

## 万家和谐增长混合型证券投资基金更新招募说明书摘要

2009年1号

**重要提示**

本基金由基金管理人申请并经中国证监会核准注册，基金合同于2006年11月30日生效。

投资者有风险，投资者申购基金时应认真阅读本基金基金合同和招募说明书。

本基金管理人及其所管理基金的过往业绩并不预示本基金未来表现。

本摘要根据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《基金法》、《运作办法》、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份额持有人的权利和义务，应仔细阅读本基金的基金合同。

本基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，基金管理人不能保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

本招募说明书(更新)所载内容截止日为2008年11月30日，有关财务数据和净值表现截止日为2008年9月30日(财务数据未经审计)。

**第一部分 基金管理人**

一、基金管理人概况

(一)名称:万家基金管理有限公司

(二)注册地址:上海市浦东新区福山路450号新天国际大厦23楼

(三)办公地址:上海市浦东新区福山路450号新天国际大厦23楼

(四)法定代表人:柳亚明

(五)总经理:李振伟

(六)成立日期:2002年8月23日

(七)批准设立机关及批准设立文号:中国证监会证监基金字【2002】44号

(八)经营范围:基金管理业务;发起设立基金;中国证监会批准的其他业务

(九)组织形式:有限责任公司

(十)注册资本:1亿元人民币

(十一)存续期间:持续经营

(十二)联系人:刘涛

(十三)电话:021-38619999 传真:021-38619888

二、主要人员情况

(一)基金管理人董事会成员

拟任董事长孙国茂先生,1960年生,中共党员,经济学博士,教授级研究员,曾任天同证券有限责任公司总经理助理、财务总监等职,2003年11月至今任齐鲁证券有限公司董事兼总经理。2007年12月,经本公司2007年第二次临时股东大会选举为本公司第二届董事会董事,并同经公司第二届董事会第一次会议选举为董事长。

董事王亚国先生,1968年生,中共党员,研究生,高级会计师,曾任莱钢集团莱钢股份公司炼铁厂财务科科长、莱钢集团莱钢股份公司财务处成本科科长、莱钢集团财务部部长、莱钢日照钢铁有限公司财务总监、齐鲁证券经纪有限公司计划财务部总经理,2004年4月起任齐鲁证券有限公司副总经理兼财务负责人。

董事李振伟先生,1968年生,中共党员,大学本科,学士学位,高级经济师。1998年6月起从事证券监管工作,先后任证监会济南证监局办公室副主任、上市处主任科员,证监会济南证监局上市处、机构处副处长,证监会山东证监局机构处副处长、处长等职。2007年12月起任本公司董事、总经理。

董事陈晓光先生,1967年生,中共党员,研究生,硕士学位,经济师。曾任上海久事公司资产管理二部总经理助理、上海浦江镇投资发展有限公司副总经理等职,现任上海久事公司资产管理部副经理。

董事魏翔南先生,1971年生,中共党员,大学本科,学士学位,经济师,1989年10月至2003年10月任教于江西长运股份有限公司,江南信托投资有限公司,2003年起历任江南信托投资有限公司资金计划部副经理、江南信托投资有限公司副总经理。

独立董事王树刚先生,1945年生,中共党员,大学本科学历,教授、博士生导师。历任山东菏泽商业局会计科长、山东经济学院院长等职。

独立董事易宪容先生,1958年生,博士,教授级研究员,曾任湖南师范大学教授、香港大学经济金融学院合作研究员、台湾清华大学经济系合作研究员、中国社会科学院财贸所研究员、中国社会科学院金融所研究员,2006年至今任中国社会科学院金融所教授、研究员。

独立董事陈增辉先生,1961年生,中国民主建国会会员,博士,教授,曾任山东大学管理学院讲师、教授、法国国家信息与自动化研究所博士后、加拿大西安大略大学商学院访问学者、兼职教授,2002年6月至2004年10月任山东大学金融研究院常务副院长兼学院院长。

独立董事刘福胜先生,1944年生,中共党员,博士学位,博士生导师,教授,研究员,曾任中国社会科学院农村经济研究所、副所长、研究生院农经系主任、中国社会科学院科技研局学术秘书(负责经济学领域)、国务院特区办公室研究室副主任、浙江省温州市副市长、国家计划委员会、国家发改委委员会经济研究所所长、宏源证券研究院院长兼经济体制改革与管理研究所所长等职,现任中国人力资源开发研究会会长和中国区域经济研究会常务副会长。

(二)基金管理人监事会成员

监事会主席柳亚明先生,1964年生,中共党员,硕士研究生,高级经济师。历任中国人民银行烟台分行办公室副主任、中国人民银行威海分行办公室主任、中国人民银行山东省分行管理处处长、山东证券(天同证券)有限责任公司总裁、副董事长等职。2002年至2007年12月任本公司董事长,2007年12月起任本公司监事会主席。

监事孙江先生,1965年生,中共党员,本科学历,企业法律顾问,先后任职于华东政法学院法律系、上海上菱电器股份有限公司。现任职于上海久事公司。

监事余萌先生,1963年生,中共党员,研究生学历,学士学位,高级经济师,曾任江西农行德兴支行科长、江西省农行国际业务部科长、副总经理、南昌城市资产管理处处长等职,2003年11月至今在江南信托投资有限公司副总裁、常务副经理。

监事陈伟先生,1970年生,中共党员,工商管理硕士,经济师,曾任交通银行上海分行个人金融业务部消费信贷科科长、信用卡部市场科科长、个人理财中心主任等职,2006年5月至今任万家基金管理有限公司银行渠道部总经理。

(三)基金管理人高管人员

拟任董事长:孙国茂先生(简介请参见“基金管理人董事会成员”)

总经理:李振伟先生(简介请参见“基金管理人董事会成员”)

副总经理:杨峰先生,1963年生,理学博士,中共党员,历任山东大学助教、讲师、副教授等职,2000年7月至2002年北京理工大学博士后流动站、深圳证券交易所博士后工作站站长等,2002年3月至2004年3月在泰达荷银基金管理有限责任公司担任战略规划部总经理、公司职工监事等职,2004年3月至2005年9月在大成基金管理有限公司任规划发展部副总监(总监级)主持工作,2006年9月起任万家基金管理有限公司副总经理,2006年4月起任公司副总经理。

督察长:甘世雄先生,1963年生,中共党员,硕士。曾任山东金泰集团股份有限公司副总裁、天同证券有限责任公司财务总监、投资银行部总经理,从事股份制改造及股票发行、并购重组等工作多年,2004年至今担任公司督察长。

(四)本基金基金经理及基金经理助理

现任基金经理:李洪雨,男,复旦大学经济学硕士,CFA,曾任东北证券研究员,高级研究员,国联安基金管理有限公司高级研究员,基金经理助理,2008年9月进入万家基金管理有限公司工作,任本基金基金经理。

原基金基金经理:本基金成立时起至2008年9月任本基金基金经理。

(五)投资决策委员会成员

委员:钱华、杨峰、欧庆铃、张旭伟

李振伟先生,万家基金管理有限公司总经理。

钱华先生,万家基金管理有限公司拟任副总经理

杨峰先生,万家基金管理有限公司副总经理

欧庆铃先生,万家基金管理有限公司基金管理部总监、万家180基金、万家双引擎基金

基金经理

张旭伟先生,万家基金管理有限公司基金管理部副总监、万家债券基金、万家货币市场基金基金经理

(六)上述人员之间不存在近亲属关系。

**第二部分 基金托管人**

一、基金托管人概况

(一)基本情况

1、名称:兴业银行股份有限公司

2、注册地址:福州市湖东路154号

3、办公地址:福州市湖东路154号

4、法定代表人:高建平

5、注册日期:1988年7月20日

6、注册资本:50亿元人民币

7、托管部门联系人:张志水

8、电话:021-62677777/212004

9、传真:021-62159217

(二)托管业务部的部门设置及员工情况

兴业银行股份有限公司总行设资产托管部,下设综合处、核算管理处、稽核监察处、市场处、产品研发处、企业年金中心等处室,共有员工34人,平均年龄30岁,100%员工拥有大学本科以上学历,业务岗位人员均具有基金从业资格。

(三)基金托管业务经营情况

兴业银行股份有限公司于2005年4月26日取得基金托管资格。基金托管业务批准文号:证监基金字[2005]74号。截至2008年6月30日,兴业银行已托管开放式基金9只——兴业趋势投资混合型证券投资基金(QDII)、长盛货币市场基金、光大保德信红利股票型证券投资基金、兴业货币市场证券投资基金、兴业全球视野股票证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、中欣新趋势股票型证券投资基金(LOF)、天弘永利债券型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金,托管基金资产规模达404.6亿元。

**第三部分 相关服务机构**

一、本基金销售机构

(一)直销机构

名称:万家基金管理有限公司

办公地址:上海市浦东新区福山路450号新天国际大厦23楼

联系人:谢明敏、姚燕

电话:021-38619999 传真:021-38619888

客服电话:400-888-0800;021-68644599 客服传真:021-38619668

网址:www.wjasset.com

(二)场外代销机构

1、兴业银行股份有限公司

注册地址:福州市湖东路154号

办公地址:福州市湖东路154号

法定代表人:高建平

联系人:苏健

联系电话:(021)62292999

客户服务电话:95611

公司网址:www.cib.com.cn

2、中国建设银行股份有限公司

客服电话:95533(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网址:www.ccb.com

3、中国工商银行股份有限公司

客服电话:95588(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网址:www.icbc.com.cn

4、交通银行股份有限公司

注册地址:上海市银城中路188号 邮编:200120

5、中信银行股份有限公司

客服电话:95558(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网址:http://bank.ecitic.com

6、深圳发展银行股份有限公司

地址:深圳市深南东路5047号

法定代表人:法兰克纽曼(Frank N.Newman)

联系人:王敏

联系电话:0755-22166075

客户服务电话:95601

公司网址:www.sdb.com.cn

7、招商银行股份有限公司

客服电话:95555(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.cmbchina.com

公司地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦 邮编:518040

8、华夏银行股份有限公司

客服电话:95577(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.hxb.com.cn

公司地址:北京市东城区建国门内大街22号

9、民生银行股份有限公司

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

10、光大银行股份有限公司

客户服务电话:95695

网址:www.cebbank.com

11、齐鲁银行股份有限公司

注册地址:山东省济南市经十路128号

法定代表人:李伟

联系人:傅梅梅

联系电话:0631-82024184、0531-82024147

传真电话:0631-82024197

网址:www.qibz.com.cn

12、国泰君安证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区商城路618号

法定代表人:杨勇

联系人:芮娟

联系电话:021-62580818-213

传真号码:021-62569400

客服电话:4008-888-666

公司网址:www.gtja.com

13、中国银河证券股份有限公司

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:朱利

联系人:郭京华

联系电话:010-66568313,010-66568387

传真电话:010-66081632

客服电话:010-68016655

14、东北证券股份有限公司

注册地址:长春市人民大街138-1号

办公地址:长春市自由大路1138号

法定代表人:李树

联系人:高新宇

联系电话:0431-96688-99 0431-5096733

传真电话:0431-5680032

公司网址:www.nesc.cn

15、东方证券股份有限公司

注册地址:上海市浦东大道720号20楼

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

联系电话:021-50367888

传真电话:021-50369888

客户服务热线:021-962506

公司网址:www.dfzq.com.cn

16、广发证券股份有限公司

注册地址:广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心26楼2611室

办公地址:广东广州市天河区珠江新城36,38,41和42楼

法定代表人:王志伟

联系人:肖冲梅

联系电话:020-87558888-875

传真电话:020-87557985

公司网址:www.gf.com.cn

17、上海证券有限责任公司

注册地址:上海市江西路111号

法定代表人:蒋元真

联系人:刘永

联系电话:021-65076608-557

传真电话:021-65081069

公司网址:www.962518.com

18、江南证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市北京路208号

法定代表人:姚江涛

通讯地址:南昌市抚河北路291号

邮政编码:330008

联系人:余维敏

联系电话:0791-6768763

传真电话:0791-6789414

客服电话:0791-6768763

公司网址:www.scstock.com

19、民生证券有限责任公司

地址:北京市朝阳区朝阳门内大街16号中国人寿大厦1901室

法定代表人:岳献春

联系电话:010-85252605

传真电话:010-85252664

联系人:张娜

客服电话:0371-67639999

公司网址:www.mszzq.com

20、联合证券有限责任公司

公司地址:深圳市罗湖区深南东路5047号深圳发展银行大厦10.24.25层

法定代表人:马昭阳

电话:0755-82492000

联系人:盛宗凌

客服电话:400-8888-555,0755-25125666(或拨打各城市营业网点咨询电话)

公司网站:www.lhzzq.com

(三)场内代销机构

除上述销售机构外,投资者亦可通过“上证基金通”办理本基金的上海证券交易所场内申购与赎回(基金简称:万家和谐;基金代码:519181),通过具有基金代销业务资格并开通“上证基金通”业务的上交所会员均可办理本基金的场内申购与赎回。

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

二、注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

注册地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层

法定代表人:陈耀先

电话:010-58598888

传真:010-58598824

联系人:刘玉生

三、审计会计师事务所

名称:上海众华沪银会计师事务所

住所:上海市嘉定工业区沪宜路叶城路口

办公地址:上海延安东路550号海洋大厦12楼

法定代表人:林东模

联系电话:63525500

传真:63525566

四、律师事务所

名称:上海东方律师事务所以

地址:上海浦东新区600号国家开发银行大厦6楼

电话:58734110,50770771

联系人:杨志刚、华涛

**第四部分 基金名称**

本基金名称:万家和谐增长混合型证券投资基金

**第五部分 基金的类型**

本基金为契约开放式基金

**第六部分 基金的投资目标**

本基金通过有效配置股票、债券类资产,平衡长期资产持有和事件驱动投资的优势选择策略,控制投资风险,谋求基金资产的长期稳定增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券、现金、短期金融工具、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合资产配置比例为:股票资产占基金资产净值的30%—95%;权证资产占基金资产净值的0%—3%;现金、短期金融工具、债券等资产占基金资产净值的5%—70%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

如法律法规或中国证监会变更对权证等资产的比例限制,基金管理人可相应调整投资比例上限规定,不需经基金份额持有人大会审议。

**第七部分 基金的投资策略**

本基金的投资策略为:具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券、现金、短期金融工具、权证及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金投资组合资产配置比例为:股票资产占基金资产净值的30%—95%;权证资产占基金资产净值的0%—3%;现金、短期金融工具、债券等资产占基金资产净值的5%—70%,其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。

**第八部分 基金的投资策略**

本基金最大特点是突出和调增长,主要包含二层含义:一、资产配置和的,通过有效配置股票、债券资产比例,谋求基金资产在股票、债券投资中风险、收益的平衡;二、长期资产持有和事件驱动投资的和,通过对不同行业、不同股票内在价值与市场价格偏离程度和其市场价格向内在价值的回归速度的分析,谋求基金资产在不同行业和不同股票投资中长期投资和事件驱动投资的平衡。

(一)资产配置策略

本基金采用自上而下的宏观经济分析与自下而上的市场趋势分析相结合、定性分析和定量分析相补充的方法,以宏观经济分析为依据,结合对股票市场整体市盈率水平、债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的定量分析,形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测,以确定股票、固定收益证券和现金等大类资产在给定区间内的动态配置。

(二)行业配置

本基金管理人根据宏观经济分析、行业经济结构和行业所处成长类型分析,行业生命周期、行业前景、行业竞争力量对比分析、市场气氛分析,同时结合因产业结构优化升级、产业政策变化及短期利率、利率及通胀膨胀水平变化对行业发展的影响分析,评估各行业的相对投资价值,确定各行业配置比例。

(三)股票投资策略

本基金管理人在个股选择上,着重判断公司是否具备“盈利模式、资源、技术、资本、市场”等五个方面的独特竞争力。通过定性、定量分析,选择自身投资价值被市场低估的公司,评估其价格向其内在价值回归的速度和力度,把握个股投资机会,谋求价值的最优实现。

1、选择具有独特竞争力的上市公司

本基金管理人认为上市公司独特竞争力主要体现在盈利模式、资源、技术、资本、市场等五个方面,具备上述一项或多项竞争力的上市公司将在长期竞争中处于领先地位,这些

上市公司是本基金投资的主要标的。

(1)盈利模式

盈利模式是一个企业发展路径的战略决定因素,代表着企业的经营技术。在评判企业时,本基金管理人更加看重创新性盈利模式的可行性或传统性盈利模式的适用性。

(2)资源

资源指企业因需要、满足需求,所能提供而足以转化为具体服务内涵和产品的客体。本基金偏好选择拥有稀缺性资源的企业,因其增长方式的可持续性具备较大的保障。本基金将通过每股资源价值这个指标评判不同企业拥有资源的数量。

(3)技术

对于绝大部分处于竞争市场的企业,技术是差异化竞争策略的重要组成部分,理想的产品是具有较小技术风险,具有区别于竞争对手的专用特点,并且能够获得高于一般的平均回报。本基金将在以下几个方面评估企业的技术能力:

a. 技术的先进性;b. 技术的可替代性和易模仿性;c. 技术的适用性。

(4)资本

资本是企业正常运作和发展的要素之一。企业资本规模、资本的可获得性、资本成本直接决定了企业经营和发展的可持续性和抵御风险的能力。

(5)市场

本基金考察企业的市场状况,既要评判企业所面对市场的客观现状,也关注企业的市场运营能力。本基金倾向于寻找在一个不断膨胀的市场中,能以比较小代价获得市场份额快速增长的企业。评判企业所面对市场状况的指标为:a. 潜在顾客的需求量;b. 市场份额;c. 市场进入壁垒。评判企业的市场运营能力指标为:a. 营销能力;b. 市场保护能力。

2、选择市场价格明显低于内在价值的上市公司作为投资标的备选

基于本基金对上市公司独特竞争力的分析,利用财务定价模型对上市公司的内在价值做出评价,这里我们用FCFF模型为估计个股内在价值的框架模型。同时结合市盈率、市净率、市销率、PEG、EV/EBITDA等相关估值指标确定个股市场价格与内在价值的偏离程度,选择市场价格明显低于内在价值的上市公司作为投资标的备选。

3、长期跟踪与事件驱动相结合的投资选择

本基金认为股票二级市场市场的变化主要受到其基本面、估值偏离程度、事件驱动因素,如包括宏观经济、行业政策、市场气氛、公司事件在内的催化因素等多种影响。在选择具备独特竞争力、并具有足够安全边际的上市公司的基础上,事件驱动因素将成为短期影响股价变化的主要因素,其决定了价格向价值回归的速度和力度。

本基金根据对于A股市场长期走势的基本判断,利用定性分析,确定影响个股股价向其内在价值回归的因素,利用多因素模型等定量分析方法确定短期内个股股价向其内在价值回归的速度和力度,结合本基金管理人的经验,在长期投资与事件驱动投资中作出最优选择,实现基金资产的持续稳定增值。

(四)债券投资策略

配置型基金中债券投资管理的目标是分散股票投资的市场风险,保持投资组合稳定收益和充分流动性,追求基金资产的长期增值。

1、利率预期策略

因为利率变化是影响债券价格的最重要的因素,所以利率预期策略是本基金的基本投资策略。通过对宏观经济形势、财政与货币政策、金融监管政策、市场结构变化和资金供给等因素的分析,定性分析与定量分析相结合,形成对未来利率走势的判断,并依此调整组合的期限和品种构成。

2、久期控制策略

在利率变化方向判断的基础上,确定恰当的久期控制目标。在预期利率整体上升时,缩短组合的平均期限;在预期利率整体下降时,延长组合的久期。

3、期限结构配置策略

基准利率的变化对利率各期限结构的影响多数情况下并不是同等幅度的。根据对债券市场期限结构变动特征的历史分析和现阶段期限结构的分析,结合市场环境,并依此调整组合的期限结构,本基金还将利用利率操作、放大操作等多种策略,提高组合的超额收益。

4、类属配置策略

不同类型的债券在收益率、流动性和信用风险上形成差异,有必要采用类属配置策略,使债券组合资产配置于不同的债券品种(国债、企业债、金融债等),以及在不同的市场上进行配置(交易所和银行间)。

5、杠杆放大策略和套利策略

在具备条件下,本基金还将利用利率操作、放大操作等多种策略,提高组合的超额收益。

(五)权证等其他品种的投资策略

本基金将审慎投资于权证及中国证监会批准的其他金融工具,以减少基金资产的风险并提高基金的收益。

本基金在进行权证投资时,将对权证标的证券基本面进行研究,并结合权证定价模型寻求其合理估值水平,主要考虑运用的策略包括:杠杆投资策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略等。

**第九部分 基金的业绩比较基准**

本基金业绩比较基准为:“新华富时A600指数×65%+新华巴克莱资本中国全债指数×30%+同业存款利率×5%”。

其中“新华巴克莱资本中国全债指数”系由“新华雷曼中国全债指数”于2008年11月更名而来。

本基金是混合型基金,其预期收益及风险水平介于股票型基金与债券型基金之间,属于中等风险收益水平基金。

**第十部分 基金的投资组合报告**

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年12月12日复核了本报告中的财务指标、净值数据和投资组合报告内容,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9月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

(一)2008年9月30日基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产净值比例
股票	1,198,130,553.63	56.48%
债券	583,649,918.60	27.51%
权证	4,354,366.53	0.21%
银行存款及清算备付金合计	177,656,989.20	8.37%
其他资产	157,460,476.98	7.43%
资产合计	2,122,312,304.94	100.00%

(二)2008年9月30日按行业分类的股票投资组合

行业	金额(元)	占基金资产净值比例
A 农、林、牧、渔业	21,469,182.56	1.10%
B 采掘业	311,467,402.76	16.00%
C 制造业	332,803,980.46	17.09%
C0 食品、饮料	94,513,028.84	4.86%
C1 纺织、服装、皮毛	4,339,052.64	0.22%
C2 木材、家具	0.00	0.00%
C3 造纸、印刷	0.00	0.00%
C4 石化、石油、塑料、橡胶	76,971,047.27	3.95%
C5 电子	225,860.00	0.01%
C6 金属、非金属	13,454,004.06	0.69%
C7 机械、设备、仪表	76,310,449.78	3.92%
C8 医药、生物制品	66,990,483.87	3.44%
C9 其他制造业	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	54,008,152.78	2.77%
E 建筑业	95,048,300.88	4.90%
F 交通运输、仓储业	31,036,415.40	1.59%
G 信息技术业	40,067,846.56	2.06%
H 批发和零售业	73,229,826.84	3.76%
I 金融、保险业	236,478,717.39	12.10%
J 房地产业	0.00	0.00%
K 社会服务业	0.00	0.00%
L 传播与文化业	3,500,728.00	0.18%
M 综合类	0.00	0.00%
合计	1,198,130,553.63	61.55%

(三)2008年9月30日按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占基金资产净值比例
1	600123	兰花科创	8,640,556	156,048,441.36	8.02%
2	601186	中国铁建	10,154,733	95,048,200.88	4.88%
3	600028	中国石化	8,540,947	91,317,313.96	4.69%
4	600000	浦发银行	5,517,883	86,189,332.46	4.43%
5	000983	西山煤电	5,099,416	64,201,647.44	3.30%
6	000858	五粮液	3,409,188	56,933,606.60	2.92%
7	600036	招商银行	2,575,631	45,328,618.22	2.33%
8	601628	中国人寿	1,754,899	44,328,748.74	2.28%
9	600271	航天信息	1,924,008	40,057,846.56	2.06%
10	000001	浦发发展	2,663,739	39,929,447.61	2.05%

(四)2008年9月30日按债券种类分类的债券投资组合

债券类别	市值(元)	占基金资产净值比例
国债	149,836,445.20	7.70%
央行票据	327,015,000.00	16.80%
企业债	0.00	0.00%
金融债	0.00	0.00%
可转债	7,208,473.40	0.37%
国家政策性金融债券	99,500,000.00	5.12%
债券投资组合	583,649,918.60	29.98%

(五)2008年9月30日按市值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券明细

序号	债券代码	债券名称	市值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	010004	20国债(04)	101,530,000.00	5.2159%
2	070414	07农发14	99,500,000.00	5.1162%
3	0801106	08央票16	96,210,000.00	4.9426%
4	0801034	08央票34	96,160,000.00	4.9400%
5	0801073	08央票73	86,535,000.00	4.4456%

(六)2008年9月30日及报告期内权证投资情况

权证代码	权证名称	数量	市值(元)	占基金净资产比例	获得方式(被动持有或主动投资)
580026	江铜CWB1	2,664,851	4,354,366.53	0.22%	被动持有

(七)2008年9月30日资产支持证券市值占基金净资产的比例以及按市值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券明细

无。

(八)投资组合附注