

(上接D14版)
4 收益率利差分析
 在观测和分析不同市场不同板块之间(比如国债与金融债)、不同市场的同一品种、不同市场的不同板块之间的收益率利差基础上,基金管理人采取积极策略选择合适品种进行交易来获取投资收益。在正常条件下它们之间的收益率利差是稳定的,但是在某种情况下,比如若某个行业在经济周期的某一时期面临信用风险敞口或者市场供求发生变化时这种稳定关系便被打破,若能提前预判并进行交易,就可进行套利或减少损失。

5 相对价值评估
 基金管理人运用这种策略的目的在于识别被市场错误定价的债券,并采取适当的交易以期获利。一方面基金管理人通过对利率期限结构,评估处于同一风险层次的多只债券中,究竟哪些更具投资价值;另一方面,通过综合考虑债券等级、息票率、所属行业、可赎回条款等因素对利率差的影响,评估风险溢价。

九、基金的业绩比较基准
 上证指数×75%+上证国债指数×20%+同期银行一年定期存款利率×5%
 当作为本基金业绩比较基准的指数因中断编制等原因或市场出现更合适的新指数时,本基金业绩比较基准将做适时调整。

十、基金的风险收益特征
 本基金属于股票型基金,风险水平和预期收益水平相对较高。

十一、基金投资组合报告 (截止2011年6月30日)
(一)基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,604,229,998.14	69.64
	其中:股票	1,604,229,998.14	69.64
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	298,800,549.40	12.97
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	397,881,927.48	17.27
6	其他资产	2,666,105.25	0.12
7	合计	2,303,578,580.27	100.00

(二)行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	148,911,758.88	6.68
C	制造业	867,117,404.08	38.91
C0	食品、饮料	185,751,650.04	8.33
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	37,917,000.00	1.70
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	18,710,000.00	0.84
C5	电子	157,236,885.00	7.06
C6	金属、非金属	67,373,741.20	3.02
C7	机械、设备、仪表	197,478,000.00	8.86
C8	医药、生物制品	161,769,543.74	7.26
C99	其他制造业	40,880,584.00	1.83
D	电力、煤气及水的生产和供应业	147,595,000.00	6.62
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	145,105,706.30	6.51
H	批发和零售贸易	141,668,077.28	6.36
I	金融、保险业	107,840,485.28	4.84
J	房地产业	45,991,566.32	2.06
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	1,604,229,998.14	71.98

(三)基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002179	中航光电	6,988,306	157,236,885.00	7.06
2	002050	三花股份	4,000,000	133,200,000.00	5.98
3	600056	中国医药	4,300,003	110,768,077.28	4.97
4	000426	誉龙热电	6,550,000	110,695,000.00	4.97
5	601166	兴业银行	8,000,036	107,840,485.28	4.84
6	600046	中国电源	2,750,901	99,857,706.30	4.48
7	601088	中国神华	2,999,922	90,419,758.88	4.06
8	600594	蓝盾药业	4,300,040	79,077,735.60	3.55
9	000858	五粮液	2,150,007	76,798,250.04	3.45
10	000799	燕京啤酒	3,800,000	70,680,000.00	3.17

(四)按券种分类的债券投资组合
 本基金本报告期末未持有债券。

(五)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
 本基金本报告期末未持有债券。

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细
 本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)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权证投资明细
 本基金本报告期末未持有权证。

八、投资组合报告附注
 1.报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内只有五粮液受到行政处罚。

根据五粮液2011年5月27日公告,该公司因信息披露存在违法,被中国证券监督管理委员会对公司和相关人员处以警告和罚款,公司接受处罚并进行了整改。对该股投资决策程序的说明:经过跟踪调研,基金管理人认为相关问题对上市公司经营和现金流未构成重大影响,由于看好行业和该股票长期的业绩增长潜力,经研究员推荐,基金管理人做出购买决策。

2.本基金所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.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	2,457,461.73
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	131,758.24
5	应收申购款	76,885.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,666,105.25

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,分项与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩
 本基金合同生效日为2007年1月19日,基金合同生效以来的投资业绩及与同期基准的比较如下表所示: (截止2011年6月30日):

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2007年1月19日至2007年12月31日	83.55%	1.89%	64.02%	1.63%	19.53%	0.26%
2008年度	-51.01%	2.06%	-53.05%	2.14%	2.04%	-0.08%
2009年度	66.06%	1.50%	57.06%	1.42%	9.00%	0.08%
2010年度	-12.96%	1.52%	-9.97%	1.06%	-2.99%	0.46%
2011年上半年	-6.68%	1.18%	-6.64%	0.81%	-0.04%	0.37%
过去3个月	-6.46%	1.06%	-4.01%	0.75%	-2.45%	0.31%
自基金合同生效起至今	21.30%	1.72%	8.19%	1.56%	13.11%	0.16%

十三、费用概览
 (一)与基金运作有关的费用

1.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基金交易费用;
 ④基金证券管理费、印花税;
 ⑤基金信息披露费用;
 ⑥基金持有人大会费用;
 ⑦与基金相关的会计师费用和律师费用;
 ⑧按照国家有关规定可以列入的其他费用。
 本基金费用由基金托管人从基金财产中支付。

2.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
 基金管理人的管理费以基金资产净值1.5%的年费率计提,具体计算方法如下:
 在通常情况下,本基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提,计算方法如

下:
 $H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$, H为每日应付的基金管理费, E为前一日的基金资产净值。
 基金管理人的管理费每日计算,逐日累计至每月最后一个工作日,经公众假期延至节假日结束后的第一个工作日,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

②基金托管人的托管费
 本基金应给基金托管人托管费,按前一日基金资产净值的2.5%的年费率计提,计算方法如下:
 $H = E \times 2.5\% \div \text{当年天数}$, H为每日应付的基金托管费, E为前一日的基金资产净值。
 基金托管人的托管费每日计算,基金托管费计算逐日累计至每月月底,按月支付,由基金托管人于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支取。

③其他费用
 上述①中其他费用由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额从基金财产中支付,列入当期基金费用。

3.不列入基金费用的项目
 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,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。

4.基金管理人及基金托管人可磋商酌情降低基金管理费和基金托管费,经中国证监会核准后公告,无须召开基金份额持有人大会。

C. 与基金销售有关的费用

1.基金认购费用
 本基金认购费率不超过1%。
 本基金只接受金额认购,认购金额包括认购费用和净认购金额,其中,
 认购费用 = 认购金额×认购费率
 净认购金额 = 认购金额-认购费用
 认购份数 = 净认购金额÷基金份额净值
 认购的有效认购保留小数点后两位,小数点后两位以后的部分舍去,舍去部分所代表的资产归基金所有。

本基金的认购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

2.申购费
 本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额,其中,
 净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
 申购费用=申购金额-净申购金额
 申购份数=净申购金额/T日基金份额净值
 本基金的申购费按申购金额采用比例费率,投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算,费率表如下:

基金名称	转入基金	转换金额	申购补差费率
宝盈鸿利收益混合(213001)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0
	宝盈策略增长股票(213003)	100万元≤M≤500万元	0.30%
宝盈泛沿海增长股票(213002)	宝盈策略增长股票(213003)	500万元≤M≤1000万元	0.30%
	宝盈策略增长股票(213003)	M≥1000万元	0
宝盈核心优势混合(213006)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0
	宝盈策略增长股票(213003)	100万元≤M≤1000万元	0.60%
宝盈增强收益债券A(213007)	宝盈策略增长股票(213003)	100万元≤M≤300万元	1.00%
	宝盈策略增长股票(213003)	300万元≤M≤500万元	1.20%
宝盈增强收益债券C(213017)	宝盈策略增长股票(213003)	500万元≤M≤1000万元	0.90%
	宝盈策略增长股票(213003)	M≥1000万元	1.50%
宝盈资源优选股票(213005)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0
	宝盈策略增长股票(213003)	100万元≤M≤500万元	0.60%
宝盈货币(A类:213009、B类:213009)	宝盈策略增长股票(213003)	500万元≤M≤1000万元	0.90%
	宝盈策略增长股票(213003)	M≥1000万元	1.50%
宝盈中证100指数增强(213010)	宝盈策略增长股票(213003)	300万元≤M≤500万元	1.20%
	宝盈策略增长股票(213003)	500万元≤M≤1000万元	0.90%
宝盈策略增长股票(213003)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0
	宝盈策略增长股票(213003)	100万元≤M≤500万元	0
宝盈泛沿海增长股票(213002)	宝盈策略增长股票(213003)	M<100万元	0
	宝盈策略增长股票(213003)	100万元≤M≤500万元	0
宝盈策略增长股票(213003)	宝盈策略增长股票(213003)	500万元≤M≤1000万元	0
	宝盈策略增长股票(213003)	M≥1000万元	0

金鹰策略配置股票型证券投资基金基金合同生效公告

公告送出日期:2011年9月2日

注:① 本基金设立募集期募集资金及产生的利息金额合计为85,180.81元,折合基金份额为85,180.81份,已全部计入基金份额持有人的基金账户,归基金份额持有人所有。

② 上述募集期间基金管理人的从业人员认购的基金份额158,104.98份为含募集期利息结转的份额。

③ 本基金基金合同生效前的信息披露费、会计师费、律师费等费用由本基金管理人承担,不从基金财产中列支。

④ 根据相关法律法规和《金鹰策略配置股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金已符合基金备案条件,本基金管理人已向中国证监会办理基金备案手续,并于2011年9月1日获书面确认,基金合同自该日起正式生效,基金合同生效日,本基金基金份额总额为805,601.019份,自基金合同生效之日起起本基金经理人正式开始管理本基金,杨绍基先生任职本基金经理。

3 其他需要提示的事项
 ① 本基金自基金合同生效之日起不超过3个月内开始办理申购、赎回,本基金办理申购、赎回业务的具体时间由本基金管理人最迟于申购、赎回开放日前2日至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告及本基金管理人互联网站(www.gcfund.com.cn)公告,投资者如有疑问,请拨打本基金管理人客户服务电话4006-135-888或登录本基金管理人网站获取相关信息。

② 风险提示:本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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。本基金管理人提醒投资人在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行承担,投资者投资本基金时应认真阅读本基金的《基金合同》、《招募说明书》等文件。

金鹰基金管理有限公司
 2011年9月2日

关于汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金增加广发银行为代销机构的公告

汇添富深证300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(基金代码:470068;基金简称:汇添富深证300ETF联接)的发行期为2011年8月26日至2011年9月26日,根据汇添富基金管理有限公司(以下简称"本公司")与广发银行股份有限公司(以下简称"广发银行")签署的代销协议,汇添富深证300ETF联接基金自2011年9月2日起将增加广发银行为代销销售机构。

一、重要提示
 1、投资者在广发银行办理汇添富深证300ETF联接基金的认购投资业务,具体办理规则及程序请遵循广发银行的规定。

2、投资者欲了解汇添富深证300ETF联接基金的详细情况,请仔细阅读刊登于本公司网站(www.99fund.com)的《基金合同》、《招募说明书》等法律文件,以及相关业务公告。

二、投资者可通过以下途径咨询有关详情

汇添富基金管理有限公司
 2011年9月2日

证券代码:002048 证券简称:宁波华翔 公告编号:2011-052

宁波华翔电子股份有限公司关于回购部分社会公众股份进展情况的公告

本公司全体董事、监事、高级管理人员保证公告内容真实、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责任。

宁波华翔电子股份有限公司(以下简称"本公司")2011年回购部分社会公众股份的方案于2011年6月1日经公司2011年第二次临时股东大会审议通过,2011年6月24日本公司公告了《关于回购部分社会公众股份的报告书》(详见公司2011-030号公告),根据《深圳证券交易所上市公司以集中竞价交易方式回购股份业务指引》的有关规定,现将2011年8月公司股份回购进展情况公告如下:

由于本月本公司参股子公司富奥汽车零部件股份有限公司公告了拟通过新增股份吸收合并方式借壳"广东盛润"的预案,本公司公告2011年半年报等原因,2011年8月,公司未进行回购股份。

截至2011年8月31日,公司已回购股份数共计1,645,700股,占公司总股本的0.62%为2.9%,成交的最高价为12.39元,最低价为11.85元,支付总金额为1999.93万元(含印花税费、佣金等交易费用)。

公司回购期限为自股东大会审议通过回购股份方案之日起6个月内进行,即到2011年11月30日止,公司将依据相关规定严格履行信息披露义务。

特此公告。

宁波华翔电子股份有限公司
 董事会
 2011年9月2日

证券代码:002182 证券简称:云海金属 公告编号:2011-20

南京云海特种金属股份有限公司关于开通投资者关系互动平台及举行2011年半年度报告网上业绩说明会的公告

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,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

为了更好地加强投资者管理工作,使投资者更好的了解公司的发展情况,南京云海特种金属股份有限公司(以下简称"公司")决定开通投资者关系互动平台,方便广大投资者与公司更好的沟通和交流。互动平台网址为: http://irm.p5w.net/sgss/S002182/

1、2011年半年度报告已于2011年7月30日发布,利用上述互动平台,公司将于2011年9月7日(星期三)下午15:00-17:00点举行2011年半年度报告业绩说明会,现将有关事项公告如下:

本次业绩说明会将在深圳证券信息有限责任公司提供的网上互动网络平台采取网络远程的方式举行,投资者可以登陆公司互动平台或"南京上市公司投资者关系互动平台"(http://irm.p5w.net/eqhd/nanjing/)参与本次半年度报告网上业绩说明会。

出席本次半年度报告网上说明会的人员有:公司董事长杨小明先生、董事会秘书李剑飞女士、财务负责人范乃娟女士。

欢迎广大投资者积极参与。

南京云海特种金属股份有限公司
 董事会
 二〇一一年九月二日

证券代码:002546 证券简称:新联电子 公告编号:2011-024

南京新联电子股份有限公司关于举行2011年半年度报告网上业绩说明会的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

南京新联电子股份有限公司(以下简称"公司")2011年半年度报告已于2011年7月28日发布,为了使投资者更好的了解公司的发展情况,公司将于2011年9月7日(星期二)下午15:00-17:00举行2011年半年度报告网上业绩说明会,本次说明会将在深圳证券信息有限责任公司提供的网上互动网络平台采取网络远程的方式举行,投资者可以登录公司互动平台(http://irm.p5w.net/eqhd/nanjing/)或"南京上市公司投资者关系互动平台"(http://irm.p5w.net/eqhd/nanjing/)参与本次说明会。

出席本次半年度报告网上业绩说明会的人员有:公司董事长杨斌先生、财务总监李宇先生。

欢迎广大投资者积极参与。

南京新联电子股份有限公司
 董事会
 2011年9月2日

证券代码:002040 证券简称:南京港 公告编号:2011-018

南京港股份有限公司更正公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

南京港股份有限公司于2011年8月12日在巨潮资讯网披露了2011年半年度报告全文及摘要,因工作疏忽,全文及摘要中的"主要会计数据和财务指标"表中部分数据填写有误,更正如下:

"归属于上市公司股东的扣除非经常性损益后的净利润"上年同期数据原为24,212,628.00,更正为12,767,575.54;"加权平均净资产收益率"和"扣除非经常性损益后的加权平均净资产收益率"报告期0-6月"数据原为3.65%,更正为3.78%。与更正对应的"本报告期末末上年度报告期末末"数据相应调整为64.93%、1.37%、1.39%。

更正后的2011年半年度报告全文和摘要详见巨潮资讯网,公司董事会向广大投资者深表歉意。

特此公告。

南京港股份有限公司
 董事会
 2011年9月2日

申购金额(含申购费)	费率
500万元以下	1.5%
500万元-1000万元(含500万元)	0.9%
1000万元以上(含1000万元)	固定费用1000元

本基金的申购费用可用于市场推广、销售、注册登记等各项费用。

3.赎回费
 本基金的赎回金额为赎回总额扣减赎回费用,其中,
 赎回总额=赎回份数×T日基金份额净值
 赎回费用=赎回总额×赎回费率
 赎回金额=赎回总额-赎回费用
 赎回费用根据持有天持有基金的期限递减,最高不超过赎回总额的0.50%,作为注册登记费,费率表如下:

持有基金份额的期限	费率
1年以内	-
1年-2年(含1年)	0.25%
2年以上(含2年)	免收

在持有期内持有人多次申购基金的,赎回时按照先进先出的原则计算。
 赎回费用归入基金财产的比例规定为赎回费总额的百分之二十五,余额为注册登记费和其他手续费。