



信息披露 Disclosure

2012年1月20日 星期五

A12

(上接A1版)

联系人:王佳松
网址:www.xssec.com
客户服务电话:400-881-1177
03 恒信证券有限责任公司
住所:呼和浩特市新城区敕勒川南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锦林南路18号
法定代表人:王仕林
电话:(010-88086830、730 010-88086830-737
传真:010-66412537
联系人:陈伟彬、陈瑞光
网址:www.hxsec.com.cn
客户服务电话:400-88086830
04 恒信证券股份有限公司
住所:呼和浩特市新城区敕勒川南路56号
办公地址:呼和浩特市香坊区敕勒川南路56号
法定代表人:王仕林
电话:(0451-82330863)
传真:(0451-8237211)
联系人:李强
网址:www.hxsec.com.cn
客户服务电话:400-666-2288
05 恒信证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融街5号新盛大厦八层二一
办公地址:北京市西城区金融街5号新盛大厦八层二一
法定代表人:赵建忠
电话:(010-59355941
传真:(010-6653791
联系人:李强
网址:www.xssec.com.cn
客户服务电话:400-889-5618
06 恒信证券股份有限公司
住所:上海市陆家嘴环路166号27楼
办公地址:上海市陆家嘴环路166号27楼
法定代表人:陈伟彬
电话:(021-50121218
传真:(021-50122598
联系人:王佳松
网址:www.cshibstock.com
客户服务电话:400-320-0998
07 厦门证券有限公司
住所:厦门市莲前西路2号莲前大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲前大厦十七楼
法定代表人:傅耀辉
电话:(0592-5161642、15880287470
传真:(0592-5161140
联系人:卢文文
网址:www.xmsec.com.cn
客户服务电话:(0592-5165888
08 福建恒信证券有限责任公司
住所:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号20-25楼
法定代表人:张德华
电话:(021-32228888
传真:(021-62879783
联系人:陈瑞光
网址:www.xssec.com.cn
客户服务电话:(021-63340678
09 开瑞证券股份有限公司
住所:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区月坛北街26号
法定代表人:丁之诚
电话:(010-58560077
传真:(010-5856062
联系人:王佳松
网址:www.karui.com.cn
客户服务电话:(010-5856118
10 天风证券股份有限公司
住所:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
电话:(027-87018882
传真:(027-87618883
联系人:李强
网址:www.tfsc.com.cn
客户服务电话:(028-86711410、027-87618882

点

公司可根据情况变更或撤销代销机构,并予以公告,销售机构可以根据情况增加或者减少其销售城市、网

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

点

伍、报告期未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

金额单位:人民币元					
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	000112	21国债08	2,300,000	229,396,000.00	2.60
2	091911	11国债18	1,300,000	129,462,900.00	1.53
3	020409	11国债04	1,000,000	97,208,700.00	1.15
4	110002	工行转债	207,410	21,147,523.60	0.25
5	-	-	-	-	-

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。

七、投资组合报告

1. 2011年12月31日投资组合报告

2. 基金投资的前十名股票其市值超出基金合同规定的备选股票库。

3. 期末其他资产明细

单位:人民币元					
序号	名称	金额			
1	存出保证金	5,237,400.05			
2	应收证券清算款	14,473,555.80			
3	应收股利	-			
4	应收利息	7,789,285.12			
5	应收申购款	-			
6	其他应收款	-			
7	待摊费用	-			
8	其他	-			
9	合计	27,500,246.97			

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元					
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值
1	110002	工行转债	21,147,523.60	0.25	

5. 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元					
序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限原因
1	002187	东方电气	64,040,000.00	0.76	非公开发行股票
2	600770	恒远股份	13,812,500.00	0.16	非公开发行股票

6. 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

七、基金的投资

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有本基金期间的基金的各项费用,持有期间的费用会导致基金份额净值下降,本基金业绩指标不包括持有本基金期间的基金的各项费用,持有期间的费用会导致基金份额净值下降,本基金业绩指标不包括持有本基金期间的基金的各项费用,持有期间的费用会导致基金份额净值下降。

阶段	净值增长率	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
2009年12月1日至2009年12月31日	1.50%	0.54%	-0.02%	1.30%	1.52%	-0.76%
2010年1月1日至2010年12月31日	-3.94%	1.28%	-9.12%	1.26%	5.18%	0.02%
2011年1月1日至2011年9月30日	-21.64%	1.26%	-13.58%	1.01%	-8.06%	0.25%

十三、费用概览

(一)基金运作费用

1. 基金管理费

基金运作过程中,从基金财产中支付的费用包括:

0 基金管理人的管理费

0 基金托管人的托管费

0 基金财产划转支付的费用

0 基金合同生效后发生的信息披露费用

0 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费

0 基金的证券交易费用

0 基金合同生效后发生的其他费用

在中国证监会允许的前提下,本基金可以从基金财产中计提销售服务费,具体计提方法、计提标准在招募说明书或补充公告中列明。

2. 上述基金费用由基金管理人按法律规定的范围参照公开的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

3. 基金管理费、计提标准、计提方法与支付方式

0 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 销售服务费

本基金管理人根据基金管理人法律规定的范围参照公开的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

4. 基金管理费、计提标准、计提方法与支付方式

0 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 销售服务费

本基金管理人根据基金管理人法律规定的范围参照公开的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

4. 基金管理费、计提标准、计提方法与支付方式

0 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 销售服务费

本基金管理人根据基金管理人法律规定的范围参照公开的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

4. 基金管理费、计提标准、计提方法与支付方式

0 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 销售服务费

本基金管理人根据基金管理人法律规定的范围参照公开的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

4. 基金管理费、计提标准、计提方法与支付方式

0 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 销售服务费

本基金管理人根据基金管理人法律规定的范围参照公开的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。

4. 基金管理费、计提标准、计提方法与支付方式

0 基金管理人的管理费

在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

0 基金托管人的托管费

在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费支付指令,经基金托管人复核后于次月首日起十个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人,若遇法定节假日、休息日,支付日期顺延。

上述为处理(1)期前不同时间的多笔基金份额转出情况,对转出不收取申购费用的基金持有时间规定如下:

0 对于华夏债券(C类)、华夏现金增利货币、中信现金优势货币,每持有基金份额满1个月,均调整持有时间,计算方法如下: