

【注B46页】
 地址:北京市西城区
 联系人:张金峰
 联系电话:010-61967000

名称:北京市国融律师事务所
 住所:北京市西城区金融大街19号富国大厦B座11层
 办公地址:北京市西城区金融大街19号富国大厦B座11层
 负责人:王人海
 电话:010-52882888
 传真:010-52882999
 邮编:100032

序号	名称	金额(元)
1	银行存款	17,364,107.30
2	交易性金融资产	50,240,568.89
3	应收账款	46,983.56
4	应收利息	16,722,352.87
5	预付款项	2,178,953.68
6	其他应收款	-
7	存货	-
8	其他	-
9	其他流动资产	-
4	流动资产合计	86,552,967.70

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工商银行	180,885,504.00	0.85
2	110007	招商银行	7,278,765.00	0.03
3	128233	建设银行	2,541,713.61	0.01
4	125709	招商银行	956,916.18	0.00

5. 报告期内,本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求,未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期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。
 6. 本基金投资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。
 7. 本基金投资的前十名证券中,不存在投资于同一原始权益人的主体发行的结构化融资工具相关情况。

年份	净值增长率(%)	净值增长率标准差(%)	业绩比较基准收益率(%)	超额收益(%)	①-③	②-④
2009年6月30日至2009年12月31日	0.50%	0.39%	3.26%	0.77%	-2.76%	-0.47%
2009年12月31日	11.83%	1.26%	51.26%	0.88%	66.57%	0.38%
2009年1月1日至2009年12月31日	104.42%	1.96%	101.50%	1.61%	67.92%	0.35%
2008年1月1日至2008年12月31日	-38.59%	1.82%	-40.27%	1.92%	1.68%	-0.10%
2009年1月1日至2009年12月31日	79.33%	1.70%	60.32%	1.38%	19.01%	0.32%
2010年1月1日至2010年12月31日	2.92%	1.32%	-0.82%	0.93%	3.74%	0.39%
2011年1月1日至2011年3月31日	-0.97%	1.25%	3.36%	0.82%	-4.33%	0.43%

1. 投资策略
 本基金主要投资于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、债券及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
 2. 资产配置
 本基金资产配置的主要方法是:采用自上而下、自下而上相结合的方法,定期跟踪股票市场的估值水平,并与市场实际运行情况相结合,判断股票市场的投资价值,结合对宏观经济、政策、市场估值等因素的分析,调整股票市场的配置比例,并在此基础上,选择具有良好成长性的个股。
 3. 债券投资
 本基金债券投资的主要方法是:采用自上而下、自下而上相结合的方法,定期跟踪债券市场的估值水平,并与市场实际运行情况相结合,判断债券市场的投资价值,结合对宏观经济、政策、市场估值等因素的分析,调整债券市场的配置比例,并在此基础上,选择具有良好成长性的个股。
 4. 衍生品投资
 本基金将根据法律法规的规定,在严格控制风险的前提下,适度参与股指期货、国债期货等金融衍生品的投资,以增强基金的投资收益,并作为风险管理工具,对冲基金投资组合中的系统性风险,提高基金投资组合的流动性。
 5. 风险管理
 本基金将采用多种风险管理工具,包括止损、对冲、分散投资等,以控制基金投资组合的风险,确保基金资产的安全。
 6. 绩效评估
 本基金将采用多种绩效评估指标,包括净值增长率、净值增长率标准差、超额收益等,以评估基金投资组合的绩效,并为基金资产的配置提供依据。

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	1,200,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6,000
赎回金额(F=C-E)	1,194,000
净转入金额(H=F-G)	1,194,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	796.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000
赎回金额(F=C-E)	11,940,000
净转入金额(H=F-G)	11,940,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	7,960.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	100,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	120,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	600,000
赎回金额(F=C-E)	119,400,000
净转入金额(H=F-G)	119,400,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	79,600.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	1,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	1,200,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	6,000
赎回金额(F=C-E)	1,194,000
净转入金额(H=F-G)	1,194,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	796.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000
赎回金额(F=C-E)	11,940,000
净转入金额(H=F-G)	11,940,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	7,960.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	100,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	120,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	600,000
赎回金额(F=C-E)	119,400,000
净转入金额(H=F-G)	119,400,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	79,600.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000
赎回金额(F=C-E)	11,940,000
净转入金额(H=F-G)	11,940,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	7,960.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	100,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	120,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	600,000
赎回金额(F=C-E)	119,400,000
净转入金额(H=F-G)	119,400,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	79,600.00

1. 申购费用
 申购费用=申购金额×申购费率
 净申购金额=申购金额-申购费用
 申购份额=净申购金额/申购当日基金份额净值
 2. 赎回费用
 赎回费用=赎回金额×赎回费率
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用
 3. 基金转换费用
 基金转换费用=转出基金赎回费用+转入基金申购费用-申购补差费用
 4. 基金分红
 基金分红是指基金管理人将基金收益的一部分以现金或红利的方式派发给基金份额持有人。
 5. 基金收益分配原则
 本基金收益分配应遵循以下原则:
 (1) 本基金收益分配方式为现金分红和红利再投资;
 (2) 本基金收益分配以人民币元为单位;
 (3) 本基金收益分配不影响基金份额持有人的基金份额;
 (4) 本基金收益分配应符合相关法律法规的要求;
 (5) 本基金收益分配应符合基金合同的约定。

项目	费用计算
转出份额(A)	10,000,000
转出基金T日基金份额净值(B)	1,200
转出总金额(C=A*B)	12,000,000
转出基金赎回费率(D)	0.5%
转出基金费用(E=C*D)	60,000
赎回金额(F=C-E)	11,940,000
净转入金额(H=F-G)	11,940,000
转入基金T日基金份额净值(I)	1,500
转入基金份额(J=H/I)	7,960.00