:400-8888-666
网址:http://www.gtja.com

10 申银万国证券股份有限公司
注册地:上海市常熟路 171 号
法定代表人:丁国荣
联系人:李海燕
客服电话:0086-21-962505
网址:www.sw2000.com.cn

11 平安证券股份有限公司
注册地: 安徽合肥市长江西路 357 号
法定代表人:李工
联系人:甘霖
客服电话:0551-96518
网址: http://www.pingan.com.cn

12 中信建投证券股份有限公司
注册地:北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼
法定代表人:张佑君
联系人:权娜
客服电话:4008888108
网址:www.cicc108.com

13 广发证券股份有限公司
注册地: 广州市天河区东路 183 号大都会广场 43 楼
法定代表人:王少华
联系人:魏敬
客服电话:961133 或致电各地营业部
网址: http://www.gf.com.cn

14 广发福瑞证券有限责任公司
注册地: 福州市五四路新天地大厦 7、8 层
法定代表人:黄金琳
联系人:李奕
客服电话:0591-96326
网址:http://www.gfr.com.cn

15 东海证券有限责任公司
注册地: 江苏省常州市延陵西路 59 号投资广场 18 楼
法定代表人:朱科敏
联系人:李涛
客服电话:4008888888
网址: http://www.donghai.com.cn

16 融通证券股份有限公司
注册地: 上海市海南中路 98 号
法定代表人:王开国
联系人:李奕
客服电话: 021 962503,400-888-001,021-9553777
网址: http://www.rtfcc.com

17 长江证券股份有限公司
注册地:湖北省武汉市江汉区新华路特 8 号长江证券大厦
法定代表人: 胡运凯
联系人:余斌
客服电话:95579 或 4008-888-999
网址:www.95579.com

18 信达证券股份有限公司
注册地:北京市西城区三里河东路 5 号中商大厦 10 层
法定代表人:张志国
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
网址: http://www.cindasc.com

19 兴业证券股份有限公司
注册地: 福建省福州市东湖新技术开发区东湖路 2 号高新大厦四楼
法定代表人: 余斌
联系人:陈瑞
客服电话:028-86712334
网址:www.fund.com

20 华泰证券股份有限公司
注册地:深圳市福田区中心区中广场香港中航大厦第五层 01A、02、03、04、17A、18A、24A、25A、26A
法定代表人: 吴明
联系人:陈邵威
客服电话:4008888555
网址:www.htsc.com

21 平安证券有限责任公司
注册地:广东深圳市福田区金田路中华国际交易广场 8 楼
法定代表人: 杨宇辉
联系人:杨雨婷
客服电话:40088-666-338
网址: http://www.pazq.com.cn

22 安信证券股份有限公司
注册地: 深圳市福田区金田路 2222 号安信大厦 34 层、28 层 A02 单元
法定代表人:牛冠星
联系人:陈琳虹
客服电话:4008001001、020-96210
网址: http://www.axzq.com.cn

23 国联证券股份有限公司
注册地:江苏省无锡市崇安区前 168 号国联大厦 6 层
法定代表人:雷建辉
联系人:梁晓峰
客服电话: 0510-82881668
网址:www.glig.com.cn

24 中信万通证券有限责任公司
注册地:青岛市崂山区香港东路 316 号

法定代表人:史浩武
联系人:吴忠超
客服电话:0532-96377
网址: www.zxwt.com.cn

25 融信证券股份有限公司
注册地: 深圳市龙岗区技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室
法定代表人:王静梅
联系人:王林枝
客服电话:4006515988
网址: www.rongxin.com.cn

26 广证证券经纪有限责任公司
注册地:中国上海市陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 23 楼
法定代表人: 陈林
联系人:刘明川
客户投诉电话: 021-38929908
网址: www.gdse.com.cn

27 浙商银行股份有限公司
注册地: 浙江省杭州市田路江苏大厦 A 座 39-45 层
法定代表人: 孙利华
客服电话: 95566
公司网址: www.zsb.com.cn

28 兴业证券股份有限公司
注册地: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701
法定代表人:林义相
客服电话: 010-60495666
联系人:潘琦
公司网址: http://www.ixsec.com

29 国信证券股份有限公司
注册地:深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦十六层至二十六层
法定代表人:何如
联系人:李旭
客服电话:95536
网站:http://www.guosen.com.cn

30 中国国际金融有限公司
地址: 北京建国门外大街 1 号国贸大厦 2 层 27 层及 28 层
法定代表人: 李剑阁
联系人: 罗春睿
联系电话: 010-65051166 或直接联系各营业部
网址: http://www.cicc.com.cn

31 招商证券股份有限公司
注册地: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座
法定代表人:崔刚
联系人:田薇
客服电话:4008888888
网址: www.cmchina.com.cn

32 光大证券股份有限公司
注册地:上海市静安区新闻路 150 号
法定代表人:李海刚
联系人:刘晨
客服电话:4008-888-788 1010998
网址:www.ebsc.com.cn

33 泽信证券股份有限公司
注册地:江苏省南京市中山东路 90 号
法定代表人:吴万涛
联系人:李宝龙
客服电话: 025 95997
网址:www.lzsc.com.cn

34 国都证券有限责任公司
注册地:北京市东城区东直门内大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层
法定代表人:常雷
联系人:黄静
客服电话:400 801 8118
网址:www.guodun.com

35 泰达宏利基金销售有限公司
基金管理人:根据相关法律法规的要求,选择其符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。
36 华创证券经纪
场内申购机构是指具有中国证监会认定的开放式基金代销资格,符合深圳证券交易所《以下称“深交所”》有关规定并经本基金管理人参加的,可通过交易所开放式基金销售业务系统办理开放式基金的认购,申购,赎回和转托管业务的深交所会员单位(具体名单请参见本公告)。
C. 证券登记机构
名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街 17 号
法定代表人:金甦
电话:010 7983139
传真:010 79937897
D. 杜其法律意见书的法律师事务所和独立法律师
住所:上海市浦力律师事务所
住所:上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼
负责人:韩刚
电话: 021 31358666
传真: 021 31358660
联系人: 邵国良
经办律师: 吕廷、郑明
(四) 审计会计师事务所和独立注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
住所: 上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号展翼楼大厦 6 楼
法定代表人:杨绍明
电话: 021 61238888
传真: 021 61238800
联系人: 汪静
经办会计师:许江、朱金锐

五、基金名称
中债价值精选灵活配置混合型证券投资基金

六、基金类型
契约式开放式基金

七、基金的投资目标
在主动灵活的资产配置和动态行业配置基础上,精选价值相对低估的优质上市公司股票,力求获得基金资产的长期稳定增值。

八、投资策略
本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金投资组合中,股票资产占基金资产的 30-80%,债券资产占基金资产的 0-65%,其中,基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%,基金持有的现金以及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。
此外,法律法规和中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围,法律法规和中国证监会变更对权证或资产支持证券等投资的比例限制的,基金管理人可在履行适当程序后,可相应调整本基金的投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

九、投资范围
本基金采取宏观和微观的资产配置和股票投资策略。在资产配置中,通过以宏观经济及宏观经济政策分析为核心的情景分析方法来制定投资组合股票、债券和货币市场工具等的投资范围和比例,并结合对市场估值、流动性、投资主体行为、市场情绪等因素的综合判断进行灵活调整;在行业配置中,基于动态的行业相对比较比较,发掘价值低估的行业,在股票投资中,采取自下而上的策略,优先价值相对低估的优质公司股票和债券投资,并扩大分散的投资组合风险控制,以期获得长期稳健的投资收益。
本基金的核心投资策略将是行业的相对价值和个股的绝对价值有效结合,在个股选择方面,首先根据以下指标进行筛选,形成初始投资组合备选投资标的:
A) 剔除连续涨停半个月内上市公司股票;
B) 市盈率相对预期盈利增长率(简称 PEG)在 1.5 倍以上(基本面出现重大改善的个股除外);
C) 股价涨幅相对股息/总市值大于 10 亿元的上市公司股票
在此基础上通过系统性的定性分析、定量分析及以估值水平分析形成价值优选股票备选投资组合。本基金投资于上述价值的股票资产的投资比例不低于投资组合资产的 80%。
1. 资产配置策略
在资产配置中,本基金运用定性分析和定量分析方法作为资产配置的主要参考依据,在定性分析方法中,主要以全球和国内宏观经济分析为基础,通过一定期限内宏观经济、经济政策、区域、行业及行业 动向,确定股票和现金类资产 权重,现金和到期日在一年以内的政府债券 资产类别的预期收益、风险和种情景发生的概率,确定资产配置的大体方向;在定量分析方法中,主要通过分析各类资产的风险溢价水平,在有效控制投资组合风险的前提下,形成对各类资产的配置比例。
在上述确定的资产配置比例下,本基金将根据市场估值、流动性、投资主体行为、市场情绪等因素进行综合判断,对各类别资产配置进行灵活调整。
2. 股票投资策略
本基金基于科学合理的并不断完善的质量和量化分析体系实现股票投资策略,投资组合的构建充分利用“自下而上”和“自上而下”两种分析体系的优势。
Ø 定性分析

2.以下股东的股息由本公司自行派发:

序号	股东账号	股东名称
1	08****825	重庆建峰工业集团有限公司
2	08****639	重庆智安实业有限公司

五、咨询机构
咨询地址:重庆建峰化工股份有限公司证券部
咨询联系人:李海涛
咨询电话:023-72591275
传真电话:023-72591275

重庆建峰化工股份有限公司董事会
2011年4月8日

股票简称:建峰化工 股票代码:000950 编号: 2011-026

重庆建峰化工股份有限公司董事会
重大资产重组进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
自公司股票停牌以来,公司及相关各重组方积极推动本次重大资产重组的各项工作。由于本次重组涉及重组方较多,拟上市公司资产范围广,重组系列程序性事项在此期间无法全部解决,为顺利推进本次重组工作,为维护投资者利益,本公司股票暂缓复牌。
特此公告。
重庆建峰化工股份有限公司董事会
2011年4月8日

证券代码:000693 证券简称:S*ST 聚友 公告编号:2011-023

成都聚友网络股份有限公司关于股改进展的风险提示公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。
一、目前公司非流通股股东股改动向情况
目前,公司非流通股股东共计 55 家,其中已有 49 家提出股改动议,其持股数量占公司流通股总数的 99.14%,其余非流通股股东因注销、无法联系、正在办理等原因未明确提出股改动议。
二、公司股改保荐机构情况
公司已聘请国都证券有限责任公司为公司股改保荐机构。
三、公司董事会拟采取的措施
为彻底解决公司的巨额债务负担,改善公司资产质量,实现公司未来的可持续发展,在经与非流通股股东、重组方、相关债权人进行数次协商沟通后,公司的股权分置改革将与拟实施的资产重组和债务重组相结合,同步实施。
经公司七届二十一次董事会审议通过,公司在聚友企业银行企业金融债权人委员会见证下,已于 2010 年 11 月 30 日与首控聚友集团有限公司及陕西华豫镍钴金属有限公司实际控制人王应虎先生签订了《成都聚友网络股份有限公司重大资产重组之框架协议》。
现将中介机构已陆续进场开展工作;公司董事会与保荐机构将结合目前的实际情况研究制订公司的股权分置改革方案。

成都聚友网络股份有限公司
董 事 会
二〇一一年四月八日

定性分析将主要界定特定投资时期宏观经济、中观经济发展和微观上市公司三个经济层面的内涵,以及确定特定投资时期的市场阶段性投资机会。
对于宏观层面的内涵主要包括:特定投资时期所处的经济发展阶段、长期经济周期、中期经济周期、经济周期的具体阶段。
中观经济层面的内涵界定包括,基于不同经济发展阶段和不同经济周期时期的主要主导产业、不同产业所处的生命周期、不同产业的气度周期特征、国家产业政策取向、产业在全球范围内产业中的地位。
对于微观层面的内涵界定包括,治理结构、产品结构、技术结构、管理能力、公司战略、公司在行业中的地位、品牌优势和核心竞争能力等。
市场阶段的内涵界定包括,熊市、牛市和震荡市,在不同时期采取不同的投资策略。
定性评估的核心是找到具有持续经营能力的行业和上市公司,力争发掘在经济不同期阶段,在经济周期的不同时期能够稳定增长的行业和公司,历史表现和超出正常状态下的价值低估是考核长期价值的重要指标,基于不同行业和公司的相对比较有助于发现特定投资时期个股的相对价值。
Ø 定量分析
基金管理人建立的价值投资量化分析体系,主要围绕大类资产配置、行业与风格分析及个股选择而建立。
1) 筛选优质市场价值量化分析体系,主要考虑市场整体的绝对价值和相对价值,绝对价值指标包括信息(限于 FIM 模型)分析、FIM 模型分析、上述比较分析,相对指标包括静态和动态的 PE、PB、PS、PCF 等指标,在对市场整体进行绝对价值和相对价值分析的基础上,通过横向比较和纵向比较的分析方法,确定阶段性投资价值。
2) 评估行业风格的风险溢价体系,同样考虑行业的价值和相对价值,绝对价值指标包括 DIM 和个股加成方法,而相对价值指标将包括 PE、PB、EBITDA/EBV 以及总市值占比等指标,同样考察该指标的历史纵向纵向状况,以及国际横向对比情况,除此以外,上市公司利润结构和收入结构与市值结构的偏离也将作为考察行业价值的主要方法。
3) 可量化分析体系,主要基于上市公司基本面分析评估模型,重点考察上市公司的盈利能力、运营能力、负债水平等方面,同时参考公司在一定时期内的风格特征、选股能力和成长性、运营能力指标较高而负债水平较低或合理上市公司作为投资对象。
Ø 估值
根据企业业绩的长期增长趋势以及同类企业的平均估值水平,应用本基金管理人设计的估值模型,选择价值被市场显著低估的企业进行投资,采用的估值模型包括资产重置价格、市净率法(BV)、市净率法(BB)、经济价值也称作摊前利润法(EVBRITA)、现金流贴现法(DCF)、比较分析方法包括横向比较及纵向比较。
7. 本基金通过扎实的课题研究,对所投资企业基本面,影响其业绩的不确定因素等深入及全面的了解,确保所选择的企业具备长期持续增长阶段性高速增长能力,研究员将对精选出的股票进行持续跟踪,当发现股票的基本面及定价等因素发生变化时,不再调仓相关选择标准,基金经理应在合理范围内将该股票从投资组合中剔除。
8. 债券投资策略
本基金在充分评估债券市场宏观环境和利率水平基础上,依次通过中长期投资策略,期限结构配置策略及宏观政策预期下上下波段操作策略,在投资实践过程中,本基金灵活运用利率期限策略,券种选择策略、流动性策略、期限策略、期限策略、期限放大策略等积极投资策略,发现、识别和利用资产定价偏差或市场不平衡来发现投资组合的增值,本基金在整个投资决策过程中将严格遵守投资纪律并有有效投资程序。
9. 高风险资产的投资管理程序包括:貝类资产投资管理在外地的投资管理;采用主动的投资管理,追求获得较高的风险调整后收益,同时保证组合的流动性满足正常的现金流的需要,具体投资管理程序如图 1 所示。
图 1 中债价值精选灵活配置混合基金债券投资管理程序

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	600312	平安电力	6,995,399	95,354,648.57	4.04
2	002065	东信软件	2,694,412	82,907,057.24	3.51
3	000998	隆平高科	2,459,975	80,121,385.75	3.39
4	600664	特药股份	3,316,534	74,854,172.38	3.17
5	601601	中信金属	2,842,350	65,089,815.00	2.75
6	000759	武汉中百	4,996,467	62,558,396.04	2.65
7	600690	青岛海尔	2,193,604	61,881,568.84	2.62
8	601989	中国重工	4,827,725	56,918,877.25	2.41
9	601318	中国平安	839,946	47,171,367.20	2.00
10	002063	远光软件	1,461,069	45,439,245.90	1.92

Ø 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元			
序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	--	--
2	央行票据	200,450,000.00	8.48
3	金融债券	--	--
	其中:政策性金融债	--	--
4	企业债券	--	--
5	企业短期融资券	49,855,000.00	2.11
6	中期票据	--	--
7	其他	--	--
8	合计	250,305,000.00	10.59

Ø 期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元					
序号	债券代码	债券名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	0801029	08企业债 29	1,000,000	100,240,000.00	4.24
2	0801026	08企业债 26	1,000,000	100,210,000.00	4.24
3	1083306	10苏信债 CPO1	500,000	49,855,000.00	2.11

Ø 期末未按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证投资。
Ø 报告期末持仓情况
1. 本基金持有的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
2. 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
3. 期末其他各项资产构成

单位:人民币元			
序号	名称	金额	
1	存出保证金	1,366,585.93	
2	应收证券清算款	--	
3	应收股利	--	
4	应收利息	8,004,961.86	
5	应收申购款	4,591,458.95	
6	其他应收款	--	
7	待摊费用	--	
8	其他	--	
9	合计	13,963,006.74	

4. 期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有可转换债券。
5. 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元					
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600664	特药股份	74,854,172.38	3.17	重大资产重组

注:2011 年 1 月 24 日起,我司对旗下基金目前持有的证券停牌证券代码:600664 采用“指数收盘价”予以估值,在确定指数时采用中证 SAC 行业指数作为计算依据,2011 年 2 月 16 日被股票复牌,我司恢复采用交易当天收盘价进行估值。
6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入原因,本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。
Ø 十、基金的业绩
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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益,基金的业绩并不代表其未来表现,投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的投资说明书。本基金自成立日至 2010 年 8 月 25 日,基金合同生效以来基金投资业绩与同期业绩比较基准的比较如下表所示:

阶段	净值增长		业绩比较基准		①-③	②-④
	增长率①	基准率②	收益率③	基准率④		
自基金成立起至今	3.94%	1.16%	4.57%	0.98%	-0.63%	0.18%

十五、基金的费用与税收
(一) 基金费用的种类
1. 基金管理人的管理费;
2. 基金托管人的托管费;
3. 基金财产收取的审计费;费用;
4. 基金合同生效前的基金信息披露费用;
5. 基金份额持有人大会费用;
6. 基金合同生效后与基金有关的会计师事务所费;
7. 基金的证券交易费用;
8. 依据相关法律法规和基金合同可以在基金财产中列支的其他费用。
(二)上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
(三) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式
1. 基金管理人的管理费
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提,计算方法如下:
H=E×1.5%÷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
基金管理费每日计提,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,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
2. 基金托管人的托管费
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25%年费率计提,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
基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。
(四) 基金管理人和基金管理人以外的基金管理人根据其他有关法律法规和协议的规定,按费用支出金额支付,列入或纳入当期基金费用。
(五) 列入基金费用的项目
基金管理人性和基金管理人因未履行或未完全履行义务而导致费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用,基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师事务所费以及其他费用不从基金财产中支付。
(六) 基金管理人性和基金管理人可根据基金发展情况调低基金管理费率,基金托管费率,基金管理人必须就新的费率实施前 3 个工作日在指定媒体上刊登公告。
(七) 基金金额
基金管理人性和基金管理人根据相关法律法规的规定,履行纳税义务。
十六、对招募说明书更新后的说明
本基金管理人(经中华人民共和国证券投资基金业协会)证券投资基金管理人、证券投资基金销售管理计划,《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求,结合基金运作的实际情况,对本基金的招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:
(一) “基金管理人”部分,对管理人部分情况,如董事会成员、监事、管理层成员、基金经理等进行更新;
(二) “基金托管人”部分,对托管人发展情况,托管业务主要人员情况,托管业务经营情况进行了更新;
(三) “相关服务机构”部分,对场外代销机构、注册登记机构、审计会计师事务所和独立注册会计师信息进行了更新;
(四) “基金的募集”和“基金合同的生效”部分,根据基金的募集情况,更新了基金的募集份额及生效日期;
(五) “投资组合报告”部分,根据《信息披露内容与格式准则第 5 号及 基金合同》,补充了基金最近一期投资组合报告的内容;
(六) “新增 基金的费用”部分,说明了基金报告期的费用;
(七) “其他应披露事项”部分,列明了前次招募说明书公布以来的其他应披露事项。
中银基金管理有限公司
2011 年 4 月 11 日

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	1,335,237,774.12	54.53	
	其中:股票	1,335,237,774.12	54.53	
2	固定收益投资	250,305,000.00	10.23	
	其中:债券	250,305,000.00	10.23	
	资产支持证券	--	--	
3	货币市场工具投资	--	--	
4	买入返售金融资产	199,980,419.97	8.17	
5	银行存款和结算备付金合计	649,019,079.66	26.51	
6	其他各项资产	13,963,006.74	0.57	
7	合计	2,448,550,280.49	100.00	

C. 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	80,121,385.75	3.39
B	采矿业	116,955,532.13	4.93
C	制造业	615,622,153.99	26.06
CD	食品、饮料	--	--
CE	纺织、服装、皮毛	38,761,048.38	1.64
C2	木材、家具	--	--
C3	造纸、印刷	--	--
C4	石油、化学、塑胶、塑料	14,383,805.56	0.61
C5	电子	48,761,461.04	2.06
C6	金属、非金属	43,669,459.25	1.85
C7	机械、设备、仪器	330,382,758.15	13.98
C8	医药、生物制品	139,663,621.61	5.91
C99	其他制造业	--	--
D	电力、煤气、热力、生产和供应业	14,497,729.90	0.62
E	建筑业	50,380,790.87	2.13
F	交通运输、仓储业	--	--
G	信息技术业	164,168,405.94	6.95
H	批发和零售业	147,006,628.38	6.23
I	金融业	112,261,182.36	4.75
J	房地产业	--	--
K	社会服务业	--	--
L	传播与文化业	--	--
M	综合类	34,383,953.80	1.46
	合计	1,335,237,774.12	54.53

Ø 期末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

证券代码:002307 证券简称:北新路桥 公告编号:临 2011-011

新疆北新路桥建设股份有限公司关于为全资子公司担保进展情况公告

本公司及其董事、监事、高级管理人员保证公告内容的真实、准确和完整,并对公告中的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担连带责任。
一、担保情况概述
新疆北新路桥建设股份有限公司(以下简称“公司”、“本公司”)2010 年 12 月 7 日召开的第三届董事会第二十次会议和 2010 年 12 月 23 日召开的公司 2010 年第四次临时股东大会审议通过了《关于为重庆北新路桥投资有限责任公司提供担保额度的议案》(以下简称“重庆北新”),同意为重庆北新提供 2.5 亿元银行融资担保额度(其中在中国工商银行股份有限公司新疆区分行提供 2 亿元融资担保额度,在交通银行股份有限公司重庆市分行提供 5000 万元融资担保额度),上述担保额度的有效期自股东大会审议通过之日起的 12 个月。具体事项详见 2010 年 12 月 8 日的《新疆北新路桥、证券时报》、《上海证券报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)刊登的《新疆北新路桥建设股份有限公司公告》为全资子公司提供担保额度的公告》。
2011 年 4 月 7 日,公司与交通银行股份有限公司重庆市分行签署了《保证合同》编号:渝大交银 2011 年保字 064 号,合同约定对重庆北新于 2011 年 4 月 7 日与交通银行股份有限公司重庆市分行签署《开立银行承兑汇票合同》形成的 200 万元负债中的本金 190 万元提供担保。本次签订的 190 万元保证合同在公司 2010 年第四次临时股东大会批准的交银银行股份有限公司重庆市分行 5000 万元担保额度范围内。
二、被担保入基本情况:
被担保公司名称:新疆北新路桥建设股份有限公司全资子公司。
被担保入名称:重庆北新路桥投资有限责任公司;
注册资本:34,000 万元
法定代表人:韩征平
成立日期:2010 年 4 月 9 日
注册地址:重庆市合川区南办处南岸西路 3 号附 1 号

经营范围:从事路桥、基本建设投资、建筑材料及商品混凝土加工、销售;从事建筑相关业务、桩相关资质作业及市政工程、公路施工、地质地质技术业、机械设施租赁。
经营现状:重庆北新业已全面实施“西部地区农村农民促进工程”建设,川觅点草街示范园首期工程 BF 项目的投资主体,截至 2010 年 9 月 30 日,重庆北新资产总额为 45,232.34 万元,负债总额为 10,221.06 万元,净资产 35,011.28 万元,营业收入 0 万元,利润总额 810.45 万元,净利润 611.28 万元,或有事项涉及总额 0 万元。(以上数据未经审计)。
三、董事会意见:
1. 同意为重庆北新提供 2.5 亿元的担保额度,担保期限为股东大会审议通过之日起的 12 个月。
2. 重庆北新为本公司全资子公司,生产经营情况稳定,为其