

工银瑞信红利股票型证券投资基金

更新的招募说明书摘要

基金管理人：工银瑞信基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

重要提示

本基金经中国证券监督管理委员会2007年7月2日证监基金字[2007]1185号文核准募集。

基金管理人保证本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。

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《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管理人在基金合同实施过程中的权利和义务，应详细查阅基金合同。

投资人认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

基金管理人承诺以恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产。

基金管理人不对本基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动，投资者在投资本基金前，应全面了解本基金的产品特性，充分考虑自身风险承受能力，理性判断市场，并承担基金投资中出现的各类风险，包括：因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、基金管理人及基金托管人因操作产生的基金管理人风险、本基金的特定风险等等。

投资人认购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金管理人建议投资者根据自身的风险收益偏好，选择适合自己的基金产品，并且中长期持有。

本基金合同生效后一年之内(含一年)为封闭期，在此期间投资者不能申购赎回基金份额，也不能在证券交易所转让基金份额。基金合同生效满一年以后，本基金转为开放式基金，投资人方可进行基金份额的申购与赎回。

本招募说明书所载内容截止日为2008年1月17日，有关财务数据和净值表现数据截止日为2007年12月31日。本招募说明书的更新部分已经基金托管人复核。

一、基金管理人

(一)基金管理人概况

1.基金管理人基本情况
名称：工银瑞信基金管理有限公司
住所：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际商务大厦
法定代表人：杨凯生
成立日期：2005年06月21日
批准设立机关：中国证券监督管理委员会
批准设立文号：中国证券监督管理委员会证监基金字[2005]193号
中国银行业监督管理委员会银监复[2005]105号
经营范围：基金募集；基金销售；资产管理以及中国证监会许可的其它业务。

组织形式：有限责任公司
注册资本：2亿元人民币
联系人：夏洪彬
联系电话：010-65179888
股权结构：中国工商银行股份有限公司占公司注册资本的55%；瑞士信贷资产公司注册资本的25%；中国远洋运输(集团)总公司占公司注册资本的20%。

存续期间：持续经营

(二)主要人员情况

1. 董事会成员

杨凯生先生：董事长，博士，1975年起从事工业企业生产工艺和成本预算管理工作，1985年进入银行，历任中国工商银行监察室副主任、规划信息部主任、深圳分行行长，1996年任中国工商银行副行长，1999年9月任中国华融资产管理公司总裁。2004年9月再次兼任中国工商银行副行长。2005年10月至今任中国工商银行股份有限公司副董事长、执行董事、行长。现为武汉大学经济学院兼职教授，中国国际经济贸易仲裁委员会第十六届委员会副主任。

Anthony Nimeh Iliya 先生：董事，工商管理硕士。1996-2000年任General Re Financial Products 首席执行官、总裁及董事会成员。2000-2003年任Newtownmore Advisors Limited 伦敦董事总经理及合伙人，负责投资及募集资金。2004年任Cumulus Capital SA 贝鲁特主席及投资管理及财务顾问公司总理。服务位于中东国家的高资产价值的个人及家庭。2005年1月至2006年9月，任瑞士信贷(香港)有限公司董事总经理。2006年10月至今任瑞士信贷资产管理(香港)有限公司执行副主席，亚太区资产管理部主管，瑞士信贷资产管理亚太区管理委员会成员，瑞士信贷银行香港行政总裁。

David Peter Walker 先生：独立董事，1978年至1983年任职于J.P. Morgan，负责跨国企业的资金管理咨询研究的推广及进行，以及推广及执行债务融资；1983年至1990年任职于Bankers Trust，先后担任资本市场部发起成员、执行董事及美国资本市场部主管、负责亚太区(日本除外)的银行及证券业务；1990年至2003年5月，任职于瑞士信贷第一波士顿，担任执行董事、证券产品业务主管、投资银行部主管等职；2003年6月至今，成立物业发展业务公司，并兼任几家英国公司的董事。

陈晓燕女士：董事，学士。1982-1984年任职于中国人民银行发展局。1984-1986年任中国工商银行会计部营业处处长。1986-1998年任中国工商银行会计部副主任。1998-1999年任中国工商银行银行卡部主任。1999-2001年任中国工商银行资金营运部总经理。2001年1月至今任中国工商银行个人金融业务部总经理。

李扬先生：独立董事，博士。1989-2003年中国社会科学院财贸经济研究所副所长。2003至今中国社会科学院金融研究所所长。
王大鸣先生：独立董事，博士。1995-2000年ASIAN MERCHANTS PTE LTD 副总经理、总经理。1999-2000年MERCHANTS HOLDINGS (SINGAPORE) PTE LTD 副总裁(兼)。2000年至今PHQ HOLDINGS (SINGAPORE) PTE LTD 执行董事。

孙月英女士：董事，学士。1998-2000年中远集团总公司财务部总经理。2000年2月-2000年12月中远集团总公司，副总会计师。2000年12月至今，任中远集团总公司总会计师。

徐志宏先生：董事，博士。2000-2001年中国工商银行计划财务部副经理。2001-2002年中国工商银行资金营运部资金营运副经理(主持工作)。2002年至2005年10月任中国工商银行资金营运部总经理。2005年10月至2006年6月任中国工商银行银行卡部总经理，牡丹卡中心总裁、党委书记。2006年至今任中国工商银行金融市场部总经理。

郭特华女士：董事，副总经理，博士。1989-1998年中国工商银行总行商业信贷部、资金计划部副处长，1998-2005年中国工商银行总行资产托管部历任处长，副总经理。2005年6月至今任工银瑞信基金管理有限公司总经理。

2. 监事会成员

陈克儒先生：监事长，学士。1996年任中国工商银行党组成员、人事部总经理。1997年任中国工商银行纪检组纪检检查组组长、党组成员。1998-2005年任中共中国工商银行纪检检查委员会书记、党委委员。

Salman Shoaib 先生：监事，硕士，1996-1998年美国银行，金融机构团队研究员。1992-1994年Khadim Al Shah Bukhari & Co., 董事会董事、企业融资负责人。1994-1997年Shoaib先生拥有自己的公司，首席执行官。1989年加入瑞士信贷，先后就职于英国投资银行部和亚洲投资银行部。2000-2005年瑞士信贷第一波士顿董事总经理，瑞士信贷集团全球战略部门负责人。2005年至今，瑞士信贷资产管理部亚太区首席运营官，董事总经理。

李西贝先生：监事，大专。1999-2001年中远工业公司人事部经理。2001-2005年中远(集团)总公司纪检组纪检组审计处处长。2002-2005年中远(集团)总公司监督部副总经理兼监察室副主任。2006年至今中远(集团)总公司纪检工作组副部长、监察室副主任。

张轶先生：监事，双学士。1998-2000年，任职于中国工商银行总行技术保障部。2000-2001年，任职于中国工商银行总行数据中心。2001-2005年，任职于中国工商银行总行信息中心副主任。现任工银瑞信基金管理有限公司信息技术部副总监。

朱辉毅先生：监事，硕士。1996-1998年中国工商银行人力资源部。1998-2005年先后任职于中国工商银行资产托管部及中国工商银行北京东城支行。现任工银瑞信基金管理有限公司运作部总监。

3. 其他高级管理人员

孙晋艳女士：督察长，硕士，国际注册会计师。1997-1999年中国华融信托投资公司证券总部经理，2000-2005年中国华融资产管理公司投资银行部、证券业务部高级副经理。

戴勇毅先生：副总经理，硕士。1993年至1995年任职于上海万国证券公司，担任基金管理部基金经理；1995年至1998年任职于华夏证券公司，担任交易部副总经理；1998年至2005年任职于华夏基金管理有限公司，历任兴华基金基金经理、基金管理部总经理、总经理助理、副总经理兼投资总监、副总经理兼市场总监、常务副总经理。

夏洪彬先生：副总经理，工商管理硕士。1999年至2003年任职于瑞士信贷资产管理公司，先后担任高级风险分析师、副总裁；2003年至2005年任职于瑞士信贷第一波士顿，曾担任瑞士信贷第一波士顿 Tremont 对冲基金指数的数量分析员、基金经理、副总裁。

肖在翔先生：副总经理，毕业于中国社会科学院研究生院。1980年至1982年任职于中国人民银行，1984年至2007年任职于中国工商银行，历任储蓄部储蓄业务处处长、零售业务部副总经理，个人金融业务部副总经理。2007年10月加入工银瑞信基金管理有限公司，2007年10月至2007年12月担任公司高级顾问。

4. 本基金基金经理
杨建勋先生：毕业于北京大学，获经济学硕士学位。1993年7月至1997年7月，任职于沈阳财政局会计师事务所。2000年7月至2006年9月，任职于鹏华基金管理有限公司，历任研究员、基金经理助理、普润基金经理、鹏华行业成长基金经理。2004年8月至2006年9月，兼任普润基金经理；2005年2月至2006年9月，担任鹏华行业成长基金经理。2006年10月至今，任职于工银瑞信基金管理有限公司，2007年3月至2007年11月，担任工银瑞信精选平衡混合型基金基金经理。2007年3月至今，担任工银瑞信稳健成长股票型基金基金经理。2007年7月至今，担任工银瑞信红利股票型基金基金经理。

詹勇萍女士：毕业于中国人民大学，获经济学学士学位。1992年1月至1994年1月，任职于安达信企业咨询有限公司，担任注册会计师。1994年1月至1999年1月，任职于法国兴业证券公司上海办事处，担任高级研究员。1999年1月至2004年6月，任职于博时基金管理有限公司，担任首席分析师、研究部经理、投资决策委员会委员。2004年6月至2005年6月，任职于友邦华泰基金管理有限公司，担任研究部总监、投资决策委员会委员。2005年7月至今，任职于工银瑞信基金管理有限公司，担任研究部总监，并从2007年5月至11月兼任工银瑞信核心价值基金基金经理。2007年7月起兼任工银瑞信红利股票型基金基金经理。

5. 投资决策委员会成员
主任：副总经理戴勇毅先生
主任：研究部总监詹勇萍女士，固定收益部总监文鸣先生，权益投资部基金经理张翎先生、杨建勋先生，权益投资部基金经理吴刚先生。
上述人员之间均不存在近亲属关系。

二、基金托管人

本基金托管人为中国建设银行股份有限公司，基本情况如下：
名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号

办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郭树清
法定地址：郭树清
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元人民币
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基金字[1998]12号
联系人：尹东
联系电话：(010) 6759 5003

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

1. 直销机构

名称：工银瑞信基金管理有限公司
办公地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际商务大厦
注册地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际商务大厦2层
法定代表人：杨凯生
客户服务电话：010-65179888
传 真：010-95159100
联系人：郝伟
网 址：www.icbccs.com.cn
2. 代销机构

(1) 中国建设银行股份有限公司
注册地址：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：郭树清
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.cn
(2) 中国工商银行股份有限公司
注册地址：中国北京复兴门内大街55号
办公地址：中国北京复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务电话：95588(全国)
网址：www.icbc.com.cn

(3) 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
办公地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：秦晓
客户服务电话：95555
公司网址：www.cmbchina.com

(4) 光大证券股份有限公司
地址：上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南路15-16楼
法定代表人：王明凯
电话：021-68816000
联系人：刘晨
客户服务电话：10108998
网址：www.ebscn.com

(5) 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
办公地址：上海市延平路135号
法定代表人：刘炯一
联系人：李晔
电话：(010) 66658047
公司网址：www.chinastock.com.cn

(7) 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
办公地址：北京市东城区朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
开放式基金咨询电话：400-8888-108
开放式基金业务传真：(010) 65182261
联系人：魏明
公司网址：www.csc108.com

(8) 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40-45层
办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座40-45层
法定代表人：肖时兴
电话：0755-82943511
传真：0755-82943237
联系人：黄健
客户服务电话：400-8888-111、0755-26954111
公司网址：www.newone.com.cn

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行相关义务等。

(二) 注册登记机构
名称：工银瑞信基金管理有限公司
住 所：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际商务大厦
办公地址：北京市东城区朝内大街188号鸿安国际商务大厦2层
法定代表人：杨凯生
电 话：010-65179888
传 真：010-95159100
联系人：朱辉毅

(三) 律师事务所及经办律师
名 称：北京市德恒律师事务所
住 所：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座十二层
负责人：王丽
电 话：(010) 66575888
传 真：(010) 65232181
经办律师：李晓明、贾琛

(四) 会计师事务所及经办注册会计师
名 称：普华永道中天会计师事务所有限公司
住 所：上海市浦东新区东昌路568号
办 公 地 址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人：杨绍信
经办注册会计师：任桂 魏灼
联系电话：(021) 61238888
传 真：(021) 61238800
联系人：魏灼

四、基金名称
本基金名称：工银瑞信红利股票型证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：股票型基金

六、基金的投资目标

在合理控制风险的基础上，追求基金资产的长期稳定增值，获得超过业绩比较基准的投资业绩。

七、基金的投资方向

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

上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以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。

基金的投资组合比例为：封闭期间，股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-100%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为0%-40%，权证投资占基金资产净值的比例不超过3%；开放期间，股票等权益类资产占基金资产的比例为60%-95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。若法律法规或中国证监会对基金投资权证的比例有新的规定，适用新的规定。股票指数期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

八、基金的投资策略

本基金专注基本面研究，遵循系统化、程序化的投资流程以保证投资决策的科学性与一致性。

1. 资产配置策略
本基金将运用国际化的视野审视中国经济和资本市场，分别从宏观经济情景、各类资产收益风险预期等方面进行深入分析，在股票与债券资产之间进行策略性资产配置，以使基金在保持总体风险水平相对稳定的基础上，优化投资组合。

2. 股票资产投资策略
本基金采用定性和定性相结合的个股精选策略，通过红利股筛选、竞争优势评价和盈利预测的选股流程，精选出兼具稳定的高分红能力、较强竞争优势和持续盈利增长的上市公司股票作为主要投资对象，以增强本基金的投资收益和资本增值能力。本基金投资于红利型股票的比例不低于本基金持有的股票资产的80%。

(1) 红利股筛选
本基金综合考察上市公司分红记录和分红预期等指标来确定基金初始选股备选库。具体选股标准包括满足以下一项或多项特征的股票：

1) 过去三年内至少存在二次分红记录，其中分红包括现金股利和股票股利；
2) 过去两年平均分红率高于市场平均水平；
3) 预期公司具有高于市场平均水平的股利收益。

(2) 竞争优势评价
企业在行业中的相对竞争力是决定其成败的关键。本基金将从企业的基本战略、产品市场份额、成本状况、技术水平及创新能力，以及企业的经营管理水平等多方面，考察企业在行业中的竞争地位。在上述分析的基础上，本基金还将考察企业的盈利能力、财务状况和资产经营效率等财务经营指标，筛选出在财务和管理品质上符合本基金投资要求的上市公司，构成本基金的基础股票备选库。

在基础股票备选库的基础上，通过实地调研考察上市公司，选择治理结构完善、经营稳健、业绩优良、具有可持续增长前景的上市公司，以合理价格买入其股票并进行中长期投资。

(3) 价值评估

在定性分析的基础上，本基金采用现金流折现模型、相对估值法等方法评估上市公司的内在价值。同时，本基金还将参考HOLT价值评估系统所进行的股票价值评估结果。HOLT是本基金管理人从外方股东瑞士信贷引入的其独有的公司绩效与价值评估系统。HOLT分析上市公司现金流投资回报率(Cash Flow Return on Investment, CFROI?)，并应用现金流折现(Discounted Cash Flow)模型对股票进行估值。

(4) 股票选择及组合优化
综合性分析并定量价值评估的结果，选择定价合理或者价值被低估的股票构建投资组合，并根据股票的预期收益与风险水平对投资组合进行优化。

3. 债券投资策略

基于策略性资产配置的需要，本基金在预期股票市场阶段性回报率低于债券资产回报率时，本基金将会将一部分基金资产投资于国债、金融债、中央银行票据及企业债券等固定收益资产。本基金在固定收益证券投资与研究方面，实行投资策略研究专业化分工制度，专业研究人员分别从利率、信用风险等角度，提出独立的投资策略建议，经固定收益投资团队讨论，并经投资决策委员会批准后形成固定收益证券指导性投资策略，具体包括利率策略、信用策略、债券选择策略等。本基金在固定收益证券总体指导性投资策略的基础上，结合本基金流动性要求的特点，形成具体投资策略。

4. 权证及其他金融工具投资策略
本基金将按照相关法律法规通过利用权证、股票指数期货及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。

本基金进行权证投资时，将在对权证证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。

本基金投资于股票指数期货主要用于避险交易及套利交易。

九、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：新华富时150红利指数收益率。
新华富时150红利指数是在新华富时目前的指数体系成分股的框架下，进一步依照个股分红情况编制而成。在样本股选取方面，该指数构建在沪深两市A股的基础上，更全面考察全市场上公司分红状况；同时，该指数重点考虑连续三年有分红记录的公司，可以更好地衡量上市公司分红的稳定性。此外，该指数在初期样本股基础上，进行流动性检验，更好掌握样本个股性。因此，新华富时150红利指数适合作为本基金的股票业绩比较基准。

将来如出现更具代表性的红利指数、债券市场指数，基金管理人可根据本基金的投资范围和投资策略，确定变更基金的业绩指数或其权重构成。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人调整前3个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

十、基金的风险收益特征

本基金属于股票型基金中的红利主题型基金，其风险与预期收益高于债券型基金及混合型基金。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告期为2007年10月1日起至12月31日止。

项目	金额(元)	占总资产比例
股票	6,060,646,347.01	86.00%
债券	27,768,762.13	0.39%
权证	7,434,935.68	0.11%
资产支持证券	0.00	0.00%
银行存款和清算备付金合计	946,420,140.26	13.44%
其他资产	4,673,132.94	0.07%
合计	7,039,943,356.02	100.00%

2、 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	行业分类	市值(元)	占净值比例
1	A 农林牧渔业	827,265.90	0.01%
2	B 采矿业	832,079,851.97	11.90%
3	C 制造业	2,273,383,908.98	32.32%
30	食品、饮料	146,166,830.00	2.08%
31	纺织、服装、皮毛	362,560.00	0.01%
32	木材、家具	0.00	0.00%
33	造纸、印刷	111,844,636.20	1.60%
34	石化、化学、塑胶、塑料	534,233,976.11	7.64%
35	电子	1,767,563.40	0.03%
36	金属、非金属	602,360,596.50	8.61%
37	机械、设备、仪表	789,216,988.07	11.43%
38	医药、生物制品	78,465,698.80	1.12%
39	其他制造业	0.00	0.00%
4	D 电力、煤气及水的生产和供应业	133,438,694.40	1.91%
5	E 建筑业	286,840,158.28	4.10%
6	F 交通运输、仓储业	505,684,401.19	7.22%
7	G 信息技术业	44,881,667.19	0.64%
8	H 批发和零售贸易	229,323,323.07	3.28%
9	I 金融、保险业	1,368,720,380.23	19.43%
10	J 房地产业	381,386,931.88	5.46%
11	K 社会服务业	3,570,528.77	0.05%
12	L 传播与文化业	478,132.28	0.01%
13	M 综合类	0.00	0.00%
合计		6,060,646,347.01	86.04%

3. 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)	期末市值(元)	市值占基金资产净值比例
1	600150	中国船舶	1,600,046.00	414,579,638.30	5.93%
2	600036	招商银行	9,550,000.00	378,406,500.00	5.41%
3	000709	首钢股份	11,489,307.00	297,002,988.98	4.19%
4	800000	浦发银行	5,389,968.00	284,500,383.20	4.07%
5	000677	金丰能源	9,503,319.00	267,138,297.00	3.82%
6	000001	平安银行 A	6,489,934.00	250,887,462.40	3.59%
7	000002	万科 A	8,074,817.00	232,877,722.28	3.33%
8	601919	中钢国际	5,000,000.00	230,364,000.00	3.29%
9	601006	大秦铁路	8,219,920.00	210,583,889.24	3.01%
10	600670	华研国际	3,376,796.00	201,989,598.72	2.89%

4. 报告期末按券种分类的债券投资组合

序号	债券品种	市值(元)	占净值比例
1	可转债债券	11,447,904.13	0.16%
2	企业债券	16,320,888.00	0.23%
3	央行票据	0.00	0.00%
4	金融债券	0.00	0.00%
合计		27,768,762.13	0.40%

5. 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	市值(元)	占净值比例
1	国债07	16,320,888.00	0.23%
2	浦发转债	11,447,904.13	0.16%
3	-	-	-
4	-	-	-
5	-	-	-

6. 按照被动持有和主动投资两种类别，披露报告期末的权证明细

序号	权证名称	代码	数量(份)	成本(元)	获得方式
1	上汽CW81	580016	818,316	7,102,665.65	网下申购“08上汽债”适配
合计				7,102,665.65	

7. 报告期末资产支持证券市值占基金资产净值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
本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8. 投资组合报告附注

(1) 报告期内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的，没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

(2) 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

(3) 基金的其他资产构成

序号	其他资产	金额(元)
1	交易保证金	4,447,241.80
2	应收证券清算款	0.00
3	应收利息	225,891.14
4	应收申购款	0.00
5	其他应收款	0.00
6	预缴费用	0.00
7	其他	0.00
合计		4,673,132.94