

(上接D235页)

4. 报告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处于转股期的可转换债券。  
 5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明  
 本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。  
 6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分  
 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉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。基金的过往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请仔细阅读本基金的招募说明书。  
 下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据。

阶段	净值增长率①	净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2009年7月10日至2009年12月31日	-0.20%	1.60%	5.50%	2.06%	-5.70%	-0.46%
2010年1月1日至2010年12月31日	-11.52%	1.51%	-10.89%	1.50%	-0.63%	0.01%
2011年1月1日至2011年6月30日	-1.93%	1.17%	-2.06%	1.17%	0.13%	0.00%

(一)基金运作费用  
 1. 基金费用的种类  
 Q 基金管理人的管理费。  
 Q 基金托管人的托管费。  
 Q 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用。  
 Q 基金份额持有人大会费用。  
 Q 基金合同终止及终止后的会计师费、律师费和诉讼费。  
 Q 基金份额持有人大会费用。  
 Q 基金的交易费用。  
 Q 基金的银行汇划费用。  
 Q 按照国家有关规定从基金财产中列支的其他费用。  
 本基金终止清算时发生费用,按实际支出从基金财产总值中扣除。  
 2. 基金费用的费率、计提标准、计提方式与支付方式  
 Q 基金管理人的管理费  
 本基金的基金管理费按前一交易日基金资产净值的0.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:  
 $H = E \times 0.5\%$  为当日基金资产净值  
 $H$  为每日应计提的基金管理费  
 $E$  为前一日的基金资产净值  
 基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核无误后于次月首日起5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、公休等,支付日期顺延。  
 Q 基金托管人的托管费  
 本基金的托管费按前一交易日基金资产净值的0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下:  
 $H = E \times 0.1\%$  为当日基金资产净值  
 $H$  为每日应计提的基金托管费  
 $E$  为前一日的基金资产净值  
 基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核无误后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休等,支付日期顺延。  
 Q 其他费用  
 基金合同生效后,基金管理人和基金托管人应根据相关法律法规及相应合同约定,按费用支出金额列入或摊入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。  
 3. 不得列入基金费用的项目  
 Q 基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失。  
 Q 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用。  
 Q 基金合同生效前所发生费用,包括但不限于验资费、会计师费、律师费和诉讼费。  
 Q 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。  
 4. 费用减免  
 基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。  
 本基金的各项费率,基金托管费率需经基金份额持有人大会决议,但根据法律法规或证监会的要求提高管理费、托管费的情形除外,调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。  
 基金管理人必须最迟于新的费率实施前2日在指定媒体和基金管理人网站上公告。  
 (二)申购费用  
 Q 本基金申购费用由申购人承担,用于市场推广、销售、登记结算等各项费用。投资者在申购本基金时需交纳前端申购费,费率按申购金额分段,具体如下:  

申购金额(含申购费)	前端申购费率
100万元以下	1.2%
100万元以上(含100万元)-500万元以下	0.9%
500万元以上(含500万元)-1000万元以下	0.6%
1000万元以上(含1000万元)	每笔1,000.00元

 Q 本基金赎回费用由赎回人承担,在投资者赎回基金份额时收取。赎回时份额持有时间不满1年的,收取0.5%的赎回费,持有时间满1年不满2年的,收取0.25%的赎回费,持有时间满2年不满3年的,收取0.15%的赎回费,持有时间满3年以上(含3年)的,不再收取赎回费。其中,赎回费扣除收取赎回费总额的25%归入基金财产,其余用于支付赎回手续费,剩余部分归基金财产。  
 Q 基金管理人可以根据《基金合同》的约定调整赎回费率或收费方式,基金管理人最迟应于新的费率或收费方式实施前2日在指定媒体上公告。  
 2. 申购费用  
 Q 基金管理人可以在不违背法律法规规定及《基金合同》约定的前提下根据市场情况制定申购计划,针对特定交易方式,如网上交易,等进行基金交易的投资者定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关活动要求对申购和赎回基金的费用费率进行调整,基金管理人公告。  
 3. 申购费用的计算  
 申购费用=申购金额×申购费率  
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
 前端申购费用=申购金额×前端申购费率  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 基金申购份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔申购的申购费用和获得的基金份额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购2	申购3
申购费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净申购金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
申购金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净申购金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
申购份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若申购金额为1000元,申购费用按申购金额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购4
申购费用(元)	1,000.00	10,000.00
净申购金额(元)	1,000.00	1,000.00
申购金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
申购份额(e)	833.33	833.33

Q 赎回费用的计算  
 赎回费用=赎回金额×赎回费率  
 赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值  
 赎回费用为固定金额时,赎回费用的计算方法如下:  
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用  
 赎回的基金份额=净赎回金额/赎回当日基金份额净值  
 基金赎回份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔赎回金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔赎回的赎回费用和获得的基金份额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回2	赎回3
赎回费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净赎回金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
赎回金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净赎回金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
赎回份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若赎回金额为1000元,赎回费用按赎回金额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回4
赎回费用(元)	1,000.00	10,000.00
净赎回金额(元)	1,000.00	1,000.00
赎回金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
赎回份额(e)	833.33	833.33

Q 申购费用的计算  
 申购费用=申购金额×申购费率  
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
 前端申购费用=申购金额×前端申购费率  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 基金申购份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔申购的申购费用和获得的基金份额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购2	申购3
申购费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净申购金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
申购金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净申购金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
申购份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若申购金额为1000元,申购费用按申购金额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购4
申购费用(元)	1,000.00	10,000.00
净申购金额(元)	1,000.00	1,000.00
申购金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
申购份额(e)	833.33	833.33

Q 赎回费用的计算  
 赎回费用=赎回金额×赎回费率  
 赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值  
 赎回费用为固定金额时,赎回费用的计算方法如下:  
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用  
 赎回的基金份额=净赎回金额/赎回当日基金份额净值  
 基金赎回份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔赎回金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔赎回的赎回费用和获得的基金份额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回2	赎回3
赎回费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净赎回金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
赎回金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净赎回金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
赎回份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若赎回金额为1000元,赎回费用按赎回金额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回4
赎回费用(元)	1,000.00	10,000.00
净赎回金额(元)	1,000.00	1,000.00
赎回金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
赎回份额(e)	833.33	833.33

Q 申购费用的计算  
 申购费用=申购金额×申购费率  
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
 前端申购费用=申购金额×前端申购费率  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 基金申购份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔申购的申购费用和获得的基金份额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购2	申购3
申购费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净申购金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
申购金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净申购金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
申购份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若申购金额为1000元,申购费用按申购金额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购4
申购费用(元)	1,000.00	10,000.00
净申购金额(元)	1,000.00	1,000.00
申购金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
申购份额(e)	833.33	833.33

Q 赎回费用的计算  
 赎回费用=赎回金额×赎回费率  
 赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值  
 赎回费用为固定金额时,赎回费用的计算方法如下:  
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用  
 赎回的基金份额=净赎回金额/赎回当日基金份额净值  
 基金赎回份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔赎回金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔赎回的赎回费用和获得的基金份额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回2	赎回3
赎回费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净赎回金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
赎回金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净赎回金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
赎回份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若赎回金额为1000元,赎回费用按赎回金额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回4
赎回费用(元)	1,000.00	10,000.00
净赎回金额(元)	1,000.00	1,000.00
赎回金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
赎回份额(e)	833.33	833.33

Q 申购费用的计算  
 申购费用=申购金额×申购费率  
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
 前端申购费用=申购金额×前端申购费率  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 基金申购份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔申购的申购费用和获得的基金份额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购2	申购3
申购费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净申购金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
申购金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净申购金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
申购份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若申购金额为1000元,申购费用按申购金额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购4
申购费用(元)	1,000.00	10,000.00
净申购金额(元)	1,000.00	1,000.00
申购金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
申购份额(e)	833.33	833.33

Q 赎回费用的计算  
 赎回费用=赎回金额×赎回费率  
 赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值  
 赎回费用为固定金额时,赎回费用的计算方法如下:  
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用  
 赎回的基金份额=净赎回金额/赎回当日基金份额净值  
 基金赎回份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔赎回金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔赎回的赎回费用和获得的基金份额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回2	赎回3
赎回费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净赎回金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
赎回金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净赎回金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
赎回份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若赎回金额为1000元,赎回费用按赎回金额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回4
赎回费用(元)	1,000.00	10,000.00
净赎回金额(元)	1,000.00	1,000.00
赎回金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
赎回份额(e)	833.33	833.33

Q 申购费用的计算  
 申购费用=申购金额×申购费率  
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
 前端申购费用=申购金额×前端申购费率  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 基金申购份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔申购的申购费用和获得的基金份额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购2	申购3
申购费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净申购金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
申购金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净申购金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
申购份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若申购金额为1000元,申购费用按申购金额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购4
申购费用(元)	1,000.00	10,000.00
净申购金额(元)	1,000.00	1,000.00
申购金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
申购份额(e)	833.33	833.33

Q 赎回费用的计算  
 赎回费用=赎回金额×赎回费率  
 赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值  
 赎回费用为固定金额时,赎回费用的计算方法如下:  
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用  
 赎回的基金份额=净赎回金额/赎回当日基金份额净值  
 基金赎回份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔赎回金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔赎回的赎回费用和获得的基金份额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回2	赎回3
赎回费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净赎回金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
赎回金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净赎回金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
赎回份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若赎回金额为1000元,赎回费用按赎回金额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回4
赎回费用(元)	1,000.00	10,000.00
净赎回金额(元)	1,000.00	1,000.00
赎回金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
赎回份额(e)	833.33	833.33

Q 申购费用的计算  
 申购费用=申购金额×申购费率  
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)  
 前端申购费用=申购金额×前端申购费率  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 申购费用为固定金额时,申购费用的计算方法如下:  
 净申购金额=申购金额-申购费用  
 申购的基金份额=净申购金额/申购当日基金份额净值  
 基金申购份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔申购的申购费用和获得的基金份额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购2	申购3
申购费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净申购金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
申购金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净申购金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
申购份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若申购金额为1000元,申购费用按申购金额计算如下:  

申购金额(元)	申购1	申购4
申购费用(元)	1,000.00	10,000.00
净申购金额(元)	1,000.00	1,000.00
申购金额(元)	9,999.00	9,999.00
T日基金份额净值(d)	1.200	1.200
申购份额(e)	833.33	833.33

Q 赎回费用的计算  
 赎回费用=赎回金额×赎回费率  
 赎回金额=赎回份额×赎回当日基金份额净值  
 赎回费用为固定金额时,赎回费用的计算方法如下:  
 净赎回金额=赎回金额-赎回费用  
 赎回的基金份额=净赎回金额/赎回当日基金份额净值  
 基金赎回份额的计算方法五:保留小数点后两位,由此误差产生的损失由基金财产承担,产生的收益归基金财产所有。  
 例:假定T日基金份额净值为1.200元,若三笔赎回金额分别为1,000元、100元、500元,则各笔赎回的赎回费用和获得的基金份额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回2	赎回3
赎回费用(元)	1,000.00	1,000.00	5,000.00
净赎回金额(元)	1.2%	0.9%	0.6%
赎回金额(元)	998.14	991.08	4,970.17
净赎回金额(元)	11.86	8.91	29,821.07
T日基金份额净值(e)	1.200	1.200	1.200
赎回份额(f)	803.37	803.75	4,040.75

 若赎回金额为1000元,赎回费用按赎回金额计算如下:  

赎回金额(元)	赎回1	赎回4
赎回费用(元		