

招商安本增利债券型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

(二 零 零 八 年 第 一 号)

招商安本增利债券型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证监会核准,由招商安本增利债券型证券投资基金募集的批复(证监基金字〔2006〕199号)核准公开募集。本基金的基金合同于2006年7月11日正式生效。本基金为契约型开放式。

重要提示
招商基金管理有限公司(以下称“本基金管理人”或“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和保证,也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。当投资者赎回时,所得或会高于或低于投资人先前所支付的金额。如本招募说明书存在任何疑问,应寻求独立及专业的财务意见。
投资有风险,过往业绩并不预示其未来表现。投资人认购(或申购)其它基金份额的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资人在认购(或申购)本基金时应仔细阅读本招募说明书。

本更新招募说明书所载内容截止日为2008年1月22日,有关财务和业绩表现数据截止日为2007年12月31日,财务和业绩表现数据未经审计。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:招商基金管理有限公司
设立日期:2002年12月27日
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
办公地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
法定代表人:牛冠兴
电话:(0755)83196412
传真:(0755)83196405
联系人:陈炼宏
注册资本:人民币2.1亿元
股权结构和公司沿革
招商基金管理有限公司于2002年12月27日经中国证监会证监基金字[2002]110号文批准设立,是国内第一家中外合资基金管理公司。公司由招商证券股份有限公司、ING Asset Management B.V.(荷兰投资)、中电财务有限公司、中华能源财务有限责任公司、中电财务有限责任公司共同投资组建。经中国证监会通过及中国证监会批准,公司的注册资本已经由人民币一亿元(RMB 100,000,000元)增加为人民币二亿一千万(RMB 21,000,000元)。2007年5月22日,经公司董事会通过并经中国证监会审批同意,招商银行股份有限公司受让中国电力财务有限公司、中华能源财务有限责任公司、中电财务有限责任公司及招商证券股份有限公司分别持有的公司10%、10%、10%及34%的股权,中国外投资股东荷兰投资(ING Asset Management B.V.)受让招商证券股份有限公司持有的公司3.3%的股权。目前招商基金管理有限公司的股权股权结构为:招商银行股份有限公司持有公司全部股权的33.4%,招商证券股份有限公司持有公司全部股权的33.3%,ING Asset Management B.V.(荷兰投资)持有公司全部股权的33.3%。

公司主要中外方股东招商银行是我国第一家完全由企业法人持股的股份制商业银行,总行设在深圳。自成立以来,招商银行先后进行了三次增资扩股,并于2002年4月9日在上交所挂牌(股票代码:600036)。目前,招商银行总资产资产达万亿元,注册资本近600亿元。招商证券股份有限公司是中国证监会批准的首批综合性证券公司之一,核心资本24亿元,在全国拥有32个营业部,各项经营指标均位居国内券商前十名。
公司外方股东荷兰投资是ING集团的专门从事资产管理业务的全资子公司。ING集团是全球最多元化的金融集团之一,在2006年《财富》杂志500强榜单第13位,在全球超过65个国家和地区拥有分支机构,员工11万多人。

公司本着“诚信、融合、创新、卓越”的经营理念,力争成为客户信赖、股东满意、员工热爱,并具有国际竞争力的专业化的资产管理公司。

(二)主要人员情况

1.基金管理人董事、监事及高级管理人员介绍:
马蔚华,男,1948年出生,西南财经大学经济学博士,美国南加州大学荣誉博士,高级经济师。1982年至1985年,在辽宁省计委工作,历任副处长、副秘书长;1985年至1986年,在辽宁省委办工作;1986年至1988年,在中共安徽省委办公厅工作;1988年至1990年,任中国人民银行办公厅副主任;1990年至1992年,任中国人民银行计划资金司副司长;1992年至1998年,任中国人民银行海南省分行行长兼国家外汇管理局海南分局局长;1998年3月至任招商银行行长,现任本公司董事长。
黎爱仁(Christopher John Ryan),男,1959年出生,澳大利亚籍,澳大利亚人,MONASH大学法学学士。1976年至1983年工作于澳大利亚联邦银行,1983年至1990年任澳大利亚国家共同基金管理公司担任销售和运营部经理;1990年至1991年任 John A Nolan and Associates 有限公司担任投资项目;1991年至1998年担任汇丰投资管理香港管理局(香港)执行董事;1998年至1999年担任德意志资产管理(香港)有限公司担任渠道销售及副董事;2000年至2001年担任重组基金管理有限公司任基金渠道销售总监;2001年至今在ING投资管理(亚太)有限公司担任北亚区董事。现任本公司副董事长。

邓晓洁,女,1967年出生,高级分析师。美国纽约州州立大学经济学博士。历任AT&T中国市场学决策部市场分析师,Providian Financial 金融公司高级风险分析师,花旗银行风险管理部高级分析师。2001年11月加入招商证券,历任风险管理部副总经理、总经理,其间于2004年1月至9月被中国证监会借调至南方证券行政接管组工作。现任招商证券副总,分管风险管理部及协助总协调管理财务部。现任本公司董事。

成保庆,男,1961年出生,中国国籍,经济学硕士,高级经济师,曾在北京经济学院任教;曾就职于中国人民银行金融研究所;1993年起先后担任中国证券交易系统有限公司上市管理副经理、经理,中国证监业协会发行部副处长、处长。曾查副局长;2001年9月起开始担任招商基金管理有限公司筹备组组长。自2001年担任担任本公司总经理、董事。
李蔚飞,男,1940年出生,香港根大学理学士(工程数学),香港太平绅士。1978年至1998年先后任香港立法局议员、香港特别行政区政府、首席立法局议员、香港特别行政区临时立法会议员、香港特别行政区推选委员会委员、筹备委员会委员、港事顾问,自由党主席,现任第九届全国人民代表大会香港特别行政区代表、香港特别行政区政策发展委员会委员。李先生担任本公司独立董事。

陈春花,女,1964年出生,华南理工大学工商管理学院教授、博导,南京大学博士后。曾任华南理工大学工商管理学院院长,现任北京大学客座研究员、新加坡国立大学客座教授、澳洲国立大学工商管理硕士课程客座教授、广东省企业家协会常务理事、广东省企业文化协会常务理事和广东省精神文明协会理事。陈春花教授先后出任山东大学和集团副总,康佳集团、科龙集团、TCL集团、美的家电、南方航空、广东电信等公司管理顾问。讲授课程主要有《组织行为学》、《企业文化与跨文化管理》等。现任本公司独立董事。

周丽荔,女,1968年出生,美国籍。美国加州州立大学索诺玛分校 MBA。曾先后就职于丸红株式会社(美国)公司产品部、AmanahUSA资产管理部、美国 ASU 太平洋地区业务发展部副主任、美国 Link Global 公司高级分析师以及咨询委员会委员。2001年初至2006年,就职于香港招商局中国投资管理有限公司,出任董事总经理一职,管理上市直接投资基金-招商中国直接投资基金(HK0133)。其间曾先后出任招商证券投资委员会主席、田田证券监事会主席、巨田基金管理有限公司董事等职务。2006年至今,任职于中集集团,出任东南亚战略发展项目负责人。现任本公司独立董事。

王晓东,女,1968年出生,上海财经大学经济学硕士。大学毕业后于1990年北京对外友协交流处工作,曾多次被派异地企业从事有色金属贸易、房地产投资以及证券投资业务。1998年至2007年间曾任南方证券深圳管理总部深圳中路营业部总经理,深圳特区证券(现申证证券)资产管理部副经理,巨田基金管理有限公司副总经理,以及华林证券副总裁、总裁。2007年加入招商证券,现任公司监事会主席。

陈曙光,男,1966年出生,硕士研究生学历,高级经济师,自2006年6月起担任招商银行总行计划财务部总经理。1994年加入招商银行,1994年10月-2003年6月历任招商银行北京分行行长兼支行行政助理、副行长;北京分行计划资金部副总经理、会计部副总经理。2003年7月至2006年6月任招商银行长沙分行行长。现任公司监事。

白敏德(Eddy Belmans),男,1980年出生,比利时籍。拥有超过20年金融证券从业经验,曾负责 BBL 在比利时的基金管理团队,之后与1996年新加坡证券 BIBI,的合资资产管理公司。ING 接管 BIBI 后,出任 ING 投资管理区域总经理(东盟和印度)。自2003年3月,随后,在台湾出任 ING 彰银证券投资总经理,负责在岸资产管理和基金销售,期间负责离岸基金的批发业务。自2006年1月起任 ING 投资管理(亚太)北亚总经理。现任公司监事。

张冰,男,1966年出生,中国国籍,管理学硕士。1993年起在珠海恒通通业股份有限公司证券投资处工作;1994年加入招商证券股份有限公司,先后担任发展中心高级研究员,资产管理部经理;2002年加入本公司,任基金经理至今。现任本公司监事。

吴武洋,男,1975年出生,华中科技大学管理学硕士,对外经济贸易大学经济学博士。从2000年6月开始在特华投资有限公司,从事行业研究;2001年2月加盟友达基金管理公司,负责数量分析、基金研究、系统开发等方面的工作。先后任研究员、业务主管。2003年9月加入招商基金,一直从事数量研究和模型开发等工作。现任招商基金风险管理部总监及公司监事。

战龙,男,1968年出生,澳大利亚籍,硕士。1991年12月至1994年6月在澳大利亚新南威尔士大学澳大利亚管理学院金融研究中心任助理研究员;1994年7月至1995年11月在信孚基金管理公司(澳大利亚)有限公司担任投资风险管理师;1999年11年获得澳大利亚新南威尔士大学澳大利亚管理学院工商管理硕士学位;2000年11月至2001年10月在美国信安资产管理(亚洲)有限公司亚洲区风险管理部总监;2001年11月至2002年12月任荷兰国际集团投资管理(亚太)有限公司中国区总经理。2003年1月至至今任本公司常务副总经理。

俞鼎基(Guy Uiding),男,1968年出生,荷兰国籍,Vrije University Amsterdam 硕士。1995年3月加入 ING 投资管理公司,历任数量分析师、股票投资基金经理、首席基金经理,曾主管各种投资管理业务。其拥有超过11年丰富的国际金融市场投资管理经验,迄今为止共有十只曾由其管理的基金在全球50多个国家销售情况良好。其管理的 ING 网络基金荣获“Wall Street Journal”(华尔街日报)评选的2000年度最佳国际股票基金;ING 通讯科技基金荣获“Standard and Poor’s Microcap”(标准普尔最佳的2004年度最佳科技基金奖。现任公司投资负责人。

赵志宏,男,1970年出生,中国国籍,博士研究生。1994年起于国信证券有限公司投资银行部任项目经理;1995年加入招商证券股份有限公司,先后担任投资银行二部副经理、内核部经理、内核部兼公司办公室主任。2002年起参与招商基金管理有限公司筹备,公司成立后曾任综合管理三部总监。现任本公司督察长。

2、本基金基金经理介绍

本公司采用团队投资方式,通过整个投资部门全体人员的共同努力来争取良好的投资业绩。基金经理简介如下:
胡军华,女,中国国籍,中国人民大学经济学硕士。1992年起在中国经济开发信托投资公司从事债券、股票的研究工作。1998年加入华鑫证券,任深圳证券营业部副经理。2001年起在南方证券债券业务总部任总经理,负责债券市场研究与经营。2003年3月起加盟招商基金管理有限公司,主要从事固定收益研究工作。胡军华女士具有10多年的证券从业经历,拥有中国证监会颁发的基金从业资格。胡军华女士同时兼任我司招商安泰系列证券投资基金的基金经理,管理时间为2005年8月24日至今。胡军华女士还曾任我司招商现金增值开放式证券投资基金的基金经理,管理时间为2005年5月13日至2006年5月26日。

3、投资决策委员会成员
本基金管理人投资决策委员会由7名成员组成,包括:公司总经理成保良先生、公司常务副总经理战龙先生、公司投资负责人俞鼎基先生、公司督察长赵志宏先生,公司总经理助理兼股票资产部研究总监顾剑发先生、机构投资部总监杨奕先生、风险管理部总监吴武洋先生。

4、上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金的基金托管人为中国光大银行股份有限公司(简称“中国光大银行”),基本情况如下:
名称:中国光大银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
办公地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:唐双宁
成立时间:1992年8月18日
注册资本:82.17亿元人民币
电话:010-68606075
联系人:张建春
2、主要人员情况
法定代表人唐双宁先生,历任中国人民建设银行辽宁省分行办公室副主任(主持工作),中国人民建设银行沈阳市分行常务副行长,中国人民建设银行沈阳市分行副行长,党组副书记,中国人民银行辽宁省分行党组成员兼沈阳市分行行长、党组书记,中国人民银行信贷管理司司长,中国人民银行货币金银局局长,中国人民银行银行监管司司长,中国银行业监督管理委员会党委委员、副主席。现任中国光大集团董事长、党委书记,中国光大银行董事长、党委书记。光大证券股份有限公司董事长,中国光大控股有限公司董事会主席,中国光大国际有限公司董事会主席。

行长郭友先生,历任国家外汇管理局外汇储备业务中心外汇交易部主任,中国投资公司(新加坡)总经理,中国人民银行外资金融机构管理司副司长,中国光大银行副行长,中国光大(集团)总公司执行董事、副总经理兼中国光大控股有限公司行政总裁,现任中国光大(集团)总公司副董事长,中国光大银行股份有限公司副董事长、行长。
陈昌宏先生,北京大学法学学士、硕士。曾任中共中央联络部干部,四川光大资产管理公司副董事,常务副总经理,中国光大银行昆明分行副行长,现任中国光大银行股份有限公司托管部总经理。

3.基金托管业务经营情况
截止2007年12月31日,中国光大银行股份有限公司受托管理国投理银华债券型基金、巨田基础行业基金、国投理银景气行业基金、泰信先行策略基金、光大保德信量化核心基金、大成资源市场基金、巨田资源优选混合型基金(LOF)、招商安本增利债券型基金、国投理银创新动力基金共9只证券投资基金,托管基金资产规模615.38亿元。同时,开展了证券资产组合管理计划、信托公司资金管理计划、ODDI、定向委托资产、企业年金基金等业务开发经营。托管资产总规模超过850亿元。

三、销售服务机构

(一)基金份额发售机构
1.直销机构:
招商基金管理有限公司
招商基金客户服务中心电话:400-987-9555(免长途费)
招商基金管理有限公司基金电子商务平台
交易网站:direct.cmfnchina.com
交易电话:400-887-9555(免长途电话)
电话:(0755)83097697
传真:(0755)83196436
联系人:李尚
机构销售部
北京
地址:北京市西城区金融街国际企业大厦A座614-615
电话:(010)88092709,88092679
传真:(010)88093068
联系人:张睿

上海
地址:上海市浦东新区浦东南路588号浦发大厦22层
电话:(021)68889116
传真:(021)58796616
联系人:陆贻
深圳
地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
电话:(0755)83196439
传真:(0755)83196360
联系人:王圆圆

2.代售机构:中国光大银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门外大街6号光大大厦
法定代表人:王树刚
电话:(010)88098778
传真:(010)68606061
联系人:李伟
3.代售机构:中国农业银行
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
统一客户服务电话:96599
网址:www.abchina.com 或 www.96599.cn
4.代售机构:中国建设银行
注册地址:中国北京市西城区金融大街25号
法定代表人:郭树清
统一客户服务电话:96533
网址:www.ccb.com

5.代售机构:招商银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人:秦晓
电话:(0755)83195834,82090087
传真:(0755)83195649,82090017
联系人:秦晓、刘薇
6.代售机构:交通银行股份有限公司
注册地址:上海市银城中路188号
法定代表人:蒋超良
电话:(021)58781234
传真:(021)58409842
联系人:曹榕
7.代售机构:中信银行
注册地址:北京市东城区朝门内大街富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝门内大街富华大厦E座
法定代表人:陈允光
电话:(010)65641089
传真:(010)65641671
联系人:王立安

8.代售机构:深圳发展银行股份有限公司
注册地址:深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦
法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)
电话:0755-82088888
传真:0755-82080714
联系人:周勤
9.代售机构:上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区东南路500号
法定代表人:金运
电话:(021)61618888
传真:(021)63602431
联系人:倪苏云、汤嘉慧

10.代售机构: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:宫彬
电话:(0755)82943511
传真:(0755)82960141
联系人:黄健
11.代售机构: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:陆劲一
电话:(021)62580818-213
传真:(021)62589400
联系人:芮筱娟

12.代售机构: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:肖冰
联系电话:(010)66586887
13.代售机构:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东南路529号上海证券大厦南塔15-16楼
法定代表人:王树刚
电话:(021)68823885
传真:(021)68815009
联系人:刘晨

14.代售机构: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:谢平
电话:(021)54033888
传真:(021)54038944
联系人:孙洪美

15.代售机构:天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座
法定代表人:林文义
电话:(010)84533151-822
传真:(010)84533162
联系人:陈少震
基金管理人可根据有关法律法规规定,选择其他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:招商基金管理有限公司
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦28楼
法定代表人:牛冠兴
成立日期:2002年12月27日
电话:(0755)83196445
传真:(0755)83196436
联系人:谢先斌、郭文成
(三)律师事务所和经办律师
名称:北京市中银律师事务所
注册地址:北京市朝阳区东三环北路2号南银大厦28层
法定代表人:王磊
电话:(010)59241188
传真:(010)59241199
经办律师:王明涛、李小明
联系人:王明涛

(四)会计师事务所和经办注册会计师
名称:德勤华永会计师事务所
注册地址:上海市北京东路222号30楼
法定代表人:谢洪霖
联系电话:(021)63350202

传真:(021)63350003
经办注册会计师:李晖华、陶璵

联系人:陶璵

四、基金名称:招商安本增利债券型证券投资基金

五、基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标:在严格控制投资风险、维护本金安全的基础上,为基金份额持有人谋求持续稳健的投资收益。

七、投资方向

本基金投资于具有良好流动性的固定收益类品种,包括国债、金融债、信用等级为投资级以上的企业债和次级债、可转换债券、短期融资券、债券回购、央行票据、同业存款等,以及股票等权益类品种和法律法规监管机构允许基金投资的其它金融工具。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,将其纳入投资范围。

本基金债券等固定收益类品种的投资比例为80%—100%(其中现金或到期日在一年以内的政府债券不超过5%)、股票等权益类品种的投资比例为0%—20%。

八、基金的投资策略

(1)资产配置
本基金对债券等固定收益类品种的投资比例为80%—100%(其中现金或到期日在一年以内的政府债券不超过5%)、股票等权益类品种的投资比例为0%—20%。

(2)组合构建
(1)货币市场工具投资
在本基金的货币市场工具投资过程中,将以严谨的市场价值分析为基础,采用稳健的投资组合策略,通过对短期金融工具的组合操作,在保持资产的流动性的同时,追求稳健的投资收益。

(2)债券(不含可转债)投资
在本基金的债券(不含可转债)投资过程中,本基金管理人将采取积极主动的投资策略,以中长期利率趋势分析为基础,结合中长期的经济周期、宏观政策方向及收益率曲线分析,实施积极的债券投资组合管理,以获取较高的债券投资组合投资收益。

(3)可转债投资
对于本基金可转债的投资,本基金管理人主要采用可转换债券价值分析策略。由于可转债兼具债性和股性,其投资风险和收益介于股票和债券之间,可转债相对价值分析策略通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值,把握可转债的价值走向,选择相应券种,从而获取较高投资收益。

(4)股票投资
本基金的股票投资包括股票一级市场投资和股票二级市场投资。
在参与股票一级市场投资的过程中,本基金管理人将全面深入地把握上市公司基本面,运用招商基金的研究平台和股票价值体系,深入发掘新股内在价值,结合市场估值水平和股票市场环境,充分发挥本基金作为机构投资者在新股公开发行过程中的对新股定价所起的积极作用,积极参与新股的申购、询价与配售,有效识别并防范风险,以获取较好收益。

当本基金管理人判断市场出现明显的投资机会,或行业(个股)的投资价值被明显低估时,本基金可以直接参与股票二级市场投资,努力获取超额收益。

3.投资决策
在本基金管理人投资架构中,投资决策主要由投资决策委员会和基金经理小组负责完成。可进一步细化为投资决策委员会和基金经理小组两个层面和决策流程:资产配置、组合构建、个性化仓位和风险控制五个环节。每环节的具體投资管理流程如下所示:

1.投资决策委员会批准投资策略
投资决策委员会根据基金经理小组提供的投资策略报告、上期投资绩效检讨报告及数量分析组提供的风险评估与绩效评估报告等资料,在充分讨论的基础上,批准未来一段时间内本基金投资策略及重大事项。

2.资产配置周期确定资产配置
资产配置周期根据投资决策委员会会议,在投资授权范围内确定本基金资产配置方案,确定本基金短期(两周以内)货币市场工具、债券及股票(新股申购或二级市场投资)的债券、股票、股票/周会确定债券(股票)标准模拟投资组合

债券(股票)分析组合在资产配置周期确定的资产配置方案的基础上,依照标准(包括货币市场工具)组合构建流程,新股申购流程和股票二级市场组合构建流程等进行每周债券、新股申购或股票二级市场模拟组合,并成为本基金确定个性化投资组合的依据。

4.基金经理小组根据个性化资产配置
基金经理小组根据资产配置及债券(股票)周会会议确定基金投资组合,同时制定每周组合调仓方案。组合调整方案经主管投资的副经理批准后,由本基金基金经理负责组织实施,并就需要面临风险控制的一切向主管投资的副经理报批。

5.风险管理部实时监控投资风险
在投资实施过程中,风险管理部对本基金投资组合的市场风险、流动性风险及信用风险等投资风险进行事前评估,事中监控以及事后跟踪分析,并在整个投资流程完成后,对投资风险及绩效做出评估,提供给投资决策委员会、投资总监、基金经理等相关人员,以供决策参考。

监察稽核部门及风险管理部负责对本基金投资的合规性风险、操作风险、道德风险以及其他风险进行全程监控。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:三年期银行定期存款税后利率+0.2%
本基金投资于固定收益类品种为主,以为投资者创造持续稳健投资收益为目标,而以三年期银行定期存款税后利率这种对收益比较基准为基础再加上一定的收益溢价作为本基金的业绩比较基准比相对贴切体现和衡量本基金的投资目标、投资策略以及投资业绩。

十、投资组合报告

(一)报告期末基金资产组合情况

项目	金额(元)	占总资产比例
股票	903,533,349.98	19.05%
债券	3,770,946,750.50	79.49%
其中:资产支持证券	29,456,000.00	0.62%
权证	8,206,220.28	0.17%
银行存款和现金类资产合计	4,681,625.61	0.10%
其他资产	56,427,217.21	1.19%
合计	4,743,796,182.63	100.00%

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业名称	市值(元)	占净值比例
1	A 农、林、牧、渔业	---	---
2	B 采矿业	143,803,396.97	3.13%
3	C 制造业	28,954,610.95	0.59%
C0 食品、饮料	1,068,960.10	0.02%	
C1 纺织服装、皮毛	241,000.00	0.01%	
C2 木材、家具	---	---	
C3 造纸、印刷	---	---	
C4 石油、化学、塑胶、塑料	549,046.60	0.01%	
C5 电子	2,320,821.47	0.05%	
C6 金属、非金属	2,382,896.28	0.05%	
C7 机械、设备、仪表	19,896,371.50	0.43%	
C8 医药、生物制品	535,670.00	0.01%	
C9 其他制造业	---	---	
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	11,196,480.00	0.24%
5	E 建筑业	37,946,070.07	0.83%
6	F 交通运输、仓储业	277,424,610.09	6.04%
7	G 信息技术业	3,499,729.72	0.08%
8	H 批发和零售业	849,433.41	0.02%
9	I 金融、保险业	368,623,281.07	7.97%
10	J 房地产业	35,684,278.62	0.78%
11	K 社会服务业	255,060.00	0.01%
12	L 传播与文化产业	331,382.28	0.01%
13	M 综合类	---	---
L 合计	903,533,349.98	19.05%	

(三)报告期末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(股)	市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	601006	大秦铁路	6,682,377	171,202,498.74	3.72%
2	601629	中国铁建	1,394,400	112,079,136.00	2.44%
3	601318	中国平安	939,400	61,681,790.00	2.17%
4	601088	中国神华	940,128	61,681,790.00	2.17%
5	601019	中国移动	1,187,580	50,662,162.80	1.10%
6	601399	建设银行	4,622,200	47,486,670.00	1.03%
7	601398	工商银行	5,511,200	44,306,066.00	0.98%
8	600303	中信证券	489,741	43,629,900.07	0.98%
9	601333	广深铁路	4,569,089	42,949,436.60	0.94%
10	601390	中国银行	3,302,443	37,946,070.07	0.83%

(四)报告期末按券种分类的债券投资组合

券种分类	期末市值(元)	市值占净值比例
国家债券	70,245,644.60	1.53%
金融债券	2,136,345,600.00	46.54%
企业债券	435,049,687.76	9.48%
可转换债券	18,700,318.14	0.41%
中央银行票据	1,071,647,500.00	23.36%
商业银行票据	9,502,000.00	0.21%
资产支持证券	29,456,000.00	0.64%
合计	3,770,946,750.76	82.16%

(五)报告期末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	债券名称	期末市值(元)	市值占净值比例
1	07央行票据 31	320,067,000.00	6.97%
2	07国债 21	296,370,000.00	6.46%
3	07央行票据 04	243,200,000.00	5.30%
4	07国债 16	199,460,000.00	4.35%
5	07国债 20	157,664,000.00	3.44%

(六)报告期末基金投资前十名资产支持证券明细

序号	证券名称	期末市值(元)	市值占净值比例
1	07国债 1A	19,456,000.00	0.42%
2	07央行票据	10,000,000.00	0.22%
3	---	---	---
4	---	---	---
5	---	---	---
6	---	---	---
7	---	---	---
8	---	---	---
9	---	---	---
10	---	---	---

(七)报告期末按市值占基金资产净值比例大小排序的所有权证明细

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	成本总额	投资类别
1	580014	深高 CWB1	261,298	965,614.10	被动投资
2	580015	日照 CWB1	217,140	459,165.40	被动投资
3	580016</				