

# 申万巴黎盛利强化配置混合型基金招募说明书 第十一次更新摘要

基金管理人：申万巴黎基金管理有限公司  
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

【重要提示】

●本基金基金合同已于2004年11月29日生效。  
●投资有风险，投资人申购基金时应认真阅读招募说明书。  
●基金的过往业绩并不预示其未来的表现。  
●本摘要根据本基金之基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金情况其他有关权利和义务，应详细查阅基金合同。

●本招募说明书(更新)所载内容截止日为2010年5月31日，有关财务数据和净值表现截止日为2010年3月31日(财务数据未经审计)。

## 一、基金管理人

(一)基金管理人概况  
申万巴黎基金管理有限公司  
1、设立日期：2004年1月15日  
2、注册地址：中国上海淮海中路300号40层  
3、法定代表人：姜国芳  
4、办公地址：中国上海淮海中路300号40层  
5、办公电话：+862123261188  
6、联系人：王菲萍  
7、注册资本：人民币1.5亿元  
8、股本结构：申银万国证券股份有限公司持有67%的股权，法国巴黎资产管理有限持有33%的股权  
(二)主要人员情况  
1、董事会成员：  
姜国芳先生，董事长，男，1957年出生。高级经济师，工商管理硕士。1980年至1984年任职于中国人民银行上海市分行，1984年至1992年任职于中国工商银行上海市分行组织处，1992年至1996年任职于上海申银证券有限公司，董事副总经理，党委副书记。1996年至2004年2月任申银万国证券股份有限公司执行副总裁，兼申银万国(香港)有限公司董事长。  
毛剑鸣先生，董事，1969年出生。美国肯特州立大学金融博士毕业。1992年至1994年在阿克隆大学任经济系助教，1995年至1999年在肯特州立大学任金融系讲师，1999年至2002年任HFR资产管理公司董事总经理。2002年至2007年任富兰克林邓普顿基金集团副总裁及高级投资经理。  
杜平先生，董事，男，1963年出生。经济师，法学硕士。1989年至1990年在湖北省武汉市政府政策研究室任科员、副主任科员，1990年底至1993年初在湖北省武汉市政府办公厅任副市秘书长、主任科员。1993年初至1998年初在交通银行总行秘书处、条法处先后担任副行秘书长、行秘书长、党组书记。1998年起任交通银行深圳分行副行长，2000年7月任交通银行新加坡分行行长。2003年10月起加盟申银万国证券股份有限公司，任公司副总裁。

陆文清先生，董事，男，1958年出生。高级经济师，硕士。1981年至1983年任职于中国工商银行上海分行，1983年至1986年任职于中国驻加拿大使馆经参处。1986年至1990年任职于中国工商银行上海信托投资公司，1990年至1996年任上海申银证券公司总裁助理兼国际业务总部总经理，1996年至今任申银万国证券股份有限公司，现任公司副总裁。  
MaxDitulis先生，董事，1963年出生。巴黎工商联合商学院毕业，现任法国巴黎资产管理有限公新兴市场与开发部主管；曾任法国巴黎银行固定收益基金经理，法国巴黎银行并购融资、法国巴黎银行公司发展和资产偿还部主管等。  
毛应耀先生，独立董事，1937年出生。1961年至1985年任职于中国人民银行，曾任中国人民银行上海分行副行长。1985年至1991年任中国工商银行上海分行行长、党委副书记、书记，1991年至1999年任中国人民银行上海市分行行长、党组书记。1999年至2003年任上海证交所理事副理事长、顾问。  
王大东先生，独立董事，1955年出生。1984年至1988年任中国驻法国大使馆二等秘书，1991年至1993年任国家行政学院筹建处办公室主任，1994年至2000年供职于法国雷诺汽车公司北京代表处，先后任副代表和首席代表。2001年至2004年在法国雷诺卡车公司北京代表处任首席代表，2004年至2007年任法国阿尔斯通(中国)投资公司副总裁，2007年9月至今任欧洲宇航防务集团中国公司副总裁。

袁惠航先生，独立董事，1938年出生。曾任社会科学院经济研究所研究室主任、所长，现任上海市经济学会会长、上海社会科学院经济研究所顾问。  
赵霄路先生，独立董事，1950年出生。曾任职于司法部香港中国法律经济研究中心、香港何耀雄律师事务所、康达律师事务所。现任北京众鑫律师事务所上海分所主任、律师。

刘儒盛先生，监事，1930年出生。全国政协经济委员会副主任、教授、博士生导师。1959年在莫斯科大学经济系研究生毕业，获副博士学位，回国后，先后任中国人民银行处长、党组书记、农业银行副行长、中国人民银行副行长、国家经济体制改革委员会副主任、中国证监会主任。

JeanAudibert先生，监事，1951年出生。1975年加入法国巴黎银行，先后在科威特、新加坡、韩国等地工作。1996年至2001年任法国巴黎银行总部国际贸易服务部门负责人。2001年至2005年任法国巴黎银行总部现金管理业务负责人。2005年至2008年任新加坡巴黎资产管理有限公总裁兼CEO。2009年1月至今，任法国巴黎资产管理有限公亚洲新兴市场主席。

王厚道先生，监事，申万巴黎基金管理有限公司行政管理总部负责人。1951年出生，研究生学历。自1978年起任职上海船舶研究设计院，1994年任职万国房地产开发公司任办公室主任；1997年任职申银万国证券股份有限公司人力资源部薪酬部经理。2004年1月加盟本公司。

6、高级管理人员  
毛剑鸣先生，总裁，相关介绍见董事会成员部分。  
赵耀华先生，副总裁，1964年出生，工商管理硕士。1983年至1990年任职于中国工商银行上海分行，1990年至1993年任上海申银证券公司国际业务部经理。1997年至1999年任万远达投资管理(亚洲)有限公司联席总裁，1999年至2004年2月任申银万国证券股份有限公司国际业务总部副总经理。2004年3月至2005年2月任申万巴黎基金管理有限公司督察长。  
4、督察长：  
来肖贤先生，1969年出生，经济学硕士；曾任本公司监察稽核部副总经理；在本公司任职之前，曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部投资分析师、部门副经理。

6、基金经理  
张维维先生，英国华威大学经济与金融学硕士。自2005年起从事基金工作，历任北京天相投资顾问公司分析师。2007年3月加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部任行业分析师，2009年6月至2009年9月任申万巴黎盛利精选证券投资基金基金经理助理，2009年9月起任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理。  
徐荔蓉先生，2004年11月至2006年2月任本基金基金经理。

李源海先生，2006年2月至2009年8月任本基金基金经理。  
6、投资决策委员会组成  
投资决策委员会由下述执行委员组成：总裁、副总裁、投资总监、基金经理代表、组合投资经理代表。委员会执行委员在会议期间对所决策事项有投票权。  
非执行委员有下列人员组成：研究负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资经理。非执行委员对需决策事项可发表观点，但不参与决策事项的投票表决。  
本公司总裁担任投资决策委员会主席，投资总监担任投资决策委员会会议召集人。  
本公司董事长、督察长和风险管理总监和首席金融工程师有权列席投资决策委员会的任何会议。  
7)上述人员之间不存在近亲属关系。

名称：中国工商银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号  
成立时间：1984年1月1日  
法定代表人：姜建清  
注册资本：人民币334,018,850,026元  
联系电话：010-66105799  
联系人：蒋松云

## 三、相关服务机构

(一)基金份额发售机构  
1、直销机构  
申万巴黎基金管理有限公司直销中心  
申万巴黎基金管理有限公司  
注册地址：中国上海淮海中路300号40层  
法定代表人：姜国芳  
电话：+862123261188  
传真：+862123261199

联系人：陈继红陈景新  
客户服务中心电话：+8621962299，或4008808588  
2、代销机构  
(1)名称：中国工商银行股份有限公司  
法定代表人：姜建清  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号  
联系人：田耕  
客户服务电话：95588  
传真：+861066107914  
网址：www.icbc.com.cn  
(2)名称：中国建设银行股份有限公司  
法定代表人：郭树清  
注册地址：北京市西城区金融大街25号  
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼  
联系人：王琳  
客户服务电话：95533  
传真：010-66275654  
网址：www.ccb.com

(3)名称：中国农业银行股份有限公司  
注册地址：北京市东城区建国门内大街69号  
法定代表人：项俊波  
传真：+86-10-85109219  
联系人：蒋浩  
客户服务电话：95599  
网址：www.abchina.com  
(4)名称：交通银行股份有限公司  
住所：上海市浦东新区银城中路188号  
办公地址：上海市银城中路188号  
法定代表人：胡怀邦  
电话：021-58781234  
传真：021-58408842  
联系人：曹榕  
客户服务电话：95559  
网址：http://www.bankcomm.com/

(5)名称：上海浦东发展银行股份有限公司  
注册地址：上海市浦东新区浦东南路500号  
办公地址：上海市中山东一路12号  
法定代表人：吉晓辉  
传真：021-63604199  
联系人：汤嘉惠、虞谷云  
客户服务热线：95528  
公司网站：www.spdb.com.cn

(6)名称：中国民生银行股份有限公司  
注册地址：北京市西城区复兴门内大街2号  
办公地址：北京市西城区长兴街88号  
法定代表人：董文标  
客服电话：95568  
联系人：陆红霞  
电话：010-83914283  
网址：www.cmbc.com.cn

(7)名称：中信银行股份有限公司  
注册地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座  
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座  
法定代表人：孔丹  
客服电话：95558  
联系人：金雷  
传真：+86-10-65550827  
网址：http://bank.ecitic.com

(8)名称：深圳发展银行股份有限公司  
注册地址：广东省深圳市罗湖区深南东路5047号  
法定代表人：法兰克纽曼(Frank N. Newman)  
联系人：周翀  
传真：0755-82080466  
客户服务电话：95501  
公司网站：www.sdb.com.cn

(9)名称：南京银行股份有限公司  
注册地址：南京市白下区淮海路50号  
办公地址：南京市白下区淮海路50号  
法定代表人：林夏  
电话：025-84544129  
联系人：贾贤  
传真：+862154053533  
网址：www.njcb.com.cn

(10)名称：申银万国证券股份有限公司  
注册地址：上海市常熟路171号  
法定代表人：丁国荣  
传真：+862154053533  
联系人：郑永冰  
客服电话：021-962505  
公司网站：www.sw2000.com.cn

(11)名称：中信建投证券股份有限公司  
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼  
办公地址：北京市朝阳区内大街188号  
法定代表人：张佑君  
联系人：权睿  
开放式基金业务电话：400-8888-106  
开放式基金咨询电话：010-65182281  
公司网站：www.csc108.com

(12)名称：海通证券股份有限公司  
注册地址：上海市淮海中路98号  
办公地址：上海市广东路689号  
法定代表人：王开国  
联系人：金芸、李笑鸣  
客户服务电话：400-8888-001(全国)，021-95553，或拨打各城市营业网点咨询电话  
公司网站：www.htsec.com

(13)名称：国泰君安证券股份有限公司  
注册地址：上海市浦东新区银城中路61号  
办公地址：上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层  
法定代表人：杨炯一  
传真：021-38670161  
客户服务电话：4008888666  
公司网站：www.gta.com

(14)名称：招商证券股份有限公司  
注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层  
法定代表人：肖亚林  
传真：+8675582943636  
联系人：黄健  
客户服务热线：4008888111、95565  
公司网站：www.newone.com.cn

(15)名称：中国银河证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座  
法定代表人：顾伟国  
客户服务热线：4008888888  
传真：+86010-66568116  
联系人：李洋  
公司网站：www.chinastock.com.cn

(16)名称：广发证券股份有限公司  
住所：广东省天河区北路183号大都会广场43楼  
办公地址：广东广州天河区北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼  
法定代表人：王志伟  
电话：95575或致电各营业网点  
传真：020-87555417  
联系人：黄斌  
公司网站：www.gf.com.cn

(17)名称：光大证券股份有限公司  
注册地址：上海市静安区新闻路1508号  
法定代表人：徐浩明  
联系人：刘晨  
客户服务电话：4008888788、10108998  
传真：021-68815009  
公司网站：www.ebscn.com

(18)名称：东方证券股份有限公司  
注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层  
法定代表人：王益民  
联系人：吴宇  
传真：021-63326173  
客户服务电话：+86-21-95503  
东方证券网站：www.dfzq.com.cn

(19)国元证券股份有限公司  
注册地址：安徽省合肥市寿春路179号  
法定代表人：凤良志  
传真：0551-2207965  
联系人：倪雨萍  
客户服务电话：400-8888-777、95578  
网址：www.gyzq.com.cn

(20)名称：信达证券股份有限公司  
注册地址：北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层  
办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心  
法定代表人：张志刚  
联系人：唐静  
客服电话：400-800-8899  
公司网站：www.cindasc.com

(21)名称：江南证券有限责任公司  
注册地址：江西省南昌市抚河北路291号  
法定代表人：姚江涛  
联系人：余雅娜  
客服电话：0791-6768763  
网址：www.jsstock.com

(22)湘信证券有限责任公司  
注册地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层  
办公地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信信托大厦9楼  
法定代表人：何如  
联系人：齐晓燕  
电话：0755-82133302  
客户服务热线：95536  
网址：www.guosen.com.cn

(二)注册与过户登记人  
申万巴黎基金管理有限公司  
注册地址：上海淮海中路300号，香港新世界大厦40层  
法定代表人：姜国芳  
电话：+862123261188  
传真：+862123261199  
联系人：陈景新  
(三)律师事务所和经办律师  
律师事务所：通力律师事务所  
注册地址：上海市银城中路68号，时代金融中心19楼  
负责人：韩凯  
电话：+862131358660  
传真：+862131358660  
经办律师：秦悦民、王利民  
(四)会计师事务所和注册会计师  
会计师事务所：普华永道中天会计师事务所有限公司  
注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室  
办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
法定代表人姓名：杨绍辉  
电话：+86-21-23238888  
传真：+86-21-23238800  
联系人姓名：张鸣  
经办注册会计师姓名：汪桂、张鸣

## 四、基金的名称

本基金名称：申万巴黎盛利强化配置混合型基金  
基金类别：混合型基金

## 五、基金的投资目标

本基金为争取绝对收益概念的基金产品，其投资管理秉承本基金管理人的主动型投资管理策略。  
本基金管理人以积极主动和深入的研究为基础结合先进的投资组合模型，通过灵活的动态资产配置和组合保险策略，尽最大努力规避证券市场波动的系统性和波动性风险以尽可能保障投资本金安全，并分享股市上涨带来的回报，实现最优化的风险调整后的投资收益为目标，但本基金管理人并不对投资本金进行保本承诺。

## 六、基金的投资范围

根据法律法规的规定，本基金的投资范围在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。  
具体投资对象将根据公司研究成果以及流动性分析，以优质债券与央行票据和具有优秀成长性和投资价值并具良好流动性的上市公司股票为主。

在一级资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例：固定收益证券55%-100%，股票0%-45%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述限定。法律法规另有规定时，从其规定。

## 七、基金的投资策略

本基金采用主动型投资管理策略，在积极主动和深入的宏观研究分析和判断的基础上，结合本基金管理人自主开发的主动式资产配置模型进行一级资产配置，以配置基金总资产在股票、固定收益证券的比例；参考选时模型判断市场走势并决定是否调整投资组合或进行融资以适当扩大固定收益证券的投资规模以争取更好的收益，但不超过基金资产净值的25%为限；采用基于投资组合保险策略开发的资产再平衡模型，控制整体投资组合仓位可能损失。

股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略，由主动式行业矩阵模型确定行业配置，个股选择采取“自下而上”的选股过程，投资具有良好流动性的成长性股票争取当期收益；固定收益证券投资使用利率预期策略、收益率曲线策略和久期策略进行组合管理。

本基金为追求绝对收益，以战胜一年期定期存款利率为投资目标的首要目标。因此，本基金的投资操作应以争取正的投资收益为首要目标；一年期定期存款利率是一个相对稳定的基准，在有效控制基金跟踪误差的前提下，基金的收益风险特征将会呈现一个长期稳健增长的态势。由此，在本基金运作过程中，风险控制乃为实现投资目标之关键所在，基金管理人应在控制风险最小的前提下追求收益。

此外，将本基金定位为追求绝对收益的目的，是让基金管理人资产配置有更强大的主动性和灵活性。在投资的过程中，基金管理人必须严格遵循风险管理的原则，系统化地管理对各类资产的投资，特别是控制风险资产的投资进程。基金管理人将相对对大部分的基础资产配置于固定收益类证券，以获取相对稳定的利息收益，然后在市场形势有利的时候，再逐步加大对相对高风险、高收益的股票的投资比例，以提高基金的收益，并在适当时机实现股票的投资收益。相反，在市场存在较大的下跌风险时，本基金可以全面回避风险资产的投资，而主要通过固定收益证券的投资获取一定的收益。

由于本基金将以基金年度为周期调整基准底线的风险控制水平并不间断地考察基金的投资绩效，在每个投资周期内，通过对固定收益证券和股票投资比例动态调整，争取到本基金能够在承担较低风险的基础上获取高于银行存款利率的收益。

以数量化模型为基础的资产配置策略和严格的风险控制是本基金争取绝对收益的重要手段。灵活的主动式资产配置模型(AAAM)和选时模型(MTM)的合理应用是本基金提高收益的关键；而以投资组合保险技术和VAR值跟踪为基础的资产再平衡模型则是降低风险的关键。

## 八、基金的业绩基准

本基金定位于一年以绝对报酬率评估投资业绩的混合型基金，以争取超越同期银行一年期存款利率的收益为目标。

## 九、基金的投资程序

本基金管理人的投资决策程序包括：投资决策委员会决策、投资总监决策、构建备选池、研究选股及确认资产配置、建立投资组合、风险评估、信息反馈七步骤。在本基金的投资管理过程中，这七个步骤的决策内容分配如下：  
表1：投资决策程序

步骤名称	主要内容	负责部门
1 投资决策委员会决策	投资决策委员会是公司的最高投资决策层。对投资总监提交的投资策略和资产配置进行讨论，做出判断并形成决策报告，交投资决策总监核准。	投资决策委员会
2 投资总监决策	投资总监根据基金经理和分析师的研究结果和投资建议，结合主动式资产配置模型推荐的资产配置方案，拟定资产配置方案提交投资决策委员会批准，并负责贯彻执行以已经形成决议的资产配置方案，同时负责在其授权范围内决定资产配置调整。	投资总监
3 构建备选池	金融工程师负责建立股票池和固定收益证券备选池，以此作为深入研究的数据库，就具体的投资工具和方法提出建议，与基金经理和分析师讨论如何完善化模型。	金融工程师
4 研究个股和资产配置	股票分析师根据投资总监下达的任务进行独立的研究工作，包括公司调研、建立财务模型及撰写投资建议等；固定收益分析师对宏观经济和利率变化趋势进行研究并撰写固定收益证券的投资建议报告。研究结果经投资决策委员会讨论后达成结论，必要时做出修改并备案。	分析师
5 建立投资组合	基金经理根据投资总监下达的资产配置指令和投资委员会作出的结论构建投资组合。在构建投资组合的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求，同时其投资组合调整的范围必须在被授权的范围内进行。	基金经理

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	22,970,419.45	31.85
其中：股票	22,970,419.45	31.85	
2	固定收益投资	43,979,400.00	60.97
其中：国债	43,979,400.00	60.97	
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	2,256,968.81	3.13
6	现金	2,920,732.64	4.05
7	合计	72,127,520.90	100.00

十一、基金的投资报告  
本投资组合报告所载数据截止日为2010年3月31日，本投资组合中所有财务数据未经审计。

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	22,970,419.45	31.85
其中：股票	22,970,419.45	31.85	
2	固定收益投资	43,979,400.00	60.97
其中：国债	43,979,400.00	60.97	
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	2,256,968.81	3.13
6	现金	2,920,732.64	4.05
7	合计	72,127,520.90	100.00

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	-	-
B	采掘业	809,200.00	1.14
C	制造业	9,532,225.45	13.40
C0	食品、饮料	17,500.00	0.02
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	943,417.45	1.33
C4	石油、化学、塑胶、塑料	2,768,000.00	3.89
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	5,803,308.00	8.16
C8	医药、生物制品	260,000.00	0.36
C9	其他制造业	-	-
D	房地产业	-	-
E	电力、煤气及水的生产和供应业	4,912,000.00	6.91
F	建筑业	-	-
G	交通运输、仓储业	-	-
H	信息技术业	18,500.00	0.03
I	批发和零售贸易	-	-
J	金融、保险业	1,846,000.00	2.60
K	社会服务业	4,788,000.00	6.73
L	传播与文化业	-	-
M	综合类	1,064,494.00	1.50
合计		22,970,419.45	32.31

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	600256	广汇股份	150,000	4,788,000.00	6.73
2	002005	德豪润达	190,000	3,855,100.00	5.42
3	002324	普利特	80,000	2,768,000.00	3.89
4	600795	国电电力	300,000	2,481,000.00	3.49
5	600396	金山软件	260,000	2,431,000.00	3.42
6	601166	兴业银行	50,000	1,846,000.00	2.60
7	000541	佛山照明	100,000	1,064,000.00	1.81
8	600157	鲁商置业	51,400	1,064,494.00	1.50
9	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
10	002340	格林美	10,000	809,200.00	1.14

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,119,400.00	5.79
2	央行票据	39,860,000.00	56.04
3	金融债券	-	-
其中：政策性金融债	-	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	-	-
7	合计	43,979,400.00	61.83

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	1001022	10国债22	400,000	39,860,000.00	56.04
2	010107	21国债(7)	20,000	2,113,800.00	2.97
3	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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	300057	万福生科	43,177	943,417.45	1.33
2	010004	20国债(4)	20,000	2,005,600.00	2.82

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(%)
----	------	------	-------	---------	--------------