

二银瑞信沪深300指数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

二〇一〇年十月



本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

4 投资研究
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

5 投资决策
投资决策委员会是基金投资决策的最高决策机构,决定基金总体投资策略和资产配置方案,审核基金经理提交的投资计划,提供投资建议,并审核其涉及基金投资管理的重要问题。

6 组合构建
基金经理根据投资决策委员会的决议,在符合法律法规的前提下,进行组合构建,并定期监控组合的合规性,并根据市场变化调整投资组合,进行投资组合的日常管理。

7 风险监控
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

8 基金的费用与税收
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

9 基金的投资业绩
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

10 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	4,313,405,688.90	93.83
2	固定收益投资	4,313,405,688.90	93.83
3	其中:债券	-	-
4	其中:股票	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他金融资产	-	-
7	合计	4,596,985,910.94	100.00

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

11 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	17,718,309.48	0.39
B	采掘业	463,280,251.81	10.12
C	制造业	1,269,793,463.48	27.74
D	食品饮料	194,408,756.01	4.25
E	纺织服装、皮革	18,666,087.00	0.41
F	医药、生物	205,824,984.74	4.56
G	信息技术	158,402,958.20	3.46
H	金融、房地产	141,658,904.61	3.09
I	公用事业	1,393,328,144.18	30.43
J	房地产业	238,943,547.28	5.22
K	其他服务业	39,443,130.00	0.86
L	传统制造业	9,860,114.60	0.22
M	综合类	80,700,973.88	1.76
	合计	4,313,405,688.90	93.83

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

12 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

13 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

14 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

15 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

16 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

17 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

18 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

19 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

20 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

21 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

22 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

23 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44
3	601318 中国平安	3,019,060.16	0.64
4	600016 民生银行	21,336,849.12	4.63
5	600030 中信证券	9,022,501.15	2.00
6	601166 兴业银行	4,408,978.10	0.96
7	600000 浦发银行	7,241,547.98	1.57
8	601088 中国神华	3,466,884.76	0.76
9	600161 中国石化	3,304,622.17	0.72
10	000020 万科A	10,175,958.48	2.24

注:上表中的权益投资占基金总资产净值的比例之和可能与100%存在尾差。

24 基金的投资组合
本基金管理人建立了规范的投资决策流程和严格的风险管理体系,贯彻于投资研究、投资决策、组合构建、交易执行、风险管理及绩效评价的全过程。

序号	股票名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036 招商银行	17,058,919.31	3.87
2	601328 交通银行	24,898,410.14	5.44