

华安创新证券投资基金

更新的招募说明书摘要

2006年第1号

基金管理人:华安基金管理有限公司 基金托管人:交通银行股份有限公司 基金类型:契约型开放式

一、基金合同的生效日期

华安创新证券投资基金经中国证监会2001年8月15日证监基金字[2001]33号文件《关于同意华安创新证券投资基金设立的批复》批准发起设立,基金合同于2001年9月21日正式生效。

二、重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金募集的核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。

投资者应根据投资、申购基金时应认真阅读本招募说明书。

本基金通过业绩并不预示其未来表现。本章程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接受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。基金投资人认购基金份额的行为即视为对基金合同的承认和接受,基金管理人依照合同规定处理申购、赎回事宜,但本招募说明书中基金管理人依据恪尽职守,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。

本招募说明书经本基金托管人复核。除特别说明外,本招募说明书所载内容截止日为2006年3月21日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年3月31日。

三、基金管理人

(一)基金管理人概况

1. 名称:华安基金管理有限公司
2. 注册地址:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
3. 设立日期:1998年6月4日
4. 法定代表人:杜建国
5. 办公地址:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦2楼、37楼、38楼
6. 联系电话:(021)68881111
7. 联系人:冯鹤
8. 注册资本:15,000万元人民币
9. 股权结构:
上海电气(集团)总公司持股20%、上海国际信托投资有限公司持股20%、上海工业投资(集团)有限公司持股20%、上海浦东投资发展有限公司持股20%、上海广电(集团)有限公司持股20%。

(二)主要人员情况

1. 董事、监事及高级管理人员

(1) 董事会:
王功庆先生,大学学历,高级经济师。历任上海市仪器仪表工业供销公司副总经理、总经理,党委副书记,上海市机电商会总经理兼党委书记,上海广电(集团)公司副总裁,上海广电股份有限公司总经理、董事长,上海广电(集团)有限公司副总裁、总裁,党委副书记,上海电气(集团)总公司党委书记、董事长。

韩方河先生,研究生学历,高级经济师。历任上海市物价研究所所长,上海市物价局副局长,上海浦东信托投资公司证券总部副总经理、证券投资信托部总经理,现任华安基金管理有限公司董事、总经理。

廖昌基先生,大专学历,高级工程师。历任上海合成纤维研究所副科长,中石化上海石化总厂总编/总工程师、厂长助理,中石化上海石化股份(集团)有限公司董事长。

俞俊悦先生,大学学历,高级经济师。历任上海申信进出口公司副经理,上海国际信托投资公司上海总部副总经理兼办公室主任,ATV公司董事兼董事总经理,信托二部经理兼新上海国际大厦有限公司总经理、资金信托总部总经理、行政管理部副经理,现任上海国际信托投资有限公司副总经理。

顾培柱先生,大专学历,高级经济师。历任上海电子管二厂车间副主任,上海电子管厂副科长,办公室主任,上海电子管六厂、二厂厂长、副厂长,上海真空电子器件股份有限公司副总经理、副董事长、董事长,上海广电(集团)有限公司副总裁兼上海广电(集团)有限公司董事。

张军华先生,大学学历,会计师职称,中国注册会计师、中国注册税务师。历任湘财证券有限责任公司营业部、上海总部财务负责人,现任上海浦东投资发展有限公司财务总监。

独立董事:

曹凤岐先生,研究生学历,教授。现任全国政协委员、政协经济委员会委员、北京大学经济学院教授,博士生导师,北京、天津、云南、吉林省、成都市、上海市等省市专家顾问,北京市场经济研究所所长,《经济界》杂志社社长、主编。

吴伯庆先生,大学学历,一级律师,曾被评为上海市优秀律师与上海市十佳法律顾问。历任上海市城市建设局秘书长、上海市第一律师事务所律师主任、上海市金茂律师事务所律师,上海市律师协会理事,现任上海市金茂律师事务所律师高级合伙人,上海仲裁委员会仲裁员。

夏大顺先生,研究生学历,教授。历任上海财经大学科研处处长,上海财经大学南德管理学院院长,上海财经大学常务副校长,现任上海国家会计学院院长、党委书记,APCC 金融与发展项目执行秘书处秘书长,兼任香港中文大学荣誉教授,中国工业经济研究与开发促进会副会长,中国会计学会副会长,财政部会计准则委员会咨询专家,上海证券交易所上市公司专家委员会委员,上海工业经济专业研究会主任委员等职。

(2) 监事会:

陈毓女士,研究生学历,经济师。历任上海国际信托投资公司金融一部项目经理、资产信托总部实业投资部副经理、资产管理总部投资业务副科长,现任上海国际信托投资公司资产管理总部投资业务部科长。

唯明先生,研究生学历,高级经济师。历任上海宝钢五厂厂长兼党委副书记,宝钢钢铁厂党委支部书记、书记,上海宝钢“全面副经理”(主持)、综合办副主任(主持)、综合管理部副主任(主持),上海机电工业管理局局长秘书,上海机电控股(集团)公司办公室主任,上海电气(集团)总公司总裁助理兼集团办公室主任,现任上海电气(集团)总公司副总裁。

徐月女士,研究生学历,高级会计师,中国注册会计师。历任上海石化总厂财务会计、财务科长,中石化上海金山实业公司财务副部长,上海金山实业投资发展有限公司财务总监兼财务部主任,上海金山区财政局副局长,上海浦东开发办财务处处长兼上海浦东实业经济发展公司财务部经理,现任上海工业投资(集团)有限公司总会计师。

戴金宝先生,研究生学历,高级经济师。历任上海无线电三厂供销科科长,上海无线电二厂厂设计科设计师、书记室记助理、纪委书记,上海广电股份有限公司(原上海广播电视集团)组织部部长、办公室主任、董事会秘书等职,现任上海广电(集团)有限公司战略发展部经理。

蒋位先生,研究生学历,经济师。曾在上海财经大学任讲师,上海市发展计划委员会工作,现任上海浦东投资发展有限公司投资部高级经理。

孙志功先生,研究生学历,经济师。曾在上海国际信托投资公司综合研究、法律顾问、证券投资信托管理工作,历任华安基金管理有限公司监察稽核部总经理,现任华安基金管理有限公司总经理助理、研究发展部总监。

(3) 高级管理人员:

韩方河先生,研究生学历,高级经济师,23年经济、金融从业经验。历任上海市物价研究所所,上海市物价局政策研究处处长,上海国际信托投资公司证券总部副总经理、证券投资信托部总经理,现任华安基金管理有限公司董事、总经理。

陈毓女士,研究生学历,13年证券、基金从业经验。曾任上海万国证券股份有限公司基金管理部总经理助理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

姚毓林先生,研究生学历,13年证券和投资专业经验。曾是美国避险基金投资公司 Berens Capital 合伙人,并曾在美国道琼斯公司(Dow Jones)房屋抵押贷款债券部,美国高盛公司(Goldman Sachs)风险管理部和美国避险基金公司 Alpha Asset Management 工作,现任华安基金管理有限公司副总经理。

李昭强先生,研究生学历,19年基金工作经历。曾任国际证券投资信托公司资讯暨注册登记部主管、信富证券投资信托公司注册登记与IT资讯部主管、综合规划部副经理,现任华安基金管理有限公司副总经理。

章国富先生,研究生学历,20年经济、金融从业经验。曾任上海财经大学副教授、硕士生导师,上海华安会计师事务所会计师,中国银河证券经纪有限公司上海分公司副总经理,上海华安(集团)有限公司财务部部长(主持工作),上海虹虹投资管理有限公司副总经理兼上海新鑫投资管理有限公司财务总监,现任华安基金管理有限公司督察长。

二、基金管理人介绍

刘新明先生,硕士,10年证券从业经历,曾在淄博基金管理有限公司从事研究、投资工作。1999年6月加入华安基金管理有限公司后,曾任研究发展部高级研究员,华安中国A股基金的投资经理。

3. 本公司采取集体投资决策制度,投资决策委员会成员的姓名和职务如下:
韩方河先生,董事、总经理
姚毓林先生,副总经理
王国卫先生,总经理助理、基金投资部总监
孙志功先生,总经理助理、研究发展部总监
陈毓女士,固定收益部副总监
诸女士,集中交易部副总监

4. 上述人员之间均不存在近亲属关系。

四、基金托管人

(一)基金托管人基本情况
1. 名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)
注册地址:上海市银城中路188号 邮政编码:200120
办公地址:上海浦东新区浦东南路500号 邮政编码:200012
注册资本:3,800.7亿元
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]23号
联系人:张咏东
电话:(021)68888917

交通银行是中国第一家全国性股份制商业银行,自1987年重新组建以来,交通银行各项业务和机构持续健康发展,目前在我国137个大中城市设有分支机构,全行员工5万余人,截至2005年末,资产总额为14,234.39亿元人民币,实现税后利润92.49亿元人民币,根据《银行家》杂志最新排名,交通银行资产总额排名世界1000家大银行中第69位,2005年6月23日,交通银行成功在香港主板市场上上市,成为首家在境外上市的内地商业银行。1998年被评为《欧洲货币》评为“中国最佳银行”,1999年被评为《环球金融》评为“中国最佳银行”,2005年被评为《亚洲货币》评为“中国最佳银行”。

交通银行实行资产托管部,现有员工60余人。现有人员具有多年基金、证券和信托的从业经验,具备基金从业资格,并具有经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支投资实践、风险控制、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况
张建国先生,交通银行行长,经济学硕士,1997年6月任中国工商银行天津分行副行长,党委书记,1998年9月任中国工商银行国际业务部总经理,2001年9月任交通银行副行长,党委委员,2004年5月任交通银行行长,党委副书记,副董事长。

李庆华先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,经济学硕士,高级经济师。曾任交通银行武汉分行副经理,武汉分行行长兼党委书记,交通银行总稽核,党委委员,董事。2000年11月至今任交通银行副行长,党委委员,董事。

阮红女士,交通银行资产托管部总经理,复旦大学企业管理专业博士研究生学历,高级经济师。具有近二十年银行金融从业经验,在银行经营管理方面具有丰富的理论与实践经验。曾任交通银行调研部副主任,交通银行办公室秘书处主任科员,交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长,交通银行办公室综合处处长,交通银行海外机构管理部副总经理,总经理,交通银行上海分行副行长,党委委员,2006年1月至今任交通银行资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况
截止2006年底,交通银行受托证券投资基金31只,包括普惠基金、安顺基金、汉兴基金、裕华基金、兴科基金、安久基金、科讯基金、久富基金、华安创新基金、科瑞基金、国寿基金、增长基金、华夏债券基金、鹏华基金、成长基金、周期、稳定、鹏华普天系列基金、债券、交易、海富通稳健基金、博时现金收益证券投资基金、新方法50指数证券投资基金、融通行业景气证券投资基金、鹏华中国50开放式证券投资基金、金鹰中小盘精选证券投资基金、国富天益价值证券投资基金、华安宝利证券投资基金、国联优势证券投资基金、银华蓝筹股市场证券投资基金、银华货币市场证券投资基金、湘财风险预算混合型证券投资基金等基金,万家公用事业证券投资基金,托管了2只QFII基金——日兴中国人民币国债投资基金、日兴中国人民A股投资基金,同时交通银行也是全国社会保障基金受托托管行之一。托管总规模达1000亿元。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1. 直销机构:
(1) 华安基金管理有限公司上海投资理财中心
地址:上海市浦东新区浦东南路360号新上海国际大厦2楼
电话:(021)68863400
传真:(021)68863223
联系人:程安宝
- (2) 华安基金管理有限公司北京投资理财中心
地址:北京市西城区金融街23号安大厦106室
电话:(010)66219989
传真:(010)66214060
联系人:刘彦殊
- (3) 华安基金管理有限公司电子交易平台
咨询电话:(021)68804888
交易网址:www.huan.com.cn

联系人:赵敏

2. 代销机构:
(1) 交通银行股份有限公司
注册地址:上海市仙霞路18号
办公地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842

联系人:曹杨

客户服务电话:965659
(2) 中国工商银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
电话:(010)68107911
传真:(021)66107914
联系人:田群
客户服务中心电话:96588

(3) 中国银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
电话:(010)68094009
传真:(010)68094853
联系人:王莉
客户服务统一咨询电话:96566

(4) 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:李功
电话:(021)62580818-177
传真:(021)62583439
联系人:顾文敏
客户服务电话:4008888966
客户网站:www.gtja.com

(5) 中国建设银行
注册地址:北京市西城区内大街6号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:蒋荫棠
电话:400-8888-108(免长途费);(010)65186758
传真:(010)65182261
联系人:王巍
客户网站:www.csc108.com

(6) 渤海银行股份有限公司
注册地址:天津市经济技术开发区第一大街29号
办公地址:天津市滨海新区滨海道3号
法定代表人:张军
电话:(022)29481883
传真:(022)29481616
联系人:徐敏
客户网站:www.cb.com.cn

(7) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
法定代表人:王开国
电话:(021)53894566-4125
传真:(021)53896549
联系人:金芸
客服电话:(021)962505、(021)54033888
客户网站:www.htsec.com

(8) 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:储晓明
电话:(021)68810261
传真:(021)68819867
联系人:蒋卫
客户网站:www.sywg.com.cn

(9) 兴业证券股份有限公司
注册地址:福州市湖东路99号标力大厦
法定代表人:兰荣
电话:(021)68419125
传真:(021)68419867
联系人:傅自
客户网站:www.xyzq.com.cn

(10) 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39—45层
法定代表人:李玮
电话:(0755)82305111
传真:(0755)82343227
联系人:黄健
客户服务电话:4008888111、(0755)28951111
客户网站:www.newone.com.cn

(11) 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:李伟
电话:(010)66568888
联系人:郭京京
客户网站:www.chinastock.com.cn
客户服务电话:(010)68016855

(12) 广发证券股份有限公司
注册地址:广州市天河区北路183号大都会广场36楼
法定代表人:王志伟
电话:(020)87558888
客户服务电话:(020)87558888

(13) 国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦21层
法定代表人:何如
电话:(0755)182130833
传真:(0755)182133302
联系人:林建刚
客户网站:www.guosen.com.cn
客户服务电话:95508

(14) 长城证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦16、17层
办公地址:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层
法定代表人:魏庆华
联系电话:(0755)83516094
传真号码:(0755)83516199
联系人:高峰
客户网站:www.cc168.com.cn
客户服务电话:(0755)82288968

(15) 湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层
办公地址:长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层
法定代表人:陈学军
客服电话:(021)68865020
联系电话:(021)68863418
传真号码:(021)68865938
联系人:杜娟
网站:www.xcsc.com

(16) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道1600号光大证券大厦15-17楼
法定代表人:王炳权
客服电话:(021)68823685
联系电话:(021)68818000-1876
传真号码:(021)68815009
联系人:李伟敏
客户网站:www.ebscn.com
网站:www.ebscn.com

(17) 财富证券有限责任公司
注册地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层
办公地址:湖南省长沙市芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-27层
法定代表人:蔡明
联系电话:(0731)4403343
传真号码:(0731)4403439
联系人:张治平
网站:www.cfzq.com

(18) 世纪证券有限责任公司
注册地址:广东省深圳市深南大道7088号招商银行大厦41楼
法定代表人:李强
联系电话:(0755)83199699-8212
传真号码:(0755)83199645
网站:www.csco.com.cn

(19) 国海证券股份有限公司
注册地址:广西南宁市滨湖路46号
法定代表人:张雅慧
联系电话:(0771)6832022
传真号码:(0771)6832033
联系人:覃万军
网站:www.gzhq.com.cn

(二)基金注册与过户登记人
名称:华安基金管理有限公司
注册地址:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
办公地址:上海浦东新区浦东南路360号,新上海国际大厦38楼
法定代表人:杜建国
电话:(021)68881111
传真:(021)68862332
联系人:朱永红
客户服务电话:(021)68804666

(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
注册地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔21楼
负责人:韩炯
电话:(021)68918100
传真:(021)68918180
经办律师:韩炯、秦悦民

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区东昌路500号(200120)
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中11楼(200021)
法定代表人:杨绍明
电话:(021)63636388
传真:(021)63636300

联系人:陈尚伟
经办注册会计师:汪峰、薛巍

六、基金名称

本基金名称:华安创新证券投资基金

七、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

八、基金的投资目标

本基金管理人将以分散投资风险,提高基金资产的安全性,并积极主动追求收益的稳定增长为目标,以诚信用及专业经营方式,将本基金投资于具有良好流动性的金融工具,主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。

本基金的投资原则:
1. 本基金遵循谨慎稳健原则,高度重视基金资产的安全性,力求更好地降低投资风险。

2. 本基金主要投资于在中国境内上市的公司创新类上市公司的股票和债券,以获取资本利得为主要投资目标。

3. 本基金将根据市场变化,灵活选择一定比例的短期投资,在防范风险的前提下,力求增加基金的收益。

4. 在严格遵守《基金法》、《试点办法》、《基金合同》等有关规定的前提下,基金管理人可根据具体情况,不断调整投资组合,提高投资组合中的股票,但基金的股票资产中至少有80%属于华安创新证券投资基金名称所显示的投资内容。

九、基金的投资方向

本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益,通过建立科学合理的投资组合,为投资者降低和分散投资风险,提高基金资产的安全性。

这组创新是指科技创新、管理创新和技术创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业化创新公司和传统产业创新公司。

高新技术产业和创新公司主要集中在信息技术、生物医药新材料等高新技术产业等领域,包括电子信息及网络技术、生物技术和医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域从事研发的上市公司。

传统行业是指传统产业中,如果已或正在管理现代化、营销体系、技术开发和生物产业体系等方面进行创新,具有较大潜在发展前景和经济收益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。

本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素:公司创新能力强,主营业务市场空间大,财务状况良好,具有相对竞争优势等。

本基金的投资将严格遵守法律法规和基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产,以规避和现金,从而保持基金资产良好的流动性。

十、基金的投资限制

(一)决策依据

1. 国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定;
2. 国家宏观经济政策、利率走势及通货膨胀预期;
3. 国家产业政策;
4. 各地区、各行业产业发展状况;
5. 上市公司研究;
6. 证券市场走势。

(二)投资组合

1. 投资决策委员会会议形成由参加会议成员签字的书面决议,确定本基金总体资产配置和投资策略,投资决策委员会定期召开会议,由公司总经理或指定人员召集,如需做出及时重大决策或基金经理调整,可临时召开投资决策委员会会议。

2. 基金经理制订和调整投资组合,设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括:每日基金申购赎回净现金流量;基金的投资限制和比例限制;研究员的投资建议;基金经理的独立判断;风险分析小组的建议等。

3. 基金申购向中文交易下达投资指令。交易员收到基金经理指令后,按时间优先、价格优先、综合平衡、比例分配原则完成指令。

4. 风险控制小组对开放式基金投资组合进行评估,向基金经理提出调整建议。

5. 基金经理根据对投资组合进行稽查并出具稽查报告。

基金管理人应依据有关法令及《基金合同》规定,运用管理本基金:

1. 本基金投资组合应符合下列规定:
 - ① 本基金投资于股票、债券的比例,不低于本基金资产总值的80%;
 - ② 本基金持有1家上市公司的股票,不超过本基金资产净值的10%;
 - ③ 本基金与由基金管理人管理的其它基金持有1家发行股份的证券的总和,不超过该证券的10%;
 - ④ 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%;
 - ⑤ 本基金股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容;
 - ⑥ 中国证监会允许的其他投资限制;
2. 禁止本基金从事下列行为:
 - ① 投资于其他证券发行基金;
 - ② 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券;
 - ③ 动用银行信贷资金从事基金投资;
 - ④ 将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款;
 - ⑤ 从事证券信用交易;
 - ⑥ 投资于产证券以外的房地产;
 - ⑦ 从事可能使基金资产承担无限责任的投资;
 - ⑧ 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有关利益的公司发行的证券;
 - ⑨ 当时有效的法律、法规、规章、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

十一、基金业绩比较基准

本基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信国债指数收益率

当上述比较基准中参照的指数不再有效或取消后,或基金管理人认为该等参照的指数或权重无法合理衡量本基金整体业绩时,基金管理人有权对上述基金整体业绩比较基准进行调整并公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金为风险收益特征无

十三、基金的投资报告(未经审计)

(一)重要提示

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。

本报告于2006年4月14日复核了本报告中的财务信息、净值表现和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2006年3月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

(二)基金投资组合报告

(1) 基金资产组合

序号	资产组合	金额(元)	占资产比例
1	股票	1,897,306,314.67	69.8%
2	债券	572,811,065.8	19.9%
3	现金	0.00	0.00%
4	衍生投资和套期保值合计	122,232,912.62	4.3%
5	其他资产	321,831,073.16	11.5%
合计		2,924,169,685.10	100.0%

(2) 报告期末投资组合

① 按行业分类的股票投资组合

序号	行业	公允价值	占资产净值比例
B	采掘业	345,200,393.46	12.62%
C	制造业	913,109,744.39	33.36%
D	食品饮料	339,599,825.64	12.42%
O1	纺织服装、皮革	6,173,360.62	0.22%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	262,707,420.12	9.60%
O5	电子	22,760,000.00	0.83%
O6	金属、非金属	31,788,221.20	1.16%
C7	机械、设备、仪表	39,414,883.32	1.44%
O8	医药、生物制品	210,176,136.09	7.89%
C	信息技术	12,480,000.00	0.46%
H	批发和零售业	22,850,000.00	0.83%
I	金融业	193,108,394.56	7.05%
J	房地产业	322,200,760.20	11.77%
K	社会服务业	49,487,442.57	1.76%
M	综合类	47,867,442.57	1.76%
合计		1,897,306,314.67	69.82%

② 基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	股票数量(股)	市值(元)	占资产净值比例
1	600519	贵州茅台	3,000,000	188,010,000.00	6.83%
2	000983	G 鲁 恒 瑞	25,277,577	182,759,607.1	6.68%
3	000638	云南白药	6,000,000	178,165,000.00	6.51%
4	000032	G 开 尔	27,000,844	176,850,562.0	6.46%
5	600309	烟台万华	10,000,000	175,100,000.00	6.40%
6	000402	金 星 刚	17,990,000	145,280,000.00	5.31%
7	600036	G 碧 川	21,683,722	139,437,718.26	5.09%
8	600028	中国石化	20,303,356	102,531,942.75	3.75%
9	000699	G 紫 葛	2,752,000	89,468,480.00	2.94%
10	600683	G 申 工	2,000,000	60,000,000.00	2.19%