

基金管理人: 诺安基金管理有限公司 基金托管人: 招商银行股份有限公司

2013年第2期

基金管理人: 诺安基金管理有限公司 基金托管人: 招商银行股份有限公司

注: 本基金本报告期末仅持有上述股票。
 (四) 报告期末按投资品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	69,825,000.00	9.32
其中:政策性金融债		69,825,000.00	9.32
4	企业债券	318,726,086.00	42.53
5	企业短期融资券	160,005,000.00	21.35
6	中期票据	99,011,000.00	13.21
7	可转债	7,937,956.32	1.06
8	其他	-	-
9	合计	655,500,042.32	87.48

(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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130201	13国债01	700,000	69,825,000.00	9.32
2	1080125	10国债25	50,000	49,960,000.00	6.67
3	1180032	11国债续债	300,000	30,540,000.00	4.08
4	1280420	12国债续债	300,000	30,501,000.00	4.07
5	041358019	13北方水泥CP001	300,000	29,961,000.00	4.00

(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支持证券投资明细

(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的情况,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
 (2) 本基金投资的前十名股票中,没有投资于超出合同规定范围之外的股票。
 (3) 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	184,195.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	18,174,553.38
5	应收申购款	4,469.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,363,218.15

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

(4) 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	128001	鲁钢转债	4,578,000.00	0.55
2	127001	海直转债	3,180,074.32	0.50

(5) 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002412	沃森生物	20,079,148.32	2.68	重大事项

诺安基金管理有限公司

招商银行股份有限公司

诺安基金管理有限公司

招商银行股份有限公司