



信息披露 Disclosure

2011年2月25日 星期五 D10

(续表) D9
4 到期前未持有的待转换债券
本基金本期尚未持有的待转换债券
5 到期前未偿还的应付股利
6 到期前未偿还的其他应付款项
7 其他负债
8 资本公积
9 实收资本(股本)
10 资本公积-资本溢价
11 盈余公积
12 未分配利润
13 其他综合收益
14 外币报表折算差额
15 其他

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	21,161,721.66	5.59
其中：股票	21,161,721.66	5.59	
2	固定收益投资	305,312,495.66	80.59
其中：债券	305,312,495.66	80.59	
货币支持券	-	-	
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	8,215,275.02	2.17
6	其他资产	44,179,211.05	11.66
7	合计	378,868,703.39	100.00

① 报告期末前十名重仓股占净资产的比重情况表

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	1,290,964.80	0.38
B	采掘业	-	-
C	制造业	11,302,756.86	3.33
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、石化、塑料	6,992,990.68	2.06
C5	电子、电器	4,288,266.18	1.26
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械设备、仪表	21,500.00	0.01
C8	医药、生物制品	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,568,000.00	2.52
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
1	合计	21,161,721.66	5.59

② 报告期按行业分类的股票投资组合

③ 报告期按品种分类的股票投资组合

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	600079	国电电力	2,800,000	8,568,000.00	2.52
2	002496	荣盛石化	88,748	5,662,322.08	1.67
3	300031	英唐智控	40,476	3,202,274.88	0.86
4	002476	宝莱特	47,108	1,290,964.80	0.38
5	601118	海南橡胶	215,520	1,290,964.80	0.38
6	300128	捷顺科技	2,270	1,096,111.30	0.32
7	300127	华帝股份	30,900	862,110.00	0.25
8	002528	英飞拓	500	25,770.00	0.01
9	601890	亚星锚链	1,000	21,500.00	0.01
10	-	-	-	-	-
1	合计	305,312,495.66	89.93		

④ 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券明细表

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	113001	中行转债	33,120,592.80	9.76	
2	125709	唐钢转债	8,900,690.40	2.62	
3	110007	博银转债	7,773,097.60	2.29	
4	110003	新嘉转债	4,472,076.30	1.32	
5	125731	美丰转债	1,339,745.40	0.39	
6	110009	双良转债	150,709.60	0.04	

⑤ 报告期末前十名重仓股占净资产的比重情况表

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	21,161,721.66	5.59	
其中：股票	21,161,721.66	5.59		
2	固定收益投资	305,312,495.66	80.59	
其中：债券	305,312,495.66	80.59		
货币支持券	-	-	-	-
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	8,215,275.02	2.17	
6	其他资产	44,179,211.05	11.66	
7	合计	378,868,703.39	100.00	

⑥ 报告期按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	1,290,964.80	0.38
B	采掘业	-	-
C	制造业	11,302,756.86	3.33
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、石化、塑料	6,992,990.68	2.06
C5	电子、电器	4,288,266.18	1.26
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械设备、仪表	21,500.00	0.01
C8	医药、生物制品	-	-
C9	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,568,000.00	2.52
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	-	-
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
1	合计	21,161,721.66	5.59

⑦ 报告期按品种分类的股票投资组合

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	600079	国电电力	2,800,000	8,568,000.00	2.52
2	002496	荣盛石化	88,748	5,662,322.08	1.67
3	300031	英唐智控	40,476	3,202,274.88	0.86
4	002476	宝莱特	47,108	1,290,964.80	0.38
5	601118	海南橡胶	215,520	1,290,964.80	0.38
6	300128	捷顺科技	2,270	1,096,111.30	0.32
7	300127	华帝股份	30,900	862,110.00	0.25
8	002528	英飞拓	500	25,770.00	0.01
9	601890	亚星锚链	1,000	21,500.00	0.01
10	-	-	-	-	-
1	合计	305,312,495.66	89.93		

⑧ 报告期按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权重投资明细表

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	113001	中行转债	439,690	45,068,225.00	13.28
2	008018	08券票38	400,000	40,128,000.00	11.82
3	113001	中行转债	301,480	33,120,592.80	9.76
4	113002	工行转债	626,250	30,925,215.00	9.13
5	008047	08券票47	300		