

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	457,679,537.86	90.95
	其中：债券	457,679,537.86	90.95
	资产支持证券	-	-
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	20,317,321.40	4.04
6	其他各项资产	25,227,839.58	5.01
7	合计	503,224,698.84	100.00

注：截至 2010 年 6 月 30 日，上投摩根纯债债券型证券投资基金资产净值为 483,582,385.41 元。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	127,952,000.00	26.46
3	金融债券	131,026,000.00	27.09
	其中：政策性金融债	131,026,000.00	27.09
4	企业债券	110,173,705.70	22.78

5	企业短期融资券	60,306,000.00	12.47
6	可转债	28,221,832.16	5.84
7	其他	-	-
8	合计	457,679,537.86	94.64

5.5 报告期末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

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	080416	08农发16	500,000	50,910,000.00	10.53
2	050413	05农发13	500,000	50,035,000.00	10.35
3	0901036	09央行票据 36	500,000	49,085,000.00	10.15
	0901040	09央行票据 40	500,000	49,085,000.00	10.15
5	070415	07农发15	300,000	30,081,000.00	6.22

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有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、处罚的情况。

5.8.2 报告期内本基金投资的前十名股票中没有在基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.8.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	250,000.00
2	应收证券清算款	10,295,170.55
3	应收股利	-

4	应收利息	10,568,848.28
5	应收申购款	4,113,820.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	25,227,839.58

5.8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	110003	新钢转债	2,416,280.10	0.50
2	110004	厦工转债	1,241.50	0.00
3	110007	博汇转债	2,851,550.00	0.59
4	110008	王府转债	2,147,002.20	0.44
5	125709	唐钢转债	11,903,026.80	2.46
6	125960	锡业转债	1,030.86	0.00

5.8.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票无流通受限情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。