

(上接D10版)
 在保持流动性的前提下,本基金现金头寸可存放于境内,满足基金赎回、支付管理费、托管费、保费等等需要,并可以投资货币市场工具。

如法律法规或监管机构以后允许基金直接投资实物黄金、除黄金ETF外的其他形式的交易所交易黄金产品、黄金收益凭证、或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具(包括但不限于以后在国内上市、以跟踪黄金价格或黄金价格指数为目的的ETF,以及在国内/外上市的黄金期货合约、黄金期权合约以及其他黄金衍生品等),基金管理人可在与基金托管人协商一致并履行相关程序后,可以将其纳入投资范围并相应调整本基金的投资比例限制规定,不需经基金份额持有人大会审议。

如法律法规或监管机构以后允许本基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

三、投资限制
 下列投资限制为引用时有效的法律法规或监管部门的其他限制性规定,如法律法规或监管部门取消或调整上述限制性规定,本基金在履行适当程序后,可不受下列限制。

- 1.禁止行为
 为维护基金份额持有人的合法权益,本基金禁止从事下列行为:
 ① 承销证券;
 ② 向他人贷款或提供担保;
 ③ 从事承担无限责任的投资;
 ④ 购买不动产;
 ⑤ 购买房地产抵押按揭;
 ⑥ 购买贵金属或代表贵金属的凭证;
 ⑦ 购买实物商品;
 ⑧ 除应付赎回、交易清算等临时用途外,借入现金;
 ⑨ 利用融资购买证券,但投资资金来源于衍生品除外;
 ⑩ 参与未持有基础资产的空买交易;
 ⑪ 购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层;
 ⑫ 直接投资与实物商品相关的衍生品;
 ⑬ 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或债券;

⑭ 买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券;
 ⑮ 从事内幕交易、操纵证券价格及其他不正当的证券交易活动;
 ⑯ 当时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

2.投资组合限制
 本基金的投资将遵循以下限制:
 ① 本基金持有同一银行的存款不得超过基金净值的20%。在基金托管账户的存款可以不受上述限制。
 ② 本基金持有同一机构(政府、国际金融组织除外)发行的证券市值不得超过基金净值的10%。

③ 本基金持有与中国证监会签署双边监管合作谅解备忘录国家或地区以外的其他国家或地区证券市场挂牌交易的证券资产不得超过基金资产净值的10%,其中持有同一国家或地区市场的证券资产不得超过基金资产净值的3%。
 ④ 本基金不得购买证券用于控制或影响发行该证券的机构或其管理层。本基金管理的全部基金不得持有同一机构10%以上具有投票权的证券发行总量。指数基金可以不受上述限制。

前款投资比例限制应当合并计算同一机构境内上市的所有证券,同时应当一并计算全球存托凭证和美国存托凭证所代表的基础证券,并据以对持有的股本权证进行转换。
 5.基金持有非流动性资产市值不得超过基金净值的10%。
 前款非流动性资产是指法律法规或基金合同约定的流通受限证券以及中国证监会认定的其他资产。

6.本基金资产的全部基金持有任一境外债券,不得超过该境外基金总份额的20%。
 7.为应付赎回、交易清算等临时用途而借入现金的比例不得超过基金资产净值的10%。
 8. 每只境外基金投资比例不得超过本基金资产净值的20%。本基金投资境外基金形成的该等基金应当视为一只基金。

9.本基金不得投资以下基金:
 ① 避险基金(A Hedge Fund);
 ② 投资于前述两项基金的伞形基金子基金。

⑩ 相关法律法规及监管部门规定的其它投资限制。
 基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定。上述规定期间市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合上述各项投资比例限制的,基金管理人应当在三个交易日内进行调整,法律法规或监管机构另有规定时,从其规定。

《基金法》及其他有关法律法规或监管部门取消上述限制的,履行适当程序后,基金不受上述限制,如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的,基金管理人可在与基金托管人协商一致并履行相关程序后,可相应调整本基金的投资比例规定,不需经基金份额持有人大会审议。

3. 衍生品投资
 本基金衍生品投资应当仅限于投资组合避险或有效管理,不得用于投机或放大交易,同时应当遵守下列规定:
 1. 本基金投资的衍生品全部敞口不得高于基金资产净值的100%。
 2. 本基金投资期货支付的初始保证金、投资期货支付收取的期权费、投资和衍生品支付的费用占初始费用的总额不得高于基金资产净值的10%。
 3. 本基金投资于远期合约、互换等柜台交易金融衍生品,应当符合以下要求:
 ① 所有参与交易的手对手 中资商业银行除外,应当具有不低于中国证监会认可的信用评级机构评级;
 ② 交易对手方应当至少每个工作日对交易进行估值,并且基金可在任何时间以公允价值终止交易。

6. 任一交易对手方的市值计价敞口不得超过基金资产净值的20%。
 7. 基金管理人应当在本基金会计年度结束后60个工作日内向中国证监会提交包括衍生品头寸及风险分析报告。

4. 本基金可以参与证券借贷交易,并且应当遵守下列规定:
 1. 所有参与交易的手对手 中资商业银行除外,应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。
 2. 应当采取市值计价制度进行调整以确保担保物市值不低于已借出证券市值的102%。
 3. 第三方应当在交易期内及时向本基金支付已借出证券产生的所有股息、利息和分红,一旦借方违约,本基金应根据协议和有关法律有权保留和处置担保物以满足索赔需要。
 4. 除中国证监会另有规定外,担保物可以是以下金融工具或品种:
 ① 现金;
 ② 存款证明;
 ③ 商业票据;
 ④ 政府债券;
 ⑤ 中资商业银行或由不低于中国证监会认可的信用评级机构评级的境外金融机构(作为交

易对手方或其关联方)的除外,出具的不可撤销信用证。
 5. 本基金基金在任何时候禁止证券借贷交易并在正常市场例的合理期限内要求归还任一或所有已借出的证券。
 6. 基金管理人应当对基金参与证券借贷交易中发生的任何损失负全部责任。

7. 基金参与证券借贷交易,或与实物商品挂钩的衍生品等其他工具不得超过基金总资产的50%。上述比例限制计算,基金因参与证券借贷交易而持有的担保物不得计入基金总资产。
 5. 基金可以参与与回购交易的手对手 中资商业银行除外,应当具有中国证监会认可的信用评级机构评级。

① 参与回购交易,应当采取市值计价制度对卖出收益进行调整以确保现金不低于已借出证券市值的102%。一旦买方违约,本基金根据协议和有关法律有权保留或处置卖出收益以满足索赔需要。
 ② 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易,逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

6. 基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已售出而未回购证券总市值不得超过超过基金总资产的50%。本项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。
 7. 基金参与证券借贷交易,应当遵守下列规定:
 ① 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易,逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。
 ② 基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已售出而未回购证券总市值不得超过超过基金总资产的50%。本项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。

8. 基金参与证券借贷交易,应当遵守下列规定:
 ① 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易,逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。
 ② 基金参与证券借贷交易、正回购交易,所有已售出而未回购证券总市值不得超过超过基金总资产的50%。本项比例限制计算,基金因参与证券借贷交易、正回购交易而持有的担保物、现金不得计入基金总资产。
 ③ 基金管理人应当对基金参与证券正回购交易,逆回购交易中发生的任何损失负相应责任。

六、基金资产净值的计算方法和公告方式
 基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。
 《基金合同》生效后,在开始办理基金份额申购或者赎回前,基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。
 在开始办理基金份额申购或者赎回后,基金管理人应当每个估值日后2个工作日内通过网站、基金销售网点以及其他媒介,披露估值日的基金份额净值和基金份额净值。
 基金管理人应当公告半年度和年度最后一个工作日基金资产净值和基金份额净值,基金管理人应当在前款规定的市场交易日的2个工作日内,将基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值登载在指定媒体。

七、基金合同解除和终止的事由、程序以及基金财产的清算方式
 (一)《基金合同》变更
 1. 以下变更《基金合同》的事项须经基金份额持有人大会决议通过:
 ① 终止《基金合同》,但在基金规模低于5000万元的情况下除外;
 ② 更换基金管理人;
 ③ 更换基金托管人;
 ④ 更换基金运作方式;
 ⑤ 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外;

⑥ 变更基金类别;
 ⑦ 本基金与其他基金的合并;
 ⑧ 变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);
 ⑨ 变更基金份额持有人大会程序;
 ⑩ 对基金份额持有人权利和义务产生重大影响的其他事项。
 但出现下列情况时,可不经基金份额持有人大会决议,由基金管理人和基金托管人同意后变更并公告,并报中国证监会备案:
 1. 调低基金管理费、基金托管费;
 2. 法律法规要求增加的基金费用的收取;
 3. 在法律法规和《基金合同》规定的范围内调整本基金的申购费率、调低赎回费率、变更收费方式或调整相关业务规则;

④ 相应调整法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;
 5. 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化;
 6. 除法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会以外的其他情形。
 2. 关于《基金合同》变更的基金份额持有人大会决议按照届时有效的法律法规报经中国证监会核准或备案,自生效之日起依照《信息披露办法》的有关规定在至少一家指定媒体公告。

(二)《基金合同》终止
 有下列情形之一的,《基金合同》应当终止:
 1. 基金份额持有人大会决定终止的;
 2. 基金管理人、基金托管人职责终止,在6个月内没有新基金管理人、新基金托管人承接的;
 3. 基金合同约定的其他情形;
 4. 若基金规模低于5000万元,基金管理人有权在不召开基金份额持有人大会的情况下终止基金合同;
 5. 相关法律法规和中国证监会规定的其他情况。

(三)基金财产的清算
 1. 基金财产清算小组:自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算小组,基金管理人组织基金财产清算小组并在中国证监会的监督下进行基金清算。
 2. 基金财产清算小组成员:基金财产清算小组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师以及中国证监会指定的人员组成。基金财产清算小组可以聘用必要的工作人员。
 3. 基金财产清算小组职责:基金财产清算小组负责基金财产的保管、清点、估价、变现和分配。基金财产清算小组可以依法进行必要的民事活动。

4. 基金财产清算程序:
 ① 《基金合同》终止后,由基金财产清算小组统一接管基金财产;
 ② 对基金财产和债权债务进行清理和确认;
 ③ 对基金财产进行估值和变现;
 ④ 制作清算报告;
 ⑤ 聘请会计师事务所对清算报告进行外部审计,聘请律师事务所对清算报告出具法律意见书;

6. 清算报告报中国证监会备案并公告。
 7. 基金财产清算的期限为6个月,自基金财产清算小组成立之日起算。
 八、争议解决方式
 各方当事人同意,《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议,如经友好协商未能解决的,应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁,仲裁地点为北京,仲裁裁决是终局的,并对各方当事人具有约束力,仲裁费用由败诉方承担。
 《基金合同》受中国法律管辖。

九、基金合同存放地和投资者取得合同的方式
 《基金合同》可印制或复印,供投资者在基金管理人、基金托管人、基金代销机构的办公场所和营业场所查阅;投资者也可工本费购买《基金合同》复印件或复印件,但内容应以《基金合同》正

本为准。
七、基金财务状况
 本基金募集期间发生的信息披露费、会计师费、律师费及其他费用由基金管理人承担,不从基金财产中支付,其他各基金销售机构根据基金招募说明书设定的费率或佣金比例收取认购费。
 本基金认购后上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
 嘉实黄金证券投资基金 LOF 2012年2月2日资产负债表(未经审计)如下:

资产		2012年2月2日	
银行存款		100,393,002.16	
结算备付金		666,666.67	
存出保证金		-	
交易性金融资产		327,522,564.81	
其中:股票投资		-	
基金投资		327,522,564.81	
债券投资		-	
资产支持证券投资		-	
衍生金融资产		-	
买入返售金融资产		-	
应收证券清算款		-	
其他应收款		49,644.51	
应收股利		-	
应收申购款		135,073.42	
递延所得税资产		-	
其他资产		-	
资产总计		428,766,951.57	
负债和所有者权益		2012年2月2日	
负债:			
短期借款		-	
交易性金融负债		-	
衍生金融负债		-	
卖出回购金融资产款		-	
应付证券清算款		41,375,804.97	
应付赎回款		1,961,654.54	
应付管理人报酬		334,719.88	
应付托管费		87,027.16	
应付销售服务费		-	
应付交易费用		-	
应交税费		-	
其他应付款		-	
应付利息		-	
其他负债		112,933.66	
递延所得税负债		-	
负债合计		43,872,140.21	
所有者权益:			
实收基金		381,777,453.07	
未分配利润		3,117,338.29	
所有者权益合计		384,894,811.36	
负债和所有者权益总计		428,766,951.57	

注:截至2012年2月2日,基金份额净值1.008元,基金份额总额381,777,453.07份。
八、基金投资组合
 截至本公告前三个工作日即2012年2月2日,嘉实黄金证券投资基金 LOF 的投资组合如下:
 (一)基金投资组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中:普通股	-	-
	优先股	-	-
	存托凭证	-	-
	房地产投资	-	-
2	基金投资	327,522,564.81	76.39
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中:远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	101,059,668.83	23.57
8	其他资产	184,717.93	0.04
9	合计	428,766,951.57	100.00

(二) 在各个国家、地区、证券市场的股票及存托凭证投资分布
 2012年2月2日,本基金未持有股票及存托凭证。
 (三) 按行业分类的股票及存托凭证投资组合
 2012年2月2日,本基金未持有股票及存托凭证。
 (四) 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细
 2012年2月2日,本基金未持有股票及存托凭证。
 (五) 按债券信用等级分类的债券投资组合

证券代码:000928 证券简称:中钢吉炭 公告编号:2012-003
中钢集团吉林炭素股份有限公司
第六届董事会第五次会议决议公告

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。

一、董事会会议召开情况
 1. 本次董事会会议于2012年1月20日召开。
 2. 本次会议由2012年2月3日在公司会议室以现场结合通讯方式召开。
 3. 本次会议出席董事9人,实际出席会议的董事9人,其中以通讯表决方式出席会议的7人,以通讯方式参与的董事为葛朝晖、姜志才、吴斌斌、郭国洪、许庆、李国义、赵英杰。
 4. 本次董事会由公司董事长杨光主持,部分监事及高级管理人员列席了会议。
 5. 审议通过了本次会议的召开符合有关法律法规和公司章程的规定。
 二、董事会会议决议情况
 1. 向中信银行股份有限公司长春分行申请1,000万元综合授信额度,期限1年,用于流动资金贷款、银行承兑汇票、国内信用证及项下押汇、国际贸易融资等业务,由中国中钢集团公司提供连带责任保证;
 表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票
 2. 补选姜志才为2008-2010年符合将符合条件的应收款予以核销,核销的应收款均属多年沉欠欠款且取得了破产清算通知等相关证据,对该部分应收款项的核销符合《会计准则》相关规定,能够更加真实的反应企业财务状况,上述核销不涉及关联方且金额属于董事会审议范围,无需提交股东大会审议;(核销明细见附件)
 表决结果:同意9票,反对0票,弃权0票
 三、备查文件
 1. 经与会董事签字并加盖董事会印章的董事会决议;
 2. 深交所要求的其他文件。

中钢集团吉林炭素股份有限公司
 董 事 会
 2012年2月3日

2008年核销明细				
一、应收账款	单位名称	核销金额	核销原因	账务形成时间
重庆特稀钢	8,631,386.72	客户已破产		2001年5月
洛阳特钢	5,341,867.03	客户已破产		2001年11月
遵义铁合金	3,463,767.39	客户已破产		2002年3月
遵义铁合金	2,822,930.10	客户已破产		2002年2月
民和钢	1,976,183.61	客户已破产		2000年3月
三明市炉料供应站	1,527,063.12	客户已破产		2000年9月
延安煤化工有限公司	1,516,547.34	客户已破产		2002年12月
吉林铝业公司	1,092,020.65	客户已破产		2002年12月
吉林特钢	1,002,646.04	客户已破产		1997年8月
吉林市天兴实业公司	870,633.61	吊销营业执照		1995年9月
湖南铁合金厂	861,672.15	客户已破产		2000年12月
绍兴特钢总厂	809,172.90	客户已破产		1999年12月
唐山二炼钢	748,739.31	客户已破产		2000年6月
吉林炭素制品公司	506,496.86	吊销营业执照		2002年8月
鄂钢集团成都钢铁有限公司	459,422.30	吊销营业执照		2002年7月
张家口特钢厂	401,646.93	客户已破产		1998年5月
长春物资公司	329,489.96	吊销营业执照		1997年10月
四平联合化工股份有限公司	301,866.98	客户已破产		2001年9月
四联化学厂	268,659.43	客户已破产		2001年10月
省冶金工业局	263,749.38	客户已破产		1996年2月
湖南石炭玻璃厂	216,307.60	客户已破产		2002年12月
湖南铁合金厂	183,879.55	客户已破产		2005年5月
吉林市天正经贸有限公司	180,179.83	吊销营业执照		2000年11月
洛阳安特特钢有限公司	122,239.06	吊销营业执照		2005年1月
湖南冷水江耐材材料厂	119,800.50	客户已破产		2001年7月
吉林市吉哈煤业制品厂	117,497.62	吊销营业执照		1996年11月
武汉市洪山区物资协作开发总公司	114,642.86	客户已破产		2002年9月

证券代码:600886 证券简称:国投电力 编号:临2012-005
 证券代码:110013 证券简称:国投转债

国投华靖电力控股股份有限公司
关于二滩水电停止直供电的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
 公司全资子公司国投电力有限公司持股52%的二滩水电开发有限公司(简称“二滩水电”)2001年10月与攀枝花高耗能投资开发有限公司签订的《协议书》已于2011年末到期。根据《国家发展改革委关于整顿电力秩序的通知》(发改价检[2011]311号)精神,二滩水电已于2012年1月1日停止向攀枝花化工机械厂(简称“国投华靖”)供电,自即日起,二滩水电与攀枝花高耗能投资开发有限公司协议涉及的25万千瓦时电量全部纳入四川省上网电量范围,原执行直供电0.1615元/千瓦时的上述电量现执行批复上网电价0.278元/千瓦,具体按四川省丰枯峰谷分时电价政策执行。

特此公告。
 国投华靖电力控股股份有限公司
 董 事 会
 2012年2月7日

证券代码:002642 证券简称:荣之联 公告编号:2012-007

北京荣之联科技股份有限公司
关于公司及全资子公司获得
高新技术企业复审证书的公告

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。
 北京荣之联科技股份有限公司(以下简称“荣之联”)及其全资子公司北京昊天旭辉科技有限公司(以下简称“昊天旭辉”)于2008年被认定为高新技术企业,并取得相关主管部门下发的高新技术企业证书,有效期至三年。
 2011年荣之联与昊天旭辉进行高新技术企业复审工作,于近日收到北京市科学技术委员会、北京市财政局、北京市国家税务局、北京市地方税务局联合下发的高新技术企业证书,荣之联证书编号:GF201111001054,发证时间:2011年10月11日,有效期:三年。昊天旭辉证书编号:GF201111001163,发证时间:2011年10月11日,有效期:三年。

根据相关规定,通过高新技术企业复审后,公司将连续三年继续享受国家关于高新技术企业的相关优惠政策,按15%的税率征收企业所得税。2011年荣之联和昊天旭辉已按15%的税率预缴企业所得税,所以以上税收优惠政策不影响公司2011年度经营业绩。
 特此公告。
 北京荣之联科技股份有限公司
 董 事 会
 二〇一二年二月七日

证券代码:000820 证券简称:*ST金城 编号:2012-004

金城造纸股份有限公司
关于公司股票恢复上市的进展公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
 2008年、2009年、2010年连续三年亏损,公司股票自2011年4月28日起暂停上市。
 2011年,公司在地方政府主导下,围绕争取恢复上市进行了一系列工作,与盘锦金海伟业商贸有限公司进行债务重组,获得了债务重组收益;解除与锦州彩源塑料集团有限公司和锦州彩源新型塑料股份有限公司的担保责任,冲回已计提的预计负债;收回金城造纸(集团)有限责任公司陈欠欠款,冲回坏账准备,上述事项可增加2011年净利润28204万元,为公司扭亏为盈创造了条件。
 公司2012年1月18日进行2011年度业绩预告,预计2011年盈利4000万元至4500万元。公司将于2012年4月20日披露《2011年年度报告》,如2011年盈利,公司将及时向深圳证券交易所提出股票恢复上市申请,如2011年亏损,公司股票将终止上市。公司董事会提醒投资者注意投资风险。
 公司股票暂停上市期间,将严格按照《公司法》、《证券法》、《深圳证券交易所股票上市规则》的有关规定,认真履行信息披露义务,《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》及巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)为公司指定的信息披露媒体。
 特此公告。
 金城造纸股份有限公司
 董 事 会
 2012年2月6日

2012年2月2日,本基金未持有债券。
 六、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
 2012年2月2日,本基金未持有债券。
 七、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
 2012年2月2日,本基金未持有资产支持证券。
 八、按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细
 2012年2月2日,本基金未持有金融衍生品。
 九、按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	SPDR GOLD TRUST	ETF基金	交易型开放式	World Gold Trust Services LLC	70,029,789.21	18.19
2	CSEFT II ON GOLD	ETF基金	交易型开放式	Credit Suisse Asset Management Funds	56,201,149.58	14.60
3	ZKB GOLD ETF-A (USD)	ETF基金	交易型开放式	Zuercher Kantonalbank	54,890,703.38	14.26
4	ISHARES GOLD TRUST	ETF基金	交易型开放式	BlackRock Fund Advisors	53,496,509.03	13.90
5	JP PHYSICAL GOLD FUND	ETF基金	交易型开放式	Swiss & Global Asset Management AG	52,469,821.80	13.63
6	ETFS GOLD TRUST	ETF基金	交易型开放式	ETF Securities USA LLC	40,434,591.81	10.51

注:2012年2月2日,本基金仅持有上述6只基金。
 (十)投资组合报告附注
 1. 申明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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、处罚的情形。
 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。
 2. 申明本基金投资的前十名股票是否存在超出基金合同规定的备选股票库。
 报告期内本基金未持有股票。
 3. 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	49,644.51
5	应收申购款	