

(上附 D41 版)  
投资组合分析

	2009年12月31日		2008年12月31日	
	价值	占比(%)	价值	占比(%)
持有到期债券	107,466	51.6	104,810	47.8
可供出售债券	88,380	42.4	103,660	47.0
以公允价值计量且其变动计入损益债券	4,444	2.1	8,762	4.0
可供出售权益投资	200,290	96.1	216,632	98.8
可供出售投资基金	5,487	2.6	50	—
以公允价值计量且其变动计入损益的权益基金	3	—	5	—
投资基金合计	5,490	2.6	55	—
可供出售权益投资	6,046	0.2	331	0.2
交易性权益投资	2	—	2	—
长期股权投资	2,254	1.1	2,297	1.0
投资合计	2,620	1.3	2,630	1.2
持有到期债券中上市证券市值	208,400	100.0	219,317	100.0
持有到期债券中非上市证券市值	1,941	—	2,887	—

单位:百万元人民币

2009年,本集团债券投资 2,002.90 亿元人民币,比上年末减少 163.42 亿元人民币,下降 7.54%,主要是由于本集团持有的央行票据减少所致。

	2009年12月31日		2008年12月31日	
	价值	占比(%)	价值	占比(%)
政府	46,802	23.4	43,895	20.3
中国人民银行	48,214	24.1	78,042	36.0
中央银行票据	29,780	14.9	32,627	15.1
同业及其它金融机构	28,598	14.3	25,057	11.6
公共实业界	5,730	2.8	8,281	3.8
其它	41,166	20.5	28,730	13.2
债券合计	200,290	100.0	216,632	100.0

单位:百万元人民币

	2009年12月31日		2008年12月31日	
	价值	占比(%)	价值	占比(%)
中国境内	169,065	84.4	167,862	77.5
中国境外	31,225	15.6	48,770	22.5
其中:香港	200,290	100.0	216,632	100.0

注:2009年数据未经本集团审计,2008年数据经本集团审计,并经过毕马威会计师事务所审计。

截至 2009 年 12 月 31 日本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

注:2009年数据未经本集团审计,2008年数据经本集团审计,并经过毕马威会计师事务所审计。

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	3.01%
债券 2	1,050	2013-4-8	2.74%
债券 3	1,000	2011-2-15	2.63%
债券 4	1,000	2014-5-21	2.74%
债券 5	920	2016-6-16	2.69%
债券 6	890	2010-5-6	2.98%
债券 7	796	2011-9-23	2.31%
债券 8	660	2010-4-4	3.11%
债券 9	552	2013-11-13	3.30%
债券 10	524	2011-7-4	3.19%
债券合计	10,002		

截至 2009 年 12 月 31 日,本集团持有重大金融债券投资明细情况:

债券名称	账面价值	到期日	年利率(%)
债券 1	2,650	2013-2-20	