

(上接29版)  
基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2009年4月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现及投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2008年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)基金资产配置组合

序号	项目	金额(元)	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	206,857,000.00	93.7
3	货币资金	17,123,500.00	25.2
4	公允价值变动资产	20,977,000.00	9.37
5	应收利息	1,086,541.88	0.48
6	其他资产	-	-
7	负债	70,555,703.84	31.5
8	净资产	136,386,297.00	60.2
9	合计	7,517,640,024.16	100.0

(二)行业分类的股票投资组合

代码	行业	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	贵州、云南	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	-	-
CD	食品饮料	-	-
CE	医药、生物、医药	-	-
CF	化学	-	-
CG	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
CH	电子	-	-
CI	金属、非金属	-	-
CJ	机械、设备	-	-
CK	纺织、服装、服饰	-	-
CL	木材、家具	-	-
CM	造纸	-	-
CN	玻璃、陶瓷	-	-
CO	橡胶、塑料	-	-
CP	有色金属	-	-
CQ	电气、电子、通讯、设备	-	-
CR	能源	-	-
CS	交通运输、仓储	-	-
CT	信息技术	-	-
CU	基础化学原料	-	-
CV	医药、生物、医药	-	-
CW	其他	-	-
D	电力、热力、燃气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储	-	-
G	信息技术	-	-
H	基础化学原料	-	-
I	医药、生物、医药	-	-
J	有色金属	-	-
K	轻工、纺织服装	-	-
L	橡胶、塑料	-	-
M	合计	0.00	0.00

(三)基金投资前十名股票明细  
基金本报告期末未持有股票投资。

(上接30版)

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(四)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(五)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(六)报告期末本基金未持有权证投资。

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(六)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(六)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(六)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(六)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(六)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。

4. 本基金本报告期末其他资产的构成:

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	应收证券清算款	260,000.00	0.38
2	应收利息	6.00	0.00
3	应收股利	-	-
4	其他应收款	86,748,226.69	126.5
5	其他资产	87,537,313.92	128.0
6	其他	-	-
7	合计	174,336,566.61	254.9

5. 报告期末持有的可转换债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	12570	42,899,542.54	64.3
2	11967	18,751,266.10	28.2
3	11978	8,414,096.20	12.6

(六)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	4,500,000.00	6.63
2	央行票据	44,375,000.00	65.2
3	金融债	4,277,000.00	6.3
4	企业债	3,500,000.00	5.1
5	可转债	385,823,000.00	5.68

(七)投资组合报告附注

1. 本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的10%。

2. 报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体均未发生被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

3. 本基金投资的前十名股票均未超出基金合同约定的备选股票库。