



信息披露 Disclosure

2011年2月25日 星期五

D10

(单位:百元)

1. 报告期未持有的处于转股期的可转换债券明细
2. 本报告期末未持有的处于转股期的可转换债券
3. 本报告期末前十名股票持有人的期末持股情况的说明
4. 本报告期末前十名股票持有人的期末持股情况的说明
5. 本报告期末前十名股票持有人的期末持股情况的说明

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
2	固定收益投资	21,161,721.66	5.59
3	其中:债券	305,312,495.66	80.59
4	其中:资产支持证券	-	-
5	其中:买入返售金融资产	-	-
6	其中:买入返售金融资产	-	-
7	其中:买入返售金融资产	-	-
8	其中:买入返售金融资产	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	其中:买入返售金融资产	-	-
11	其中:买入返售金融资产	-	-
12	其中:买入返售金融资产	-	-
13	其中:买入返售金融资产	-	-
14	其中:买入返售金融资产	-	-
15	其中:买入返售金融资产	-	-
16	其中:买入返售金融资产	-	-
17	其中:买入返售金融资产	-	-
18	其中:买入返售金融资产	-	-
19	其中:买入返售金融资产	-	-
20	其中:买入返售金融资产	-	-
21	其中:买入返售金融资产	-	-
22	其中:买入返售金融资产	-	-
23	其中:买入返售金融资产	-	-
24	其中:买入返售金融资产	-	-
25	其中:买入返售金融资产	-	-
26	其中:买入返售金融资产	-	-
27	其中:买入返售金融资产	-	-
28	其中:买入返售金融资产	-	-
29	其中:买入返售金融资产	-	-
30	其中:买入返售金融资产	-	-
31	其中:买入返售金融资产	-	-
32	其中:买入返售金融资产	-	-
33	其中:买入返售金融资产	-	-
34	其中:买入返售金融资产	-	-
35	其中:买入返售金融资产	-	-
36	其中:买入返售金融资产	-	-
37	其中:买入返售金融资产	-	-
38	其中:买入返售金融资产	-	-
39	其中:买入返售金融资产	-	-
40	其中:买入返售金融资产	-	-
41	其中:买入返售金融资产	-	-
42	其中:买入返售金融资产	-	-
43	其中:买入返售金融资产	-	-
44	其中:买入返售金融资产	-	-
45	其中:买入返售金融资产	-	-
46	其中:买入返售金融资产	-	-
47	其中:买入返售金融资产	-	-
48	其中:买入返售金融资产	-	-
49	其中:买入返售金融资产	-	-
50	其中:买入返售金融资产	-	-
51	其中:买入返售金融资产	-	-
52	其中:买入返售金融资产	-	-
53	其中:买入返售金融资产	-	-
54	其中:买入返售金融资产	-	-
55	其中:买入返售金融资产	-	-
56	其中:买入返售金融资产	-	-
57	其中:买入返售金融资产	-	-
58	其中:买入返售金融资产	-	-
59	其中:买入返售金融资产	-	-
60	其中:买入返售金融资产	-	-
61	其中:买入返售金融资产	-	-
62	其中:买入返售金融资产	-	-
63	其中:买入返售金融资产	-	-
64	其中:买入返售金融资产	-	-
65	其中:买入返售金融资产	-	-
66	其中:买入返售金融资产	-	-
67	其中:买入返售金融资产	-	-
68	其中:买入返售金融资产	-	-
69	其中:买入返售金融资产	-	-
70	其中:买入返售金融资产	-	-
71	其中:买入返售金融资产	-	-
72	其中:买入返售金融资产	-	-
73	其中:买入返售金融资产	-	-
74	其中:买入返售金融资产	-	-
75	其中:买入返售金融资产	-	-
76	其中:买入返售金融资产	-	-
77	其中:买入返售金融资产	-	-
78	其中:买入返售金融资产	-	-
79	其中:买入返售金融资产	-	-
80	其中:买入返售金融资产	-	-
81	其中:买入返售金融资产	-	-
82	其中:买入返售金融资产	-	-
83	其中:买入返售金融资产	-	-
84	其中:买入返售金融资产	-	-
85	其中:买入返售金融资产	-	-
86	其中:买入返售金融资产	-	-
87	其中:买入返售金融资产	-	-
88	其中:买入返售金融资产	-	-
89	其中:买入返售金融资产	-	-
90	其中:买入返售金融资产	-	-
91	其中:买入返售金融资产	-	-
92	其中:买入返售金融资产	-	-
93	其中:买入返售金融资产	-	-
94	其中:买入返售金融资产	-	-
95	其中:买入返售金融资产	-	-
96	其中:买入返售金融资产	-	-
97	其中:买入返售金融资产	-	-
98	其中:买入返售金融资产	-	-
99	其中:买入返售金融资产	-	-
100	其中:买入返售金融资产	-	-

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	1,290,964.80	0.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	11,302,756.86	3.33
D	食品饮料	-	-
E	纺织服装	-	-
F	木材家具	-	-
G	医药生物	-	-
H	石油化学塑料	6,992,990.68	2.06
I	电子	428,266.18	1.26
J	金属非金属	-	-
K	机械仪表	21,500.00	0.01
L	医药生物	-	-
M	其他制造业	-	-
N	电力热力生产供应	8,568,000.00	2.52
O	建筑业	-	-
P	交通运输仓储	-	-
Q	信息技术业	-	-
R	批发和零售业	-	-
S	金融保险	-	-
T	社会服务业	-	-
U	传播与文化业	-	-
V	综合类	-	-
合计		21,161,721.66	6.23

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	600795	中航电子	2,800,000	8,568,000.00	2.52
2	002493	盛通股份	88,748	5,676,322.08	1.67
3	300131	英唐智控	40,476	2,302,274.88	0.68
4	002476	宝硕股份	47,108	1,316,668.60	0.39
5	601118	海南橡胶	215,520	1,290,964.80	0.38
6	300128	滨富新材	23,270	1,098,113.30	0.32
7	300127	银河科技	30,900	862,110.00	0.25
8	002528	英飞特	500	25,770.00	0.01
9	601890	亚盛铝业	1,000	21,500.00	0.01
10	-	-	-	-	-

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	46,561,473.00	13.72
2	央行票据	70,245,000.00	20.69
3	金融债券	-	-
4	企业债券	94,880,757.20	27.95
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	93,625,265.46	27.58
7	其他	-	-
8	合计	305,312,495.66	89.93

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	010107	21国债(07)	439,690	45,068,225.00	13.28
2	080108	08央行票据38	400,000	40,128,000.00	11.82
3	113001	央行转债	361,480	33,120,592.80	9.76
4	113002	工行转债	282,250	30,982,215.00	9.13
5	080147	08央行票据47	400,000	30,117,000.00	8.87

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	38,658,914.15
3	应收利息	-
4	应收股利	5,108,854.38
5	应收申购款	161,462.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	合计	44,179,211.05

4. 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

5. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

6. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

7. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

8. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

9. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

10. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

11. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

12. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

13. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

14. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

15. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

16. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

17. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

18. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

19. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

20. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

21. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

22. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

23. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

24. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

25. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

26. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

27. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

28. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

29. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

30. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

31. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

32. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

33. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

34. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

35. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

36. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

37. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

38. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

39. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

40. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

41. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

42. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

43. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

44. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

45. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

46. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

47. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

48. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

49. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

50. 报告期末前十名股票持有人的期末持股情况

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	113001	央行转债	33,120,592.80	9.76
2	125709	银河转债	8,900,690.40	2.62
3	110077	博汇转债	7,773,097.60	2.29
4	110003	新钢转债	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

序号	股票代码	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002493	盛通股份	5,676,322.08	1.67	新股网下申购
2	300131	英唐智控	2,302,274.88	0.68	新股网下申购
3	601118	海南橡胶	1,290,964.80	0.38	新股网下申购
4	300128	滨富新材	1,098,113.30	0.32	新股网下申购
5	300127	银河转债	862,110.00	0.25	新股网下申购

八、基金的投资
1. 投资目标
2. 投资范围
3. 投资策略
4. 业绩比较基准
5. 风险收益特征
6. 投资限制
7. 投资组合比例
8. 投资组合报告
9. 投资组合报告
10. 投资组合报告
11. 投资组合报告
12. 投资组合报告
13. 投资组合报告
14. 投资组合报告
15. 投资组合报告
16. 投资组合报告
17. 投资组合报告
18. 投资组合报告
19. 投资组合报告
20. 投资组合报告
21. 投资组合报告
22. 投资组合报告
23. 投资组合报告
24. 投资组合报告
25. 投资组合报告
26. 投资组合报告
27. 投资组合报告
28. 投资组合报告
29. 投资组合报告
30. 投资组合报告
31. 投资组合报告
32. 投资组合报告
33. 投资组合报告
34. 投资组合报告
35. 投资组合报告
36. 投资组合报告
37. 投资组合报告
38. 投资组合报告
39. 投资组合报告
40. 投资组合报告
41. 投资组合报告
42. 投资组合报告
43. 投资组合报告
44. 投资组合报告
45. 投资组合报告
46. 投资组合报告
47. 投资组合报告
48. 投资组合报告
49. 投资组合报告
50. 投资组合报告
51. 投资组合报告
52. 投资组合报告
53. 投资组合报告
54. 投资组合报告
55. 投资组合报告
56. 投资组合报告
57. 投资组合报告
58. 投资组合报告
59. 投资组合报告
60. 投资组合报告
61. 投资组合报告
62. 投资组合报告
63. 投资组合报告
64. 投资组合报告
65. 投资组合报告
66. 投资组合报告
67. 投资组合报告
68. 投资组合报告
69. 投资组合报告
70. 投资组合报告
71. 投资组合报告
72. 投资组合报告
73. 投资组合报告
74. 投资组合报告
75. 投资组合报告
76. 投资组合报告
77. 投资组合报告
78. 投资组合报告
79. 投资组合报告
80. 投资组合报告
81. 投资组合报告
82. 投资组合报告
83. 投资组合报告
84. 投资组合报告
85. 投资组合报告
86. 投资组合报告
87. 投资组合报告
88. 投资组合报告
89. 投资组合报告
90. 投资组合报告
91. 投资组合报告
92. 投资组合报告
93. 投资组合报告
94. 投资组合报告
95. 投资组合报告
96. 投资组合报告
97. 投资组合报告
98. 投资组合报告
99. 投资组合报告
100. 投资组合报告

九、基金的业绩
1. 基金净值
2. 基金净值
3. 基金净值
4. 基金净值
5. 基金净值
6. 基金净值
7. 基金净值
8. 基金净值
9. 基金净值
10. 基金净值
11. 基金净值
12. 基金净值
13. 基金净值
14. 基金净值
15. 基金净值
16. 基金净值
17. 基金净值
18. 基金净值
19. 基金净值
20. 基金净值
21. 基金净值
22. 基金净值
23. 基金净值
24. 基金净值
25. 基金净值
26. 基金净值
27. 基金净值
28. 基金净值
29. 基金净值
30. 基金净值
31. 基金净值
32. 基金净值
33. 基金净值
34. 基金净值
35. 基金净值
36. 基金净值
37. 基金净值
38. 基金净值
39. 基金净值
40. 基金净值
41. 基金净值
42. 基金净值
43. 基金净值
44. 基金净值
45. 基金净值
46. 基金净值
47. 基金净值
48. 基金净值
49. 基金净值
50. 基金净值
51. 基金净值
52. 基金净值
53. 基金净值
54. 基金净值
55. 基金净值
56. 基金净值
57. 基金净值
58. 基金净值
59. 基金净值
60. 基金净值
61. 基金净值
62. 基金净值
63. 基金净值
64. 基金净值
65. 基金净值
66. 基金净值
67. 基金净值
68. 基金净值
69. 基金净值
70. 基金净值
71. 基金净值
72. 基金净值
73. 基金净值
74. 基金净值
75. 基金净值
76. 基金净值
77. 基金净值
78. 基金净值
79. 基金净值
80. 基金净值
81. 基金净值
82. 基金净值
83. 基金净值
84. 基金净值
85. 基金净值
86. 基金净值
87. 基金净值
88. 基金净值
89. 基金净值
90. 基金净值
91. 基金净值
92. 基金净值
93. 基金净值
94. 基金净值
95. 基金净值
96. 基金净值
97. 基金净值
98. 基金净值
99. 基金净值
100. 基金净值

十、基金的资产组合
1. 基金资产组合
2. 基金资产组合
3. 基金资产组合
4. 基金资产组合
5. 基金资产组合
6. 基金资产组合
7. 基金资产组合
8. 基金资产组合
9. 基金资产组合
10. 基金资产组合
11. 基金资产组合
12. 基金资产组合
13. 基金资产组合
14. 基金资产组合
15. 基金资产组合
16. 基金资产组合
17. 基金资产组合
18. 基金资产组合
19. 基金资产组合
20. 基金资产组合
21. 基金资产组合
22. 基金资产组合
23. 基金资产组合
24. 基金资产组合
25. 基金资产组合
26. 基金资产组合
27. 基金资产组合
28. 基金资产组合
29. 基金资产组合
30. 基金资产组合
31. 基金资产组合
32. 基金资产组合
33. 基金资产组合
34. 基金资产组合
35. 基金资产组合
36. 基金资产组合
37. 基金资产组合
38. 基金资产组合
39. 基金资产组合
40. 基金资产组合
41. 基金资产组合
42. 基金资产组合
43. 基金资产组合
44. 基金资产组合
45. 基金资产组合
46. 基金资产组合
47. 基金资产组合
48. 基金资产组合
49. 基金资产组合
50. 基金资产组合
51. 基金资产组合
52. 基金资产组合
53. 基金资产组合
54. 基金资产组合
55. 基金资产组合
56. 基金资产组合
57. 基金资产组合
58. 基金资产组合
59. 基金资产组合
60. 基金资产组合
61. 基金资产组合
62. 基金资产组合
63. 基金资产组合
64. 基金资产组合
65. 基金资产组合
66. 基金资产组合
67. 基金资产组合
68. 基金资产组合
69. 基金资产组合
70. 基金资产组合
71. 基金资产组合
72. 基金资产组合
73. 基金资产组合
74. 基金资产组合
75. 基金资产组合
76. 基金资产组合
77. 基金资产组合
78. 基金资产组合
79. 基金资产组合
80. 基金资产组合
81. 基金资产组合
82. 基金资产组合
83. 基金资产组合
84. 基金资产组合
85. 基金资产组合
86. 基金资产组合
87. 基金资产组合
88. 基金资产组合
89. 基金资产组合
90. 基金资产组合
91. 基金资产组合
92. 基金资产组合
93. 基金资产组合
94. 基金资产组合
95. 基金资产组合
96. 基金资产组合
97. 基金资产组合
98. 基金资产组合
99. 基金资产组合
100. 基金资产组合

十一、基金的风险管理
1. 基金风险管理
2. 基金风险管理
3. 基金风险管理
4. 基金风险管理
5. 基金风险管理
6. 基金风险管理
7. 基金风险管理
8. 基金风险管理
9. 基金风险管理
10. 基金风险管理
11. 基金风险管理
12. 基金风险管理
13. 基金风险管理
14. 基金风险管理
15. 基金风险管理
16. 基金风险管理
17. 基金风险管理
18. 基金风险管理
19. 基金风险管理
20. 基金风险管理
21. 基金风险管理
22. 基金风险管理
23. 基金风险管理
24. 基金风险管理
25. 基金风险管理
26. 基金风险管理
27. 基金风险管理
28. 基金风险管理
29. 基金风险管理
30. 基金风险管理
31. 基金风险管理
32. 基金风险管理
33. 基金风险管理
34. 基金风险管理
35. 基金风险管理
36. 基金风险管理
37. 基金风险管理
38. 基金风险管理
39. 基金风险管理
40. 基金风险管理
41. 基金风险管理
42. 基金风险管理
43. 基金风险管理
44. 基金风险管理
45. 基金风险管理
46. 基金风险管理
47. 基金风险管理
48. 基金风险管理
49. 基金风险管理
50. 基金风险管理
51. 基金风险管理
52. 基金风险管理
53. 基金风险管理
54. 基金风险管理
55. 基金风险管理
56. 基金风险管理
57. 基金风险管理
58. 基金风险管理
59. 基金风险管理
60. 基金风险管理
61. 基金风险管理
62. 基金风险管理
63. 基金风险管理
64. 基金风险管理
65. 基金风险管理
66. 基金风险管理
67. 基金风险管理
68. 基金风险管理
69. 基金风险管理
70. 基金风险管理
71. 基金风险管理
72. 基金风险管理
73. 基金风险管理
74. 基金风险管理
75. 基金风险管理
76. 基金风险管理
77. 基金风险管理
78. 基金风险管理
79. 基金风险管理
80. 基金风险管理
81. 基金风险管理
82. 基金风险管理
83. 基金风险管理
84. 基金风险管理
85. 基金风险管理
86. 基金风险管理
87. 基金风险管理
88.