

(上接C10版)

法定代表人:蒋正中  
电话:0431-85096709  
传真:0431-85096795  
联系人:潘娜  
客服电话:400-600-0686  
公司网站:www.nesc.cn  
03 旧恒信证券有限责任公司  
住所:贵阳市南明区林城南路18号  
办公地址:贵阳市南明区林城南路18号  
法定代表人:孔佑杰  
电话:010-88086830  
传真:010-66412537  
联系人:陈科松、张晓光  
客服电话:010-88086830  
公司网站:www.rmj.com.cn  
04 联生证券有限责任公司  
住所:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层  
办公地址:北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16-20层  
法定代表人:吕献春  
电话:010 85127999  
传真:010 85127917  
联系人:赵明  
客服电话:400-619-8888  
网址:www.mscq.com  
05 东英证券股份有限公司  
住所:苏州工业园区翠园路181号  
办公地址:苏州工业园区翠园路181号  
法定代表人:吴永刚  
电话:0512-65581136  
传真:0512-6558021  
联系人:方晓丹  
客户服务电话:0512-33396288  
公司网站:www.dawg.com.cn  
基金管理人可根据有关法律法规规定,选择其他符合要求的机构代销销售本基金,并及时公告。  
C. 注册登记人:国投瑞银基金销售有限公司  
住所:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层  
办公地址:深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心46层  
法定代表人:杨毅  
电话:0755 83575836  
传真:0755 82912534  
联系人:冯博  
客服电话:400-880-6868  
D. 律师事务所  
名称:上海锦天城律师事务所  
住所:北京市西城区东三环中路39号建外SOHO A座31层  
办公地址:北京市朝阳区东三环中路39号建外SOHO A座31层  
负责人:王玲  
经办律师:靳庆军、宋萍萍  
电话:010 58785588  
传真:010 58785599  
联系人:宋萍萍  
E. 会计师事务所  
名称:安永华明会计师事务所  
住所:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层  
办公地址:北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼16层  
法定代表人:葛明  
电话:010 58153000、0755 25028288  
传真:010 85188298、0755 25026118  
常任注册会计师:张介东、陶明  
联系人:李妍明  
四、基金的名称  
本基金名称:国投瑞银华信债券型证券投资基金。  
五、基金的类型  
本基金类型:契约型开放式。  
六、基金的投资目标  
本基金的投资目标:追求低风险的稳定收益,即以债券投资为主,稳健收益型股票投资为辅,在有效控制风险的前提下,谋求基金投资长期稳定增长。  
七、基金的投资范围  
本基金的投资范围:具有良好流动性、长期收益稳定的金融工具,包括国内依法发行的国债、金融债、企业债、可转债、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、资产支持证券、权证以及国债回购、股指期货等法律法规允许本基金投资的证券及金融工具。投资于国债、金融债和信用等级的企业债(含可转债债券)为主要投资方向,以稳健收益型股票为辅助投资对象。债券投资不少于基金资产净值的40%,持仓比例调整范围是0-40%,股票投资的最大比例不超过40%,持仓比例调整范围是0-40%,除了预期有上升趋势的市场,原则上股票投资比例控制在20%以内。  
八、基金的投资策略  
1. 本基金投资策略包括以下几个方面:  
2. 根据收益率、流动性及风险匹配原则以及证券的低估值原则构建投资组合,合理配置不同市场和不同投资工具的投资比例,并根据投资环境的变化相机调整。具体包括:  
3. 根据未来利率变化预期,以久期、凸性和跟踪误差为中心,合理配置固定、中期和长期品种并结构,控制利率风险,把不同券种利率套利空间,对未到期利率品种,除了做好久期匹配管理,本基金还将合理配置固定利率债券与浮动利率债券的比例。  
4. 择机运用利率债套利工具,无风险套利和参与一级市场承销或申购等手段,规避利率风险,增加盈利机会。  
C. 权证投资策略:  
1. 考量标的股票合理价值、标的股票价格、行权价格、行权时间、行权方式、股价历史与预期波动率及无风险收益率等因素,估计权证合理价值。  
2. 根据权证合理价值与其市场价格的差额(即溢价率 Value Price)以及权证合理价值对定价参数的敏感性,结合标的股票合理价值考量,决策买入、持有或卖出权证。  
3. 根据本基金的风险收益特征,确定本基金权证投资的具体比例。  
5. 在将来衍生工具市场得到发展的情况下,本基金将使用衍生产品市场,控制风险,并把握获利机会。  
C. 投资决策  
1. 决策依据  
1) 国家有关法律、法规和基金合同的有关规定;  
2) 国内外经济形势、利率变化趋势以及行业与上市公司基本面研究;  
3) 对标的股票收益和风险的动态关系,本基金将在充分研究投资对象的风险和收益的前提下做出投资决策。  
2. 投资决策与操作程序  
根据投资管理原则,本基金采取投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	368,161,265.72	39.47
	其中:股票	368,161,265.72	39.47
2	固定收益投资	542,703,255.62	58.18
	其中:债券	542,703,255.62	58.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	14,577,142.43	1.56
6	其他各项资产	7,312,321.96	0.78
7	合计	932,753,985.73	100.00

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,687,038.35	0.61
B	采掘业	4,187,338.05	0.45
C	制造业	207,406,148.33	22.36
CO	食品、饮料	33,320,544.73	3.59
C1	纺织、服装、皮毛	24,086,792.92	2.60
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	造纸、化学、塑胶、塑料	22,954,563.40	2.47
C5	电子	30,294,164.26	3.27
C6	金属、非金属	12,296,405.00	1.33
C7	机械、设备、仪表	55,647,805.30	6.00
C8	医药、生物制品	28,805,873.72	3.11
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	72,194,274.36	7.78
G	信息技术业	7,453,658.16	0.80
H	批发和零售业	33,574,571.63	3.62
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	13,019,375.00	1.40
K	社会服务业	24,638,861.84	2.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	368,161,265.72	39.47

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	600125	铁龙物流	7,567,534	72,194,274.36	7.78
2	002344	海宁皮城	1,335,012	31,492,933.08	3.39
3	002223	鱼跃医疗	1,269,716	31,488,956.80	3.39
4	000799	酒鬼酒	1,380,137	28,693,048.23	3.09
5	600233	大杨创世	1,786,854	24,086,791.92	2.60
6	300198	纳川股份	1,087,894	22,954,563.40	2.47
7	600366	宁波银行	1,130,518	21,555,164.26	2.31
8	600436	片仔癀	335,262	20,486,962.76	2.22
9	600763	通策医疗	880,496	16,448,296.64	1.74
10	600448	保利地产	1,407,500	13,019,375.00	1.40

基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。  
4.3 其他法律法规规定的事项。  
4.4 基金合同生效后3年内,添利A的赎回费率为零。  
4.5 其他法律法规规定的事项。  
4.6 赎回价格以未知价"原则,即添利A的赎回价格以开放日收市后计算的添利A的基金份额参考净值为基础进行计算。  
4.7 其于开放日结束后,所有经确认有效的添利A的赎回申请全部予以成交确认。  
5. 基金销售机构  
5.1 直销机构  
万家基金管理有限公司直销中心及网上交易平台  
地址:上海浦东新区世纪大道360号东家国际大厦9楼  
电话:021-38619987  
传真:021-38619978  
联系人:胡晓  
投资者可以通过本公司网上交易系统办理添利A的申购、赎回业务,具体交易细则请登录本公司网站查询相关信息。网上交易系统地址:https://trade.wjasset.com。  
5.2 场外代销机构  
1) 中国银行股份有限公司  
客服电话:95588  
网址:www.cib.com.cn  
2) 中国工商银行股份有限公司  
客服电话:95588  
网址:www.icbc.com.cn  
3) 齐鲁证券有限公司  
客服电话:95538  
网址:www.qlqz.com  
4) 中国银河证券股份有限公司  
客服电话:400-888-8888  
公司网站地址:www.chinastock.com.cn  
5) 民生证券股份有限公司  
客服电话:400-688-8888  
公司网站地址:www.msq.com.cn  
6) 中国民生证券有限责任公司  
客服电话:400-889-5618  
公司网站地址:www.mscq.com.cn  
7) 东吴证券股份有限公司  
客服电话:0512-33396288  
公司网站地址:www.dwzq.com.cn  
8) 方正证券有限责任公司  
客服电话:400-889-8888  
公司网站地址:www.fhazq.com.cn  
9) 方正证券股份有限公司  
客服电话:021-63340678  
公司网站地址:www.fzjz.com.cn  
10) 光大证券股份有限公司  
客服电话:95579或4008-888-999  
公司网站地址:www.e579.com

## 关于万家添利分级债券型证券投资基金之添利A份额第一次开放申购、赎回业务的公告

公告送出日期:2011年11月28日  
1. 公告基本信息  
基金名称:万家添利分级债券型证券投资基金  
基金简称:万家添利分级债券  
基金代码:161908  
基金运作方式:契约型  
基金合同生效日:2011年6月2日  
基金管理人名称:万家基金管理有限公司  
基金托管人名称:中国银行股份有限公司  
基金注册登记机构名称:中国证券登记结算有限责任公司  
公告依据:《万家添利分级债券型证券投资基金基金合同》和《万家添利分级债券型证券投资基金招募说明书》  
申购起始日:2011年12月1日  
赎回起始日:2011年12月1日  
下方分级基金的基础简称:万家利A 万家利B  
下方分级基金的交易代码:161909 150038  
该分级基金是否开放申购、赎回:是 否  
注:根据基金合同、招募说明书的规定,本次申购、赎回截止日亦为2011年12月1日,即基金管理人应在该日为添利A份额持有人办理申购、赎回业务。半年后开放下一次申购、赎回。  
2. 申购、赎回业务办理时间  
1) 申购:申购业务办理时间:添利A在基金合同生效后每满半年开放一次,接受投资者的申购与赎回,开放日为基金合同生效后每满半年的最后一个工作日,如该日为非工作日,则为一个工作日。根据本基金合同的规定,添利A的第一个开放日为2011年12月1日,此次添利A申购、赎回业务办理时间为该日的交易时间。  
2) 赎回:不可抗力或其他情形致使基金无法按时开放申购与赎回的,开放日为不可抗力或其他情形影响因素消除之后的下一个工作日。  
3. 申购业务  
3.1 申购金额限制  
1) 投资者首次申购时,单笔最低申购金额为1000元。  
2) 投资者申购或赎回时,通过本基金的直销机构及场外代销机构申购时,原则上,每笔申购本基金的最低金额为1000元,实际操作中,各销售机构可根据自己的情况调整本基金的最低申购金额。  
3) 基金管理人、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司可根据市场情况在不违反相关法律法规规定的前提下,调整上述申购金额和赎回持有基金份额上限的数量限制。基金管理人必须在调整前2个工作日内至少以一种中国证监会指定的媒体上刊登公告并报中国证监会备案。  
3.2 申购费率  
1) 本基金的申购费率为零。  
2) 其他与申购相关的事项  
申购价格为"未知价"原则,即添利A的申购价格以开放日收市后计算的添利A的基金份额参考净值为基础进行计算。  
4. 赎回业务  
4.1 赎回费率限制  
1) 本基金不设场外单笔最低赎回份额;  
2) 基金份额持有场内申购时,赎回份额必须是整数份额,并且每笔赎回最大不超过99,999,999份基金份额。  
基金份额持有人在赎回时或赎回后在销售机构 6 个月保留的基金份额余额不足 1.00 份的,在赎回时需一次全部赎回,基金管理人可以根据法律法规允许的情况下,调整上述赎回份额的数量限制,基金管

## 关于新增平安证券有限责任公司为浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金代销机构的公告

根据浙商基金管理有限公司(以下简称"本公司")与平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")签署的代理销售协议,自2011年11月28日起平安证券开始代理本公司旗下的浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金(基金代码:688888)的销售业务。投资者自11月28日起可在平安证券的营业网点办理该基金的申购及其他业务。  
投资者可通过以下途径咨询相关情况:  
一、浙商基金管理有限公司  
办公地址:浙江省杭州市文三西路90号东部软件园1号楼2楼(邮编:310021)  
电话:(0571)-28191852  
传真:(0571)-28191836  
联系人:张伊丽  
客户服务电话:0571-2882 2288、4006-321-321(长途收费)  
公司网站:www.zsfund.com  
二、平安证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(邮编:518033)

证券代码:002433 证券简称:太安堂 公告编号:2011-042  
广东太安堂药业股份有限公司  
重大事项停牌公告  
本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。广东太安堂药业股份有限公司(以下简称"公司")正策划重大资产重组,由于本次重大资产重组存在不确定性,根据《深圳证券交易所股票上市规则》的有关规定,为避免股价异常波动,保护广大投资者的利益,经本公司向深圳证券交易所申请,公司股票(股票代码:太安堂,股票代码:002433)于2011年11月28日起停牌,待刊登相关公告后复牌。公司将及时披露相关重大事项的进展情况,敬请广大投资者注意投资风险。特此公告。  
广东太安堂药业股份有限公司董事会  
二〇一一年十一月二十八日

投资决策与操作流程控制包括投资研究流程、投资对象选择标准的确定、资产配置与重大投资项目提案的审核、投资执行的审核与程序、投资组合调整与反馈以及风控与监控过程。  
4. 投资决策委员会通过定期和不定期会议,对宏观经济形势、利率走势、微观经济运行环境和证券市场走势等进行综合分析,制定本基金投资组合的资产配置比例等重大决策。  
5. 研究部根据自身研究成果,出具宏观经济分析、投资策略、债券分析、行业分析和上市公司研究等各类报告和投资建议,为投资决策委员会和基金经理提供决策依据。  
6. 基金经理在遵守投资决策委员会确定的投资原则的前提下,根据研究部提供的投资建议、其它信息和建议和自己的分析判断,做出具体的投资决策,构建投资组合。  
4. 合规与风险控制委员会定期召开会议,对基金投资组合进行绩效和风险评估,并提出风险控制意见。  
6. 基金管理人有权根据环境的变化和实际的需要对上述投资决策程序进行合理的调整。  
3. 权证投资策略  
1) 本基金管理人对于基金权证投资实行严格的授权管理制度,各基金对权证的投资,必须在相应的授权范围内操作。超出基金投资授权范围的投资决策,必须分别经投资部总监、分管投资的副总经理或投资决策委员会批准后,才能执行。  
2) 本基金管理人基金投资管理交易程序中,设置有关权证投资交易阀值,确保基金权证投资符合各项比例限制和风险控制。  
3) 原则上,各相关基金不得投资沪深300成份股以外的公司发行的权证和注册资本在10亿元人民币以下的证券公司发行的权证产品。投资于该限制之外的权证,必须经本基金管理人投资决策委员会审核批准。  
4) 交易所负责具体的交易执行,履行一线监控的职责,监控内容包括但不限于权证投资比例要求、投资权限等。  
5) 监察稽核部负责对权证投资的合法、合规性进行监控。  
6) 稽核国际通用的权证风险管理方法,评估权证及其组合风险,并与标的股票合并风险管理。  
九、基金的业绩比较标准  
业绩比较基准=80%×中信标普综合指数+20%×中信标普300指数  
十、基金的风险收益特征  
本基金的风险收益特征:本基金属于中长期风险相对可控、预期收益相对稳定的低风险基金品种,具有低风险、收益低的特征,中长期长期风险回报高于单纯的债券基金品种,低于以股票为主要投资对象的基金品种。

十一、基金的投资组合报告  
截止本报告期末(报告截至2011年9月30日,本报告中列示的数据未经审计)。  
1. 基金投资组合情况  
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	368,161,265.72	39.47
	其中:股票	368,161,265.72	39.47
2	固定收益投资	542,703,255.62	58.18
	其中:债券	542,703,255.62	58.18
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	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	14,577,142.43	1.56
6	其他各项资产	7,312,321.96	0.78
7	合计	932,753,985.73	100.00

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,687,038.35	0.61
B	采掘业	4,187,338.05	0.45
C	制造业	207,406,148.33	22.36
CO	食品、饮料	33,320,544.73	3.59
C1	纺织、服装、皮毛	24,086,792.92	2.60
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	造纸、化学、塑胶、塑料	22,954,563.40	2.47
C5	电子	30,294,164.26	3.27
C6	金属、非金属	12,296,405.00	1.33
C7	机械、设备、仪表	55,647,805.30	6.00
C8	医药、生物制品	28,805,873.72	3.11
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	72,194,274.36	7.78
G	信息技术业	7,453,658.16	0.80
H	批发和零售业	33,574,571.63	3.62
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	13,019,375.00	1.40
K	社会服务业	24,638,861.84	2.66
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	368,161,265.72	39.47

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	600125	铁龙物流	7,567,534	72,194,274.36	7.78
2	002344	海宁皮城	1,335,012	31,492,933.08	3.39
3	002223	鱼跃医疗	1,269,716	31,488,956.80	3.39
4	000799	酒鬼酒	1,380,137	28,693,048.23	3.09
5	600233	大杨创世	1,786,854	24,086,791.92	2.60
6	300198	纳川股份	1,087,894	22,954,563.40	2.47
7	600366	宁波银行	1,130,518	21,555,164.26	2.31
8	600436	片仔癀	335,262	20,486,962.76	2.22
9	600763	通策医疗	880,496	16,448,296.64	1.74
10	600448	保利地产	1,407,500	13,019,375.00	1.40

基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体上公告并报中国证监会备案。  
4.3 其他法律法规规定的事项。  
4.4 基金合同生效后3年内,添利A的赎回费率为零。  
4.5 其他法律法规规定的事项。  
4.6 赎回价格以未知价"原则,即添利A的赎回价格以开放日收市后计算的添利A的基金份额参考净值为基础进行计算。  
4.7 其于开放日结束后,所有经确认有效的添利A的赎回申请全部予以成交确认。  
5. 基金销售机构  
5.1 直销机构  
万家基金管理有限公司直销中心及网上交易平台  
地址:上海浦东新区世纪大道360号东家国际大厦9楼  
电话:021-38619987  
传真:021-38619978  
联系人:胡晓  
投资者可以通过本公司网上交易系统办理添利A的申购、赎回业务,具体交易细则请登录本公司网站查询相关信息。网上交易系统地址:https://trade.wjasset.com。  
5.2 场外代销机构  
1) 中国银行股份有限公司  
客服电话:95588  
网址:www.cib.com.cn  
2) 中国工商银行股份有限公司  
客服电话:95588  
网址:www.icbc.com.cn  
3) 齐鲁证券有限公司  
客服电话:95538  
网址:www.qlqz.com  
4) 中国银河证券股份有限公司  
客服电话:400-888-8888  
公司网站地址:www.chinastock.com.cn  
5) 民生证券股份有限公司  
客服电话:400-688-8888  
公司网站地址:www.msq.com.cn  
6) 中国民生证券有限责任公司  
客服电话:400-889-5618  
公司网站地址:www.mscq.com.cn  
7) 东吴证券股份有限公司  
客服电话:0512-33396288  
公司网站地址:www.dwzq.com.cn  
8) 方正证券有限责任公司  
客服电话:400-889-8888  
公司网站地址:www.fhazq.com.cn  
9) 方正证券股份有限公司  
客服电话:021-63340678  
公司网站地址:www.fzjz.com.cn  
10) 光大证券股份有限公司  
客服电话:95579或4008-888-999  
公司网站地址:www.e579.com

## 关于增加光大证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告

根据浙商基金管理有限公司(以下简称"本公司")与光大证券股份有限公司(以下简称"光大证券")签订的代理销售协议,自2011年11月28日起光大证券开始代理本公司旗下的浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金(基金代码:688888)的销售业务。投资者自11月28日起可在光大证券的营业网点办理该基金的申购及其他业务。  
投资者可通过以下途径咨询相关情况:  
一、浙商基金管理有限公司  
办公地址:浙江省杭州市文三西路90号东部软件园1号楼2楼(邮编:310021)  
电话:(0571)-28191852  
传真:(0571)-28191836  
联系人:张伊丽  
客户服务电话:0571-2882 2288、4006-321-321(长途收费)  
公司网站:www.zsfund.com  
二、光大证券股份有限公司  
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(邮编:518033)

## 关于新增平安证券有限责任公司为浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金代销机构的公告

根据浙商基金管理有限公司(以下简称"本公司")与平安证券有限责任公司(以下简称"平安证券")签署的代理销售协议,自2011年11月28日起平安证券开始代理本公司旗下的浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金(基金代码:688888)的销售业务。投资者自11月28日起可在平安证券的营业网点办理该基金的申购及其他业务。  
投资者可通过以下途径咨询相关情况:  
一、浙商基金管理有限公司  
办公地址:浙江省杭州市文三西路90号东部软件园1号楼2楼(邮编:310021)  
电话:(0571)-28191852  
传真:(0571)-28191836  
联系人:张伊丽  
客户服务电话:0571-2882 2288、4006-321-321(长途收费)  
公司网站:www.zsfund.com  
二、平安证券有限责任公司  
注册地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼(邮编:518033)

证券代码:002433 证券简称:太安堂 公告编号:2011-042  
广东太安堂药业股份有限公司  
重大事项停牌公告  
本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。广东太安堂药业股份有限公司(以下简称"公司")正策划重大资产重组,由于本次重大资产重组存在不确定性,根据《深圳证券交易所股票上市规则》的有关规定,为避免股价异常波动,保护广大投资者的利益,经本公司向深圳证券交易所申请,公司股票(股票代码:太安堂,股票代码:002433)于2011年11月28日起停牌,待刊登相关公告后复牌。公司将及时披露相关重大事项的进展情况,敬请广大投资者注意投资风险。特此公告。  
广东太安堂药业股份有限公司董事会  
二〇一一年十一月二十八日

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	53,571,297.80	5.77
2	央行票据	117,743,000.00	12.69
3	金融债券	148,230,000.00	15.98
	其中:政策性金融债	148,230,000.00	15.98
4	企业债券	31,136,289.42	3.36
5	中期票据	-	-
6	短期融资券	-	-
7	可转债	192,022,668.40	20.70
8	其他	-	-
9	合计	542,703,255.62	58.50

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113002	工行转债	650,300	66,304,588.00	7.15
2	110015	石化转债	660,720	57,753,535.20	6.23
3	110412	11农发12	500,000	49,910,000.00	5.38
4	110023	11央行票据32	500,000	49,780,000.00	5.37
5	100203	10国开03	500,000	48,780,000.00	5.26

6. 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。  
7. 按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名权证投资明细  
本基金本报告期末未持有权证。  
8. 报告期末投资组合情况  
1) 本基金投资的前十名证券发行主体本期没有受到监管部门立案调查的,在报告编制日前一年内也未受到公开谴责、