


中银持续增长股票型证券投资基金

更新招募说明书摘要

基金管理人： 中银基金管理有限公司 基金托管人：中国工商银行股份有限公司
二〇〇八年十月

重要提示
本基金经中国证监会2005年12月13日证监基金字〔2005〕197号文件核准募集,本基金基金合同于2006年3月17日正式生效。

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做出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。
投资者应认真阅读基金合同、基金招募说明书、基金托管协议、基金投资资产、但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

投资有风险,投资者认购(或申购)基金时应仔细阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本更新招募说明书所载内容截止日2008年9月17日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年6月30日(财务数据未经审计)。本基金托管人中国工商银行已复核了本次更新的招募说明书。

一、 合同生效日

2006年3月17日

二、 基金管理人

(一) 基金管理人概况

- 1.公司名称:中银基金管理有限公司
- 2.住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
- 3.设立日期:2004年8月12日
- 4.法定代表人:贾建平
- 5.执行总裁:陈骅
- 6.办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
- 7.电话:(021)38834909
- 8.传真:(021)68872488
- 9.联系人:范麗萍
- 10.注册资本:1亿元人民币
- 11.股权结构:

股东	出资额	占注册资本的比例
中银行股份有限公司	人民币8500万元	85.0%
荷兰银行(美国)有限公司	新加坡人民币1650万元的美元	15.0%

(二) 主要人员情况

1. 董事会成员

贾建平先生,董事长,国籍:中国,高级经济师。历任中银基金管理有限公司筹备组长、中国环球租赁有限公司业务部副主任,中国银行信托咨询公司副处长,处长,中国银行内蒙古分行副经理,中国银行广东代表处首席代表,中银国际投资有限公司(前香港)副董事长、总经理,中国银行投资管理总部总经理,中国银行重组上市办公室主任,中国银行董事会秘书办公室主任兼总经理,中国银行上市办公室主任兼总经理等职。兼任中国科技金融促进会副理事长。
陈雁先生,董事,国籍:中国,中银基金管理有限公司董事、执行总裁,经济学博士,南开大学博士后,高级经济师,国务院政府特殊津贴专家。曾参与深交所筹建。历任深圳投资基金管理有限公司董事长兼执行总裁,中国银行总行基金托管部总经理,中银国际控股董事总经理,中银国际英国保诚资产管理公司董事,中银国际证券副执行总裁、董事总经理,原中银国际基金管理有限公司董事、执行总裁。

董杰先生,董事,国籍:中国。现任中国银行股份有限公司托管及投资者服务部总经理。历任中国银行天津市分行副行长、党委委员,中国银行深圳市分行沙头角支行行长、深圳市分行信贷经营处处长、公司业务处处长、深圳市分行行长助理,党委书记等职。西南财经大学博士学位。

服山清一先生,董事,国籍:日本。现任贝莱德投资管理有限公司董事总经理,贝莱德亚洲区副主席。历任贝莱德日本的负责人和贝莱德亚洲区副主席,美林亚太区执行委员会委员。1989年起,供职于水屋资产管理公司和美林资产管理公司(2006年,美林资产管理公司与贝莱德合并),担任伦敦、台湾、香港、日本公司的业务拓展和管理职位。在任职美林之前,曾为B.A.I.香港和伦敦公司管理可转换对冲基金,2001年至2003年间,曾任香港投资公司联合创始人。东京欧亚大学比较文学学士,曾获中华人民共和国授予的中日奖学金在上海音乐学院从事研究工作。

赵纯均先生,独立董事,国籍:中国。现清华大学经济管理学院教授,兼任中国国家自然基金管理科学部专家咨询委员会委员、中国系统工程学会副理事长等。历任清华大学自动化系教研室副主任、清华大学经济管理学院院长助理、系主任、副教授,清华大学经济管理学院第一副院长、教授,清华大学经济管理学院院长、教授。

闫磊先生,独立董事,国籍:中国。现任北京大学教授、博士生导师、北京大学校长助理,石河子大学副校长。曾任西安交通大学教师、内蒙古包钢钢铁股份有限公司独立董事、北京大学党委组织部常务副部长、内蒙古包头市市委副书记(挂职)、北京大学外国经济思想史专业博士、北京大学国民经济计划与管理专业硕士、西安交通大学低温工程专业学士、国家社科基金重大项目首席专家。

葛礼先生,独立董事,国籍:美国。现任明维创投资咨询有限公司的创办者,董事总经理,同时供职于里德学院董事会、亚洲协会、中美合资企业清洁制造、清洁能源论坛的顾问委员会,并担任纳斯达克上市公司THO的独立董事。曾在美国知名技术公司思科、英特尔等任高级管理职位,并被多家杂志如福布斯、红鲱鱼、网络评论评为全球最主要的风险投资家之一。曾在美国英特尔公司担任品质保证经理,在美国NCube公司、思科公司以及日本Sequent公司担任管理职位,后为SOFTBANK/Mobius 风险资本的创办者、董事总经理。哈佛大学工商管理硕士学位,里德学院生物学士。

2. 监事会成员

赵应祥先生,监事,国籍:中国。中央党校经济管理专业本科,人力资源管理师,经济师。现任中国银行人力资源部信息团队主管,曾担任中国银行人力资源部综合处副处长、处长,人力资源部技术干部部干部、副处长。

陈宇先生,职工监事,国籍:中国。复旦大学软件工程硕士研究生。现任中银基金管理有限公司信息资讯部主管,参与中银国际基金管理有限公司筹建工作。曾在申银万国证券股份有限公司从事信息技术管理工作,8年证券基金行业工作经历。

3. 管理层成员

陈健先生(Ru CHEN),国籍:中国,中银基金管理有限公司董事、执行总裁。经济学博士,南开大学博士,高级经济师,国务院政府特殊津贴专家。曾参与深交所筹建。历任深圳投资基金管理有限公司董事长兼执行总裁,中国银行总行基金托管部总经理,中银国际控股董事总经理,中银国际英国保诚资产管理公司董事,中银国际证券副执行总裁、董事总经理,原中银国际基金管理有限公司董事、执行总裁。

俞敬斌(Daiki Yu)先生,国籍:中国,助理执行总裁。北京大学经济学硕士。曾就职于嘉实基金管理有限公司任社保组合基金经理、鹏华基金管理有限公司任分析师。

欧阳向阳(Jason X. OUYANG)先生,国籍:加拿大,督察长,加拿大西安大略大学教育经济学工商管理硕士(MBA)和经济学硕士。曾在加拿大太平洋集团公司、加拿大帝国商业银行和加拿大伦人养老保险公司等海外机构从事金融工作多年,也曾任蔚深证券有限责任公司(现英大证券)研究发展中心总经理、融通基金管理有限公司市场拓展总监、监察稽核总监和上海复旦大学国际金融系国际金融教研室主任、讲师。

4. 基金经理

现任基金经理:

俞敬斌先生,中银基金管理有限公司助理执行总裁。北京大学经济学硕士。曾任嘉实基金管理有限公司全国社保组合基金经理、基金北京和基金经理助理,鹏华基金管理有限公司基金晋晖基金经理助理,行业分析师,具有10年证券投资管理经验,具备基金从业资格。2008年4月至今担任中银增长基金经理。

陈志龙先生,中银基金管理有限公司副总裁,英国雷丁大学 ISMA 中心金融工程与数量分析专业硕士、英国约克大学经济与金融专业硕士、北京航空航天大学管理信息系统专业学士。曾任中银国际证券有限责任公司资产管理部分析员、经理。持有全球风险专业人士协会颁发的金融风险管理师(Financial Risk Manager)资格、全球风险协会(CARP)会员、特许金融分析师(CFP)、香港理财分析师协会会员,具有6年基金从业资格,具有基金从业资格。2007年8月至今担任中银增长基金经理,2008年4月至今担任中银策略基金经理。

伍任先生,国际金融博士研究生,武汉大学软件工程学士。完成美国德克萨斯州立大学商学院EMBA课程学习,并曾在英国伦敦接受美林投资的全方位资产配置培训。曾任东方证券股份有限公司证券投资业务总部负责人、光大证券(上海)资产管理部副经理,具有12年投资、分析经验,具备基金、证券、期货从业资格。2006年3月至2008年4月担任中银增长基金经理。

(三) 投资决策委员会成员的姓名及职务

主席:俞敬斌(助理执行总裁)
成员:陈军(副总裁)、孙庆瑞(副总裁)、甘霖(副总裁)、张发荣(副总裁)、陈龙志(副总裁)

(四) 上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、 基金托管人

(一) 基本情况

名称:中国工商银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号
成立时间:1984年1月1日
法定代表人:姜建清
注册资本:人民币334,018,850,026元
联系电话:010-66106912
联系人:蒋松山

(截至2008年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工101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学位或高级管理人员资格。

(二) 基金托管业务经营情况
作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行始终秉持“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,依靠严密科学的资产管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务能力,强大的市场营销能力,为“大基金份额持有者和众多资产管理机构”提供安全、高效、专业的托管服务,取得了优异成绩。截至2008年6月,托管证券投资基金95只,其中封闭式10只,开放式85只。托管资产规模年均递增超过90%。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、契约类产品、OFII资产、ODII资产等产品在内的托管业务体系。2008年初,中国工商银行先后被《全球托管人》、《环球金融》、《财富》、《证券时报》和《上海证券报》等国内外权威媒体评为2007年度“中国最佳托管银行”,自2004年以来,工商银行托管服务获得的该类奖项累计已经达到12项。

(三) 相关服务机构

一、 基金销售机构
直销机构
名称:中银基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
法定代表人:贾建平
办公地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦45楼
执行总裁:陈骅

电话:(021)38834999
传真:(021)68872488
联系人:徐琳

2. 场外代销机构

- 1) 中国银行股份有限公司
住所:北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街1号
法定代表人:肖钢
成立日期:1912年2月5日
联系人:王长昆
客户服务电话:95566
网址:www.boc.cn
- 2) 中国工商银行股份有限公司
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
联系人:王传
电话:(010)66107900
传真:(010)66107914
客户服务电话:95588
网址:www.icbc.com.cn
- 3) 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
联系人:曹蔚
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com
- 4) 中国民生银行股份有限公司
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号
法定代表人:董文标
客户服务电话:95568
客户网站:www.cmbcc.com.cn
- 5) 中信银行股份有限公司
公司名称:中信银行股份有限公司
注册地址:北京市东城区朝阳门内大街8号富华大厦C座
法定代表人:孔丹
客服电话:95558(全国)
网站:http://bank.ecitic.com
- 6) 中银国际证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区银城中路200号中银大厦39F
法定代表人:唐新宇
联系电话:(021)68604866
联系人:张静
网址:www.bocichina.com
- 7) 海通证券股份有限公司
注册地址:上海市淮海中路98号
办公地址:上海市广东路689号
法定代表人:王开国
客服电话:400-8888-001
传真:021-23219100
联系人:金宏、李奕明
公司网址:www.htsec.com
- 8) 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:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝幼忠
联系人:芮筱祺
客服电话:400-888-666
网址:www.gtja.com
- 9) 平安证券有限责任公司
办公地址:广东深圳八卦三路平安大厦三楼
法定代表人:陈敬达
客服电话:400-8866-338
联系人:袁月
公司网址:www.pa18.com
- 10) 光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区西藏南路1508号
法定代表人:王梦琦
联系电话:10108988
联系人:刘晨
公司网址:www.ebscn.com
- 11) 申银万国证券股份有限公司
注册地址:上海市常熟路171号
办公地址:上海市常熟路171号
法定代表人:丁国荣
客服电话:021-962505
联系人:邵寒冰
公司网址:www.sw2000.com.cn
- 12) 中国银河证券股份有限公司
通讯地址: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:尚付庆
客服电话:4008-888-888
联系人:李菁
公司网站:www.chinastock.com.cn
- 13) 广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)
办公地址:广州市天河区北路183号大都会广场36.38.41.42楼
法定代表人:王志伟
电话:020-87558888
传真:020-87557985
联系人:肖梅
公司网站:www.gf.com.cn
- 14) 招商证券股份有限公司
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
客服电话:95565
联系人:黄健
公司网站:www.newone.com.cn
- 15) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京安立路66号4号楼
法定代表人:张佑君
客服电话:4008-888-108
联系人:权童
公司网站:http://www.csc108.com/
- 16) 中信金通证券有限责任公司
注册地址:杭州市中河南路11号凯商务大厦A座5层
法定代表人:刘军
客服电话:0571-96598
联系人:王勤
公司网站:http://www.bigsun.com.cn
- 17) 中信万通证券有限责任公司
注册地址:青岛市市南区苗岭路29号澳柯玛大厦15层(1507-1510室)
法定代表人:史洁民
客服电话:0531-96577
联系人:丁韶燕
公司网站:http://www.zxwt.com.cn
- 18) 国元证券股份有限公司
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号
法定代表人:凤志
客服电话:95578
联系人:李纯刚
公司网站:http://www.gyzq.com.cn/

3. 场内代销机构

场内代销机构是指具有开放式基金代销资格,经深交所和本基金管理人认可的,可通过深交所开放式基金销售系统办理开放式基金的认购、申购、赎回和转托管等业务的深交所会员单位(具体名单请参见深交所相关文件)。场内代销机构的相关信息同时通过深圳证券交易所网站(www.szse.cn)披露。

基金管理人可以根据相关法律法规要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。

(二) 基金投资决策流程图

名称:中国证券投资基金业协会
住所:北京市西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:陈耀先
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907

(三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师
名称:上海源泰律师事务所
住所:上海市浦东新区256号华夏银行大厦1405室
法定代表人:廖海
电话:(021)51150298
传真:(021)51150398

联系人:廖海
经办律师:廖海、黎明
(四) 审计基金财产的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
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
法定代表人:杨绍信
电话:(021)61238880
传真:(021)61238800
联系人:薛霓
经办注册会计师:薛霓、单峰

五、 基金名称

中银持续增长股票型证券投资基金

六、 基金的投资

1. 基金的投资目标

着重考虑具有可持续发展性的上市公司,努力为投资者实现中、长期资本增值的目标。

2. 基金的投资方向

具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。主要投资对象为有增长前景且具备可持续性潜力的股票。

3. 基金的投资策略

(一) 投资组合及投资管理
本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动投资管理策略,将定性与定量分析贯穿于公司价值评估、投资组合构建以及组合风险管理的全过程之中。

(二) 基金资产配置
本基金资产配置决策将借助中国银行和贝莱德投资管理宏观量化经济分析的研究成果,从经济运行周期的变动,判断市场利率水平、通货膨胀率、货币供应量、盈利变化等因素对证券市场的影响,分析各类资产的预期风险收益特征,通过战略资产配置确定基金资产在各大类资产类别间的比例,并参照定期编制的投资组合风险评估报告及相关数量分析模型,适度调整资产配置比例。

(三) 基金同时还将基于经济结构调整过程中的动态变化,通过策略性资产配置把握市场时机,力争实现投资组合的收益最大化。

(四) 基金投资组合的可操作性进行评价。综合以上股票后,再从基本面与投资评级更深入的分析 and 估值,构建投资组合。

(五) 债券组合的构建主要通过 GDP 增长速度、财政政策和货币政策的变化、通货膨胀的变动趋势分析,判断未来利率走势,确定债券投资组合的久期,并通过利率曲线、期限结构、债券类别的配置等积极的投资策略提高债券组合的收益水平,同时适当利用由于银行间市场和交易所市场的分割而形成的无风险套利机会进行套利。

(六) 在单个债券品种的选择上严格控制信用风险,以流动性、安全性为原则选择优质债券。

4. 资金管理

在现金管理上,基金经理通过对未来现金流的预测进行现金预算管理,及时满足本基金运作中的流动性需求。

(二) 投资决策依据及投资决策程序

1. 投资决策依据

- 1) 根据国家有关法律、法规、基金合同等的有关规定依法决策;
- 2) 投资研究团队对于宏观经济周期、行业增长形态、市场情况、上市公司财务数据及公司治理结构的定性定量化分析结果;
- 3) 中银国际证券研究员对于投资风险的评估报告与反馈意见。

2. 投资决策程序

在投资过程中,基金经理与投资决策委员会及投资队伍各职能部门的工作关系下图。



基金经理在授权下,根据基金的投资政策实施投资管理。

十、 业绩比较基准

本基金业绩比较基准的业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股指数;债券投资组合的业绩比较基准为上证国债指数。

本基金的整体业绩基准 = MSCI 中国 A 股指数 × 85% + 上证国债指数 × 15%

本基金投资 MSCI 中国 A 股指数作为股票投资部分的业绩比较基准是基于以下主要原因:

- 该指数充分考虑了自由流通市值和流动性等方面,各行业组别达到 65% 的代表性;
- 是一个独立的指数,但根据 MSCI 一贯的标准编制;
- 该指数的编制方法透明且客观,具有可复制性,而且指数跟踪费率较低;
- 该指数遵循全球行业分类标准(GICS),容易被全球投资者广泛接受;
- 该指数在以往 4 年中的总体波动性较其他备选指数低,风险调整后收益较好。

如果市场有其他更适合本基金的业绩比较基准时,本基金可以通过适当程序变更业绩比较基准。

十一、 风险收益特征

本基金是主动管理的股票基金,属于证券投资基金中风险偏上的品种。

十二、 基金管理人代表基金份额持有人利益行使证券权利的处理原则及方法

1. 不谋求对上市公司的控股,不参与所投资上市公司的经营管理;
2. 有利于基金资产的安全与增值;
3. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利,保护基金投资者的利益。

4. 基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使债权人权利,保护基金投资者的利益。

十三、 投资组合报告

本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法律责任。

本基金的托管人——中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2008年9月9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。

投资组合报告所载数据截至2008年6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

(一) 期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益类投资	9,603,676,750.49	77.96%
	其中:普通股	9,603,676,750.49	77.96%
2	固定收益类投资	2,033,590,200.40	16.36%
	其中:债券	2,033,590,200.40	16.36%
3	金融衍生品投资	—	—
4	买入返售金融资产	24,263,972.00	0.20%
5	应收利息	—	—
6	银行存款和拆出资金	329,762,280.88	2.66%
7	其他	364,074,890.30	2.93%
8	合计	12,436,707,110.77	100.00%

(二) 期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	12,917,488.00	0.10%
B	制造业	9,676,553,058.89	4.66%
C	采掘业	4,879,589,383.47	38.53%
CD	食品饮料	638,231,279.14	5.16%
CS	纺织服装、服饰	258,066.68	0.00%
CX	电子计算机	96,287,746.47	0.78%
CI	医药生物	42,122,040.70	0.34%
CJ	石油、化学、塑胶、塑料	677,585,120.54	5.47%
CK	有色金属	—	—
CL	金属、非金属	1,314,454,332.96	10.61%
CM	机械、设备、仪器	940,599,630.20	7.69%
CN	其他行业	1,162,475,621.06	9.39%
CW	其他	—	—
D	电力、煤气及水的生产和供应业	156,977,307.90	1.27%
E	建筑业	60,641,617.70	0.49%
F	交通运输、仓储业	633,009,018.87	5.11%
G	信息传输	1,111,859,501.41	8.98%
H	房地产业	796,464,762.37	6.42%
I	金融、保险业	11,257,742,019.68	90.89%
J	其他行业	79,699,462.54	0.64%
K	社会服务业	60,060,000.00	0.49%
L	传播与文化产业	56,370,177.56	0.46%
M	综合类	59,384,067.20	0.48%
N	合计	9,603,676,750.49	78.03%

(三) 期末按公允价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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000019	宝钢股份	64,037,377	962,729,733.07	4.54%
2	600100	同方股份	28,727,773	521,015,824.48	4.21%
3	000660	泸州老窖	13,383,222	403,003,564.48	3.25%
4	601088	中国铁建	10,063,567	376,828,612.19	3.06%
5	601006	大秦铁路	26,157,856	356,008,406.56	2.87%
6	000600	青岛啤酒	39,127,893	346,378,176.52	2.79%
7	600030	中信证券	14,122,718	327,068,014.56	2.70%
8	000315	上海家化	10,460,250	280,641,220.00	2.41%
9	000289	航天新材	10,586,620	206,462,464.20	2.40%
10	600271	航天信息	10,456,938	279,200,244.00	2.26%

(四) 期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	品种名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	金融债券	1,023,068,000.00	82.20%
3	企业债券	1,010,522,000.00	24.28%
4	其他信用类固定收益	299,838,000.00	24.28%

序号	股票代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000198	08国债 40	7,000,000	672,560,000.00	5.43%
2	070481	07国债 01	4,000,000	397,480,000.00	3.13%
3	080103	08国债 13	2,500,000	240,250,000.00	1.94%
4	070184	07国债 04	2,300,000	222,770,000.00	1.80%
5	080207	08国债 07	2,300,000	223,008,000.00	1.79%

(五) 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

序号	股票代码	债券名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	080024	国债 CW91	17,000,080	20,456,828.76	0.17%
2	080022	国债 CW91	980,303	3,807,146.24	0.03%

(七) 投资组合报告附注

1. 本基金持有的上市证券采用公告内容截止日(或最近交易日)的市场收盘价计算,已发行未上市股票采用成本价计算。

2. 本基金本期投资的前十名证券中,无报告期内发行主体被监管部门立案调查的,或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

3. 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股票。

4. 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应付账款	1