

银河银泰理财分红证券投资基金

招募说明书(更新摘要)

重要提示

银河银泰理财分红证券投资基金(以下简称“本基金”)的基金合同于2004年3月30日正式生效。

投资有风险,投资人申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。
本摘要根据本基金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《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份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2006年3月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2006年3月31日。

第一节 基金管理人

一、基金管理人概况

- 1.名称:银河基金管理有限公司
- 2.住所:上海市虹口区东大名路908号
- 3.设立日期:2002年6月14日
- 4.法定代表人:刘澎涛
- 5.办公地址:上海市虹口区东大名路908号金岸大厦三楼
- 6.电话:021-65956688
- 7.联系人:肖年
- 8.注册资本:1亿元人民币
- 9.股权结构:

持股单位	出资额(万元)	占总股本比例
中国银河证券有限责任公司	5,000	50%
中国石油天然气集团公司	1,250	12.5%
上海市城市建设投资开发总公司	1,250	12.5%
北京首都机场集团公司	1,250	12.5%
湖南广播电视产业中心	1,250	12.5%
合计	10,000	100%

二、主要人员情况

1.基金管理人董事、监事、经理及其他高级管理人员
董事长刘澎涛先生,中共党员,大学本科毕业。历任中国人民银行总行副司长,珠海市人民政府副市长,中国证券监督管理委员会办公室主要负责人等职。2000年至今任中国银河证券有限责任公司副总裁。
董事李庆彪先生,中共党员,经济学硕士,高级会计师。历任中国石化炼油炼化总厂财务处处长、体改办主任,中国石化天然气集团公司炼油石化公司副总经理兼总会计师等职。现任中国石化天然气集团公司资本运营部主任。
董事李培英先生,中共党员,大专学历。历任民航北京管理局处长,首都国际机场副总经理兼党委书记等职。现任首都机场集团公司总裁,北京首都国际机场股份有限公司董事长兼党委书记。
董事高国富先生,中共党员,管理工程博士。历任上海团市委副书记、上海外高桥保税区开发(控股)公司总经理,上海万国证券公司副总裁,上海久事公司副总经理、总经理等职。现任上海市城市建设投资开发总公司总经理、党委书记。

董事朱洪先生,中共党员,大学本科学历。历任中国工商银行安徽省巢湖市分行行长,中国工商银行安徽省信托投资公司总经理,中国华融信托投资公司上海证券部总经理,中国银河证券有限责任公司上海总部总经理等职。现任亚洲证券有限责任公司总裁。

董事、总经理王庆中先生,中共党员,大学本科学历,经济师。先后担任中国工商银行总行分行工信信贷科主办科员、副科长,广东工商银行信托投资公司中山分公司副总经理、总经理,中国华融信托投资公司中山营业部总经理,中国华融信托投资公司广东证券部总经理,中国银河证券有限责任公司中山营业部总经理,中国银河证券有限责任公司资产管理部副总经理。
独立董事孙树义先生,中共党员,大学本科学历。历任电子工业部副处长、国家体改委副司长、司长,中央财经领导小组办公室副主任,国家人事部副部长、党组成员,中央企业工委副书记等职。

独立董事傅丰祥先生,高级工程师、教授。历任机械工业部副部长,国家体改委司长、委员,中国证监会副主席等职。1991年至今兼任中国证券研究设计中心总干事,中国证券培训中心心理师、亚洲证券研究院院长、华东师大客座教授、北京大学光华管理学院教授。
独立董事王福山先生,大学本科学历,高级工程师。历任北京大学教师,国家地震局副司长,中国人民保险公司部门总经理,中国人寿保险公司投资司副董事长,深圳阳光基金管理公司董事长等职。现任中国人保信托投资公司视员。

独立董事谢朝华先生,法学博士。曾先后在中国国际贸易促进会委员、中国国际经济贸易仲裁委员会、中国北方工业集团总公司、欧盟对外关系委员会、欧盟对外发展委员会、法国及比利时律师事务所专职从事法律工作。1994年至今任北京朝华律师事务所律师。
独立董事秦奕生先生,经济学博士,教授,注册会计师。长期从事审计及证券市场研究工作。现任国家会计学院副院长,兼任中国注册会计师独立审计准则中方专家组成员、财政部财经教材编审委员会委员、中国注册会计师专门化教材编审委员会委员、中国审计学会常务理事等职。

董事会秘书周长青先生,中共党员,经济学硕士。历任中国人民银行总行主任科员,中信实业银行支行负责人,中国民族信托投资公司理财部副经理,银河基金管理有限公司督察员等职。

监事长刘昱先生,先后任职于湖南省木材公司、湖南省广播电视厅、湖南省广电总公司及湖南省汇林投资有限公司。2000年4月至今,担任深圳市达晨创业投资有限公司董事长。

监事王长慧先生,1969年生,本科学历,经济师。先后担任中国农业银行信托投资公司证券营业部部门负责人、副总经理,中国长城信托投资公司证券营业部副总经理,清程中心副总经理。2000年至今任中国银河证券有限责任公司清算中心副经理。

监事黄若文先生,1966年生,民主建国会会员,管理学硕士,中国注册会计师。先后任职于中国通广电子公司、海南新大洲摩托车股份有限公司、中国华融信托投资公司、中国银河证券有限责任公司,现为本公司员工。

公司副总经理熊科金先生,中共党员,经济学硕士。历任中国银河江西信托投资公司证券营业部负责人、中国东方信托投资公司南昌证券营业部总经理、公司证券业务总部负责人,华夏证券有限公司江西管理总部总经理等职。2000年至本公司成立前,任中国银河证券有限责任公司基金部副总经理、银河基金管理有限公司筹备组负责人。

督察员屈德萍女士,中共党员,本科学历,高级经济师。历任中国信达信托投资公司信贷部副总经理,计划财务部副总经理,中国银河证券有限责任公司北京双榆树营业部副总经理、总经理。

二、基金管理人/组成员

李昇先生,基金经理,硕士研究生学历,13年证券从业经历。自1993年起进入君安证券公司工作,先后担任研究所研究员、公司二级市场风险控制员和证券投资部一级投资经理。2002年2月加入银河基金管理有限公司,历任银丰基金经理。基金管理部副总监兼银丰基金经理。现任基金管理部副总监兼银泰基金经理。

王彤京先生,基金经理,大学本科学历,13年证券从业经历。1993年在建总行深圳业务部任副经理。1994年至1999年在君安证券公司证券投资部和资产管理部任投资经理。2000年至2002年在深圳市怡德高科技技术有限公司任投资总监。2004年加入银河基金管理有限公司,任基金助理助理,2005年任银泰基金基金经理。

王孝德先生,博士研究生学历,8年证券从业经历。自1998年进入君安证券有限公司研究所工作,先后担任宏观部和行业公司产品部研究员,2003年6月进入德邦证券有限责任公司,任证券投资部负责人。2005年2月加入银河基金管理有限公司,现任银泰基金基金经理助理。

3.投资决策委员会成员
副总经理熊科金先生,基金管理部负责人李昇先生,研究部负责人王忠波先生,金融工程部总监夏林先生,基金经理李立生先生,基金经理毛卫文女士,基金经理王彤京先生。

第二节 基金托管人

一、基本情况

名称:中国工商银行
注册地址:北京市西城区复兴门内大街65号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街65号
法定代表人:姜建清
设立日期:1984年1月1日
注册资本:2,480.00亿元人民币
联系电话:010-66106912
联系人:庄为

中国工商银行资产托管部共有员工65人,平均年龄30岁,90%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

三、基金托管业务情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行自1998年2月成立以来,始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则,严格履行着资产托管人的责任和义务,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系,规范的业务管理模式,健全的托管业务系统,强大的市场营销能力,为广大家庭机构投资者和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异业绩。截至2006年3月,托管证券投资基金56只,其中封闭式16只,开放式40只。托管资产规模年均递增73%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、OFII资产、履约类资产等十大类14项产品的托管业务体系。继2004年先后获得《亚洲货币》和《环球财讯》评选的“中国最佳托管银行”称号后,2005年,又分别获得《财资》和《环球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号。

第三节 相关服务机构

一、直销机构

银河基金管理有限公司
(1)银河基金管理有限公司直销中心
地址:上海浦东大名路908号金岸大厦三楼(邮编:200082)
本公司网站:www.galaxyasset.com
客服热线:900-820-0960,021-35104688
直销业务电话:021-65956688/35104666-6638,6658
传真交易电话:021-65956615
联系人:刘彬彬、曹霞
(2)银河基金管理有限公司北京分公司
地址:北京西单民丰胡同31号中水大厦211室(邮编:100032)
电话:010-88067037-6611
传真:010-88067038
联系人:王潇
(3)银河基金管理有限公司广州分公司
地址:广州解放中路306号中曦大厦四楼(邮编:510030)
电话:(020)83176255

传真:(020)83176112
联系人:陈添、叶健敏
(4)银河基金管理有限公司哈尔滨分公司
地址:哈尔滨市南岗区花园街310号恒运大厦四层(邮编:150001)
电话:(0451)63902200
联系人:孙永林、王松晏
(5)银河基金管理有限公司南京分公司
地址:南京市洪武路396号6楼609-615室(邮编:210002)
电话:025-84412529
传真:025-84523725
联系人:郝晓东、王海燕
2)代销机构:

(1)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:010-66107900
传真:010-66107914
联系人:田耕
(2)交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路18号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58408842
联系人:曹曾

(3)中国银河证券有限责任公司
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:朱利
电话:(010)66588613、(010)66568587
传真:(010)66568536
联系人:解睿、郭京华
(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:祝幼一
电话:(021)62580818-177
传真:(021)62583439
联系人:顾文松

(5)中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
法定代表人:董晓宏
电话:(010)61867578
联系人:权鹏

(6)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:广州天河区河北路大都会广场36,37,41和42楼
法定代表人:王传伟
电话:020-87558898-875
传真:020-87557985
联系人:肖梅

(7)广东证券股份有限公司
注册地址:广州市解放南路123号
法定代表人:傅伟华
电话:020-83270846-72899
传真:020-83270505
联系人:陈新

(8)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:021-53594566
传真:021-53858549
联系人:金芸

(9)广州证券有限责任公司
注册地址:广州市先烈中路69号东山广场五楼
法定代表人:吴 张
电话:020-87320991
传真:020-87326036
联系人:星黎豫 肖洁雯

(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38-45层
法定代表人:肖少彬
电话:(0755)82943212
联系人:黄瑾

客服电话:(0755)26954111
(11)天同证券有限责任公司
法定代表人:倪丹
通讯地址:山东省济南市泉城路180号
邮政编码:250011
联系人:罗海峰
联系电话:0531-5689888,5689777
传真电话:0531-6029668
客服电话:0531-5689888-9690
公司网站:http://www.ttstock.com

(12)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
电话:021-62668800
传真:021-62669651
联系人:盛文

(13)湘财证券有限责任公司
注册地址:长沙市黄兴中路63号中山国际大厦12楼
法定代表人:陈学荣
电话:021-68634518
传真:021-68685938
联系人:陈伟

(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14.16、17层
法定代表人:魏云鹏
电话:0755-83516094
传真:0755-83516199
联系人:高峰

(15)华泰证券有限责任公司
注册地址:江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人:吴万善
电话:(025)94457777-721
传真:(025)184579879
联系人:袁虹阳

(16)金元证券有限责任公司
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层
法定代表人:郑辉
电话:0755-83025622
传真:0755-83025511
联系人:金春
客户服务电话:0755-83025695
网站:http://www.jyzzq.cn

(17)光大证券股份有限公司
地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦北楼2004室
法定代表人:王明晓
电话:021-68768800
联系人:张茜

(18)长江证券有限责任公司
注册地址:湖北省武汉市新华路特8号
法人代表:明成
联系人:毕艇
电话:027-65799660
Fax:027-85481532
客服热线:4008-888-999
公司网站:http://www.cjsc.com.cn

二、注册登记机构:银河基金管理有限公司
注册地址:上海市虹口区东大名路908号
办公地址:上海市东大名路908号金岸大厦三楼
法定代表人:刘澎涛
电话:021-65956688/35104666-6638
传真:(021)65956615
联系人:刘彬彬

三、律师事务所
名称:北京市滨泽君律师事务所
地址:北京东四十条68号平安发展大厦3层
负责人:金明
电话:010-84085858
传真:010-84085338
经办律师:陶修明、钟向春

四、会计师事务所
名称:中瑞华恒信会计师事务所
注册地址:北京市西城区金融大街35号国企大厦A座
法定代表人:尹永利
电话:010-88091188
传真:010-88091207
经办注册会计师:杨力强 孙奇

第四节 基金概况

基金名称:银河银泰理财分红证券投资基金
基金简称:银泰理财分红基金
基金运作方式:契约型开放式

第五节 基金的投资

一、投资目标
追求资产的安全性和流动性,为投资者创造长期稳定的投资回报。

二、投资方向
本基金的投资方向包括国内依法公开发行的具有良好流动性的债券、股票、央行票据、回购等金融工具,以及未来法律法规和中国证监会许可的其他金融工具。其中,债券投资包括国债、金融债、信用评级在投资级以上的企

业债(包含可转换公司债券)等。

三、投资策略

(一)资产配置策略

本基金采用多因素分析框架,从宏观经济因素、政策因素、微观因素、市场因素、资金供求因素等五个方面对市场的投资机会和风险进行综合研判,适度把握市场时机,合理配置股票、债券和现金等各类资产间的投资比例,确定风格资产、行业资产的配置比例布局。

在遵循多因素分析框架的评估程序的同时,本基金将运用优化的固定比例组合保险机制(CPRI),根据基金净值的损益情况,动态设定一个股票组合占基金净值的上限比例,以实现控制股票投资风险暴露的目的。

根据本基金的风险比例组合保险机制,本基金的股票投资上限比例的确定公式为:
放大倍数×(当年最大投资损失控制目标+当年债券和现金组合的预期收益率)

其中,放大倍数根据对中国证券市场的实证分析结果来确定。在基金成立之初,本基金设定初始的当年最大投资损失控制目标为3%。基金在正常情况下,投资损失控制目标设置规则如下:
如果上年度基金累计净值收益率<0时:
当年最大投资损失控制目标=上年度基金累计净值收益率+3%

如果上年度基金累计净值收益率≤0时:
当年最大投资损失控制目标=3%

以上股票投资上限比例将定期计算,每月由数量分析小组提交跟踪分析报告。在每季度末,投资决策委员会将根据市场和基金年内累计净值收益情况,做出是否修正股票投资上限比例的决定。如果基金在该季度内的累计净值出现明显增长,则股票投资的上限比例可以适当提高;如果基金在该季度内的累计净值出现明显下降,则股票投资的上限比例将适当降低。

(二)股票投资策略

本基金将在投资风险控制的指导下,获取股票市场投资的较高收益。本基金采用定性分析与定量分析相结合的方法进行股票选择,主要投资于经评估或预期认为具有可持续发展能力的价值型股票和成长型股票,同时兼顾较高的流动性要求。

本基金对企业可持续发展能力的评估采用定性分析和定量评估相结合的方法。定性分析主要考虑企业的基本素质、行业地位、发展战略、盈利模式、竞争优势、财务状况、增长潜力等因素。定量评估主要参考净资产收益率、经营性净现金流量、主营收入增长率、净利润增长率等指标。

在经过上述定性分析和定量评估筛选后,对入选股票的价值被低估的程度、未来增长潜力、风险以及市场流动性等多方面因素综合评估,精选个股,构建股票投资组合。

(三)债券投资策略

根据对宏观经济运行状况、金融市场环境及利率走势的综合判断,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,通过类属配置、久期调整、收益率曲线策略等构建债券投资组合,为投资者获得长期稳定的回报。

(四)投资决策

1.决策机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会为基金投资的最高决策机构,主要职责是确定资产配置政策,审批重大投资决策等。

基金经理的主要职责是根据投资决策委员会的授权,在其权限范围负责所管理基金的日常投资组合管理工作,并具体落实投资决策委员会关于该基金的投资管理的决议。

2.决策依据

本基金管理人将主要依据下述因素决定基金资产配置和具体证券的买卖:
(1) 国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定;
(2) 国内外宏观经济发展和态势、微观经济运行环境和证券市场发展趋势;

(3) 处理好宏观投资对象收益和风险的匹配关系,在充分权衡投资对象的收益与风险的前提下作出投资决策。

3.交易机制

本基金管理人实行集中交易制度。
(五)投资程序
1.投资分析和研究
本基金管理人内设研究部,从宏观经济形势、行业发展趋势、证券市场热点及上市公司基本情况等多个角度综合分析,运用定性和定量方法进行研究,制定投资策略建议和投资建议。

研究部负责符合限制规定的拟投资对象进行详细的分析研究,经过评级、估值、特征分析和风险评判等,通过严格的筛选程序,汇总编制基础股票库。在此基础上,针对本基金的特点,考虑市场价格与合理价格的偏离程度,拟投资对象的收益与风险特征、市场流动性等因素,在基金合同允许的范围内选择适当的投资对象建立本基金的首选股票库,并根据市场变化情况,适时做出调整。

2.制定资产配置策略与比例

投资决策委员会根据宏观研究、行业研究和市场研究等结果,考虑市场运行的周期因素,对投资策略和投资建议进行仔细讨论并确定本基金资产配置策略,规定本基金在股票、债券、现金等金融工具的配置比例(或范围)以及行业投资的比例(或范围),授权基金经理负责具体实施。

3.构建投资组合
基金经理小组在授权的范围内,根据投资决策委员会确定的资产配置比例或范围等,从备选股票库、债券品种中选择投资对象构建投资组合,并负责进行投资组合的日常管理。

4.交易

基金经理制定具体的操作计划并以投资指令的形式下达至中央交易室。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作,并将指令的执行情况反馈给基金经理。

5.风险管理与组合的调整
投资指令执行完毕时,基金经理负责向投资决策委员会提出总结报告;监察部对基金投资进行日常监督;数量分析小组定期对基金投资业绩进行评估和风险分析,并通过监察部呈报给公司合规风险控制委员会及督察员办公室。投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和数量分析小组提供的风险分析和评估报告的基础上,基金经理定期回顾基金投资组合的收益与风险来源,根据市场变化和投资阶段成果定期反思有关各项因素,并关注股票评级和备选股票库等的变化,对基金投资组合不断进行调整和优化。

基金经理将根据实际情况对前述投资过程不断进行周期检讨及优化调整,在维护基金财产安全的前提下,获取长期的资本增值和适度的当期收益。

四、业绩比较标准

上证A股指数×40%+中信全债指数×55%+金融同业存款利率×5%。
关于股票指数的权重比例约40%,主要考虑到本基金股票投资的运作范围在0-80%之间,从基金的长期运作来看,基金股票投资的比例将以40%的比例为中枢进行波动。本基金指数投资部分的业绩比较基准为跟踪全市场价格指数(中信全债指数)。本基金指数投资的运作范围在20-95%之间,取债券指数的权重为55%。本基金在正常运作时,为应付赎回一般留存5%左右的现金,因此业绩比较基准中现金部分的权重为5%。

上述业绩比较基准自本基金成立后每半年审核一次。如将来有更合适的综合反映交易所股票市场 and 银行间债券市场的债券综合指数以及反映沪、深交易所市场的全国股债统一指数,基金经理将考虑予以更换。

五、风险收益特征

本基金属于风险较低的投资品种,风险-收益水平介于债券基金与股票基金之间

六、基金投资咨询报告(截止2006年3月31日)

本基金托管人中国工商银行根据本基金合同规定,于2006年4月25日复核了本报告中的财务指标、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止2006年3月31日,本报告所列数据未经审计。

(一)基金资产组合情况

项目名称	金额(元)	占基金资产总值比例(%)
股票	1,630,285,065.92	60.85
权证	1,323,718.66	0.05
债券	740,877,853.68	27.65
银行存款及清算备付金	152,065,040.07	5.68
其他资产	154,758,284.55	5.78
资产总值	2,679,299,962.88	100.00

(二)按行业分类的股票投资组合

序号	行业	市值(元)	占净值比例(%)
1	A 农林牧渔业	2,272,000.00	0.10
2	B 采矿业	128,515,316.77	5.41
3	C 制造业	599,893,501.31	25.26
(1)C0 食品、饮料	61,536,476.68	2.59	
(2)C1 纺织服装、皮革	2,698,585.12	0.11	
(3)C2 造纸、印刷	12,239,649.24	0.52	
(4)C4 石油、化学、塑胶、塑料	141,601,307.27	5.96	
(5)C5 电子	37,708,662.29	1.59	
(6)C6 金属、非金属	139,334,363.90	5.87	
(7)C7 机械、设备、仪表	182,809,294.72	7.70	
(8)C8 医药、生物制品	21,945,158.19	0.92	
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	95,758,600.57	4.03
5	E 建筑业	16,250,980.36	0.68
6	F 交通运输、仓储业	229,909,110.10	9.68
7	G 信息技术业	202,418,323.38	8.52
8	H 批发和零售贸易	41,463,665.85	1.75
9	I 金融、保险业	202,042,136.45	8.51
10	J 房地产业	83,429,930.30	3.51
11	M 综合类	28,361,493.86	1.19
(三)基金资产组合	合计:	1,630,285,065.92	68.64

序号	股票代码	股票名称	股数	市值(元)	市值占净值比(%)
1	600036	G 招行	27,004,264	173,673,417.52	7.31
2	600009	G 平安	14,632,304	166,222,973.84	7.00
3	600271	航天信息	3,812,076	79,399,132.80	3.34
4	600688	上海石化	9,632,268	57,026,020.80	2.40
5	600050	中国联通	20,831,795	56,245,849.50	2.37
6	600348	G 鲁信	4,377,520	53,449,512.00	2.25
7	000063	G 中兴	1,721,102	52,717,354.26	2.22
8	600887	伊利股份	2,905,464	51,862,532.40	2.18
9	600649	际华股份	8,539,346	51,166,108.70	2.15
10	600028	中国石化	9,725,983	49,116,214.75	2.07
		总计	103,447,122	790,843,151.37	33.30

(四)按券种分类的债券投资组合

名称	证券市值(元)	占基金净值比例(%)
国债	202,638,713.30	8.53
金融债	299,850,000.00	12.62
可转债	238,389,140.38	10.04
合计	740,877,853.68	31.19

(五)基金投资前五名债券明细

序号	债券名称	市值(元)	市值占净值比例(%)
1	05农发04	149,925,000.00	6.31
2	05农发08	99,950,000.00	4.21
3	21国债05	71,375,519.00	3.01
4	02国债00	55,827,292.80	2.35
5	国债转债	51,652,665.00	2.17
	合计	428,730,476.80	18.05

(六)报告附注

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,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。
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被选股票库之外的股票。
3.其他资产构成。

名称	金额(元)
交易所保证金	1,848,780.49
应收证券清算款	140,401,828.78
应收利息	12,298,610.04
应收股利	199,065.24
应收申购款	10,000.00
总计	154,758,284.55

4.可转换债券的代码