

# 建信优势动力股票型证券投资基金

## 招募说明书(更新)摘要

2009年第2号

### 基金管理人:建信基金管理有限责任公司 基金托管人:交通银行股份有限公司

二〇〇九年十月

**重要提示**

本基金经中国证券监督管理委员会2008年2月1日证监许可[2008]216号文核准募集。本基金的基金合同2008年3月19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。

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。

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份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

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,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因整体政治、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,由于本基金可能为暂时未达到上市条件而不能上市交易而产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特有风险,等等。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》正文。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

本招募说明书所载内容截止日为2009年9月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年6月30日(财务数据未经审计)。本招募说明书已经基金托管人复核。

**一、基金管理人**

(一)基金管理人概况

名称:建信基金管理有限责任公司

住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

设立日期:2005年9月19日

法定代表人:江先周

联系人:路彩营

电话:010-66288888

注册资本:人民币2亿元

建信基金管理有限责任公司经中国证监会证监基金字[2005]158号文批准设立。公司的股权结构如下:

股东名称	股权比例
中国建设银行股份有限公司	65%
招商证券股份有限公司	25%
中国华电集团公司	10%

本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的利益。股东会为公司权力机构,由全体股东组成,决定公司的经营方针以及选举和更换董事、监事等事宜。公司章程中明确规定公司股东依法行使权利,不得以任何形式直接或间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的执行机构,对股东会负责,并向股东会汇报。公司董事会由9名董事组成,其中3名为独立董事。根据公司章程的规定,董事会行使《公司法》规定的有关重大事项的决策权,对公司基本制度的制定和修订、总经理等高级管理人员的监督和奖惩。

公司监事会,由5名监事组成,其中包括2名职工代表监事。监事会向股东会负责,主要负责检查公司财务并监督公司董事、高级管理人员尽职情况。

公司日常经营管理由总经理负责。公司根据经营运作需要设置综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户管理部、市场推广部、人力资源部、基金运营部、信息技术部、风险管理部、监察稽核部15个部门,以及深圳、成都和北京分公司。此外,公司还设有投资决策委员会和风险管理委员会。

(二)主要人员情况

1、董事会成员

江先周先生,董事长。1986年获财政部财政科学研究所经济学硕士学位。1993年获英国Heriot-Watt大学商学国际银行金融学硕士学位。历任中国建设银行行长办公室副主任,中国建设银行国际业务处处长,中国建设银行行长办公室副主任,中国建设银行国际业务部副总经理,中国建设银行基金托管部总经理,中国建设银行基金托管部总经理兼人力资源部总经理,中国建设银行基金托管部总经理。

孙志晨先生,董事。1985年获东北财经大学经济学学士学位,2006年获长江商学院EMBA。历任中国建设银行资产托管部副处长,中国建设银行人力资源部副处长,中国建设银行个人银行业务部副总经理。

马辉女士,董事。现任中国建设银行个人金融业务部副总经理。1984年获中央财政金融学院学士学位。历任中国建设银行储蓄部证券处副处长,中国建设银行储蓄部市场部储蓄处处长,中国建设银行零售业务部自动服务处处长,中国建设银行个人银行业务部证券业务处处长,中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理兼证券处高级经理,中国建设银行个人金融业务部二级个人客户经理,中国建设银行个人金融业务部副总经理。

何斌先生,董事。现任中国建设银行财务会计部总经理助理。1992年获南京大学计算数学专业硕士学位。历任中国建设银行江苏分行泰州分行行政助理、副行长,中国建设银行财务会计部处长。

欧阳伯权先生,董事。现任信安国际(中国)亚洲区行政总裁。1977年获加拿大滑铁卢大学城市设计及环境规划学士学位。历任加拿大安泰保险公司管理级培训师,团体核保总监,美国友邦保险公司亚洲区团体保险部副经理,信安国际(中国)亚洲区行政总裁。

王曦先生,董事。现任中国华电集团公司财务(财务)公司党组书记、党组成员。1992年毕业于中国人民大学财政金融系,获学士学位;2000年湖南财经学院财务管理专业在职研究生毕业。2008年中央党校在职研究生毕业。历任中国华电电站装备工程(集团)公司财务处副处长,中国华电工程(集团)公司财务部主任,中国华电集团公司结算中心副主任,中国华电集团公司财务有限公司副总经理,中国华电集团公司金融管理部副主任,中国华电集团资本控股有限公司(财务)公司党组成员、常务副总经理。

顾建刚先生,独立董事。现任香港华建国际集团(中国)有限公司总经理。1984年毕业于工业大学管理工程学士学位。1991年获浙江大学经济系宏观经济专业硕士学位,1994年获财政部财科所研究生部财务管理博士学位。历任中国建设银行总行信托投资公司总助理兼财会部经理、中国建设银行总行财务会计部副总经理、香港华建国际集团(中国)副总经理。

关启昌先生,独立董事。现任MORRISON & Company Limited 总裁。1970年获新加坡大学会计学(荣誉)学士学位。并于1992年修完斯坦福大学行政人员课程。历任 Accountant General's Office, Singapore Government 会计师,Turquand Young, Chartered Accountants Hong Kong 核数师,Irish,Young & Outhwaite 核数师及 Beechwith Kwan & Company, Chartered Accountants Australia and Hong Kong 合伙人,美林证券总裁,协和集团董事兼总经理,Morrison & Co.LTD 总裁。

沈四宝先生,独立董事。现任对外经贸大学法学院院长。1981年获北京大学法律系国际经济法硕士学位。历任北京大学助教、对外经济贸易大学法学院院长。

2、监事会成员

冯丽英女士,监事会主席。现任中国建设银行监察稽核部总经理(部门总经理级)。历任中国建设银行人事处劳动工资处副处长、处长,中国国际金融有限公司人力资源部高级经理,中国信达资产管理公司人力资源部组织部副部长、副主任、薪酬委员会办公室主任,秦皇岛耀华国际浮法玻璃有限公司副董事长,宏源证券有限公司监事。

谭旭耀先生,监事。现任信安国际(中国)亚洲区财务分析专员,负责信安国际(中国)财务事务管理、信安亚洲区业务财务分析及预测、项目管理、资本计划、并购活动、策略分析、风险管理、精算事务等。

唐耀辉女士,监事。现任中国华电集团资本控股(财务)有限公司监察审计部经理。1994年获北京物资学院经济学学士学位,2007年获得清华-麦考尔大学应用金融硕士。历任中电联电力财金与经济发展研究中心职员、原电力工业部电力经济调节司科员,国家电网公司财务与资产管理部职员,中国华电集团公司结算中心副处长(主持工作),中国华电集团公司结算管理部副经理(主持工作),中国华电集团公司金融管理部副处长(主持工作),华电扬州发电有限公司副总经理(挂职银电)。

翟峰先生,职工监事。现任建信基金管理公司监察稽核部副总。1988年获得安徽省委党校师范学院文学学士学位,1990年获得上海复旦大学国际经济法专业法学学士学位。历任中国日报评论部记者,鲁普首钢矿股份有限公司内部审计部副主任,中国信达信托投资有限公司(原名为中国建设银行信托投资公司)证券发行部副总经理,宏源证券股份有限公司投资银行总部副总经理,上海永嘉投资管理有限公司执行董事、副总经理。

吴浩女士,职工监事。现任建信基金管理公司风险管理部总监。1992年毕业于南开大学金融系,1995年毕业于中国人民银行金融研究所研究生部。历任中国建设银行国际业务部外汇资金处主任科员,中国建设银行资金部交易风险管理部副处长,中国建设银行国际业务部交易风险管理处、综合处高级助理(主持工作)。

3、公司高管人员

孙志晨先生,总经理(简历请参见董事会成员)。

何斌先生,副总经理。1992年获东北财经大学计划统计学士学位。先后就职于北京市财政局、北京京都会计师事务所,中国证券监督管理委员会基金监管部、国泰基金管理公司(任副总经理),建信基金管理公司(任督察)。

徐军先生,副总经理。1990年获上海交通大学物理学学士学位,1995年获纽约哥伦比亚大学物理学博士学位。历任纽约E&S顾问公司高级分析师,巴黎百利银行投资和资产投资部副总裁、高级副经理和董事,泰信基金管理有限公司投资总监,信安国际第二副总裁和中国业务负责人。2005年9月建信基金管理公司,任总经理特别助理;2008年7月起,任建信基金管理公司副总经理。

张延明先生,副总经理。1993年获中国人民大学投资经济系学士学位,1997年获中国人民大学投资经济系硕士学位。先后供职于深圳市建设银行、中国建设银行,历任中国建设银行信贷管理部主任科员、中国建设银行行长办公室主任科员、副处长、处长。2006年11月加入建信基金管理公司,任总经理助理;2008年6月起任建信基金管理公司副总经理。

王新艳女士,总经理助理,CFA,中国人民银行研究生部硕士。1998年10月加入长盛基金管理公司,历任研究员、基金经理助理,2002年10月至2004年5月担任长盛成长价值股票型证券投资基金的基金经理,2004年6月加入景顺长城基金管理公司,历任基金经理、投资副总监、投资总监等职,于2005年3月16日至2009年3月17日期间担任景顺长城鼎益股票型证券投资基金LOF的基金经理,于2007年6月18日至2009年3月17日期间担任景顺长城精选蓝筹股票型证券投资基金的基金经理。2009年3月加入本公司,任总经理助理。

4、督察长

路彩营女士,督察长。1979年毕业于河北大学经济系计划统计专业。历任中国建设银行副主任科员、主任科员、副处长、处长,华夏证券部门副总经理,重庆审计特派办总助理,宝盈基金管理公司首席顾问(副总经理级),建信基金管理公司监事长。

5、本基金基金经理

徐杰女士,硕士。证券从业五年。1998年7月毕业于北京师范大学数学统计与概率专业,获理学学士学位。2003年7月毕业于中国人民大学数量经济学专业,获经济学硕士学位。2003年7月加入首创证券研究部任研究员。2005年11月加入建信基金管理公司,历任金融与房地产行业研究员、高级研究员、建信优化配置混合型证券投资基金基金经理助理,2008

年3月19日起任本基金基金经理。本基金基金经理自基金合同生效2008年3月19日至2009年8月31日为陈鹏、徐杰;2009年9月1日至今,本基金基金经理为徐杰。

6、投资决策委员会成员

孙志晨先生,总经理。

王新艳女士,总经理助理。

王加美先生,研究部总监。

汪沛先生,投资管理部副总监。

吴剑先生,投资管理部副总监。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

**二、基金托管人**

(一)基本情况

公司法定中文名称:交通银行股份有限公司(简称:交通银行)

公司法定英文名称: BANK OF COMMUNICATIONS CO., LTD

法定代表人:胡怀邦

住所:上海市浦东新区银城中路188号

邮政编码:200120

注册时间:1987年3月30日

注册资本:489.94亿元

基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]25号

联系人:张咏东

电话:021-68888917

交通银行始建于1908年,是中国历史最悠久的银行之一,也是近代中国发钞行之一。交通银行先后于2005年6月和2007年5月在香港联交所、上交所挂牌上市,是中国2010年上海世博会唯一的商业银行全球合作伙伴。根据英国《银行家》杂志2009年7月发布的全球1000家银行排名,交通银行总资产排名位列第56位,一级资本排名位列第49位。截止2009年6月末,交通银行总资产超过人民币3万亿元,2009年上半年实现净利润人民币155.79亿元。

交通银行总行设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行的从业经验,具备基金从业资格,以及经济师、会计师、工程师和律师等中高级专业技术职称,员工的学历层次较高,专业分布合理,职业技能优良,职业道德素质过硬,是一支业务素质娴熟、责任心强、爱岗敬业向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

李军先生,交通银行行长,华中理工大学经济学硕士,高级经济师。曾任交通银行武汉分行副总经理、行长,交通银行总稽核、董事、常务董事,执行董事、副行长;2006年9月担任交通银行副董事长、行长。

王滨先生,交通银行副行长,主管交通银行资产托管业务,南开大学经济学博士,高级经济师。曾任交通银行北京分行行长,交通银行天津分行行长,交通银行北京分行行长,2006年1月至今任交通银行副行长,党委委员兼北京分行党委书记。

谷耀步女士,交通银行资产托管部总经理,大学学历,经济师。曾任交通银行研究开发部主任科员,交通银行信託部代理业务处副处长,交通银行证券投资基金托管部规划处副处长,交通银行证券投资基金托管部内控处处长;2001年1月任交通银行证券投资基金托管部总经理助理,2002年5月起任交通银行资产托管部副总经理,2007年12月起任交通银行资产托管部总经理。

(三)基金托管业务经营情况

截止2009年6月末,交通银行共托管证券投资基金44只,包括博时现金收益货币、博时新兴成长股票、长城久富股票(LOF)、富国双兴封闭、富国天益价值股票、国泰金鹰增长股票、海富通精选混合、华安安顺封闭、华安宝利配置混合、华安策略优选股票、华安创新股票、华夏蓝筹混合(LOF)、华夏债券、汇丰晋信2016周期混合、汇丰晋信龙腾股票、汇丰晋信动态策略混合、汇丰晋信平稳增利债券、汇丰晋信大盘股票、建信优势动力封闭、金鹰红利价值混合、金鹰中小盘精选混合、大摩货币、银债恒久增利债券、鹏华行业成长股票、银华平衡双利混合、鹏华普惠封闭、鹏华普天收益混合、鹏华普天债券、鹏华中国50混合、融通行业景气混合、泰达荷银成长股票、泰达荷银风险预算混合、泰达荷银稳定股票、泰达荷银周期股票、天治先行先锋股票、天治核心双策略(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达瑞福封闭、易方达上证50指数、易方达科讯股票、银河银富货币、银华货币、中海优质成长混合。此外,还托管了全国社会保险基金、保险专户、企业年金、QDII、QDII、信托计划、证券公司集合资产管理计划、ABS、产业基金、资产管理等12类产品,托管资产规模超过五千亿元。

**三、相关服务机构**

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

名称:建信基金管理有限责任公司

住所:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

办公地址:北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心16层

法定代表人:江先周

联系人:孙桂东

电话:010-66282800

2、场内代销机构

指具有基金代销业务资格,并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

3、场外代销机构

中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼1号楼(长安兴融中心)

法定代表人:姜宝清

客服电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

交通银行股份有限公司

住所:北京市东城区朝门内大街66号A座

办公地址:北京市东城区朝门内大街66号A座

法定代表人:刘红涛

联系人:秦莉

客服电话:010-65541405

客服电话:95558

网址:www.95559.com.cn

中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街55号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号

法定代表人:姜宝清

客服电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

中国工商银行股份有限公司

住所:北京市东城区朝门内大街66号A座

办公地址:北京市东城区朝门内大街66号A座

法定代表人:刘红涛

联系人:秦莉

客服电话:010-65541405

客服电话:95558

网址:www.95559.com.cn

目前,该基金处于封闭期,不存在代销与申购的事宜,本基金只能在交易所买卖。本基金场内交易机构是指深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的深圳证券交易所会员单位,具体名单详见深圳证券交易所网站(www.szse.cn)。

(二)注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

地址:中国北京西城区金融大街27号投资广场22-23层

法定代表人:陈耀先

联系人:朱立元

电话:010) 58598839

传真:010) 58598907

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市锦天律师事务所律师

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室 邮编:200120

办公地址:上海市浦东新区202号晋华永道中心11楼

法定代表人:杨继祥

联系人:单峰

联系电话:021-61238888

传真:021-61238800

经办注册会计师:许康玮 单峰

**四、基金的名称**

本基金名称:建信优势动力股票型证券投资基金。

**五、基金的类型**

股票型证券投资基金

**六、基金的投资目标**

采取定量和定性相结合的方法,寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力,而且价值被低估的优势上市公司,通过投资组合的动态调整来分散和控制风险,在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产获取超额收益。

**七、基金的投资方向**

建信优势动力股票型证券投资基金的投资限于国内依法发行上市,的股票、权证、债券、资产支持证券及中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。

**八、基金的投资策略**

本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人将对经济环境、市场状况、行业特征等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析,作出投资决策,具体包括以下几个方面:

1、资产配置策略

本基金自基金合同生效之日起6个月内,使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。在此基础上,本基金管理人将综合运用定性分析和定量分析手段,对大类资产进行合理配置。

本基金管理人将以大类资产的预期收益率、风险水平和它们之间的相关性为出发点,对于可能影响资产预期风险、收益率和相关性的因素进行综合分析和动态跟踪,据此制定本基金在股票、债券和货币市场工具等大类资产之间的配置比例、调整原则和调整范围,并进行定期或不定期的调整,以达到控制风险、增加收益的目的。

本基金进行资产配置时所参考的主要指标包括国内生产总值(GDP)增长率、货币供应量及其变化、利率水平及其预期变化、通货膨胀率、货币与财政政策、汇率政策等。

除基本面因素以外,基金管理人还将关注其他可能影响资产预期收益与风险水平的因素,观察市场信心指标、行业动能指标等,力争捕捉市场由于低效或失衡而产生的投资机会。通常情况下,基金管理人会根据市场变化,以研究结果为依据对当前资产配置进行评估并作必要调整。在特殊情况下,亦可针对市场突发事件等在本基金投资范围及各类资产配置比例限制范围内进行及时调仓。

2、股票投资策略

股票投资策略可以分为行业配置和个股选择两个层面。

①行业配置

基金管理人将对宏观经济形势与政策、行业景气程度、拟投资上市公司代表性等方面进行研究,以此为基础,以投资业绩比较基准中各个行业的权重为参照,进行行业配置决策。

各行业之间的预期风险、风险及其相关性仍然是制定行业配置决策时的根本因素,因而基金管理人将围绕那些对它们产生重大影响的因素或指标展开,主要包括各行业竞争结构、行业成长空间、行业周期性及景气程度、行业主要产品或服务的供需情况、拟投资上市公司代表性、行业整体估值水平等等。

通过对上述因素或指标的综合评估,基金管理人定期确定各行业的配置水平,并据此对股票投资组合的行业配置进行调整。如果发生重大事件,基金管理人亦可在本基金投资范围内对行业配置进行及时调整。

②股票选择

本基金管理人通过对宏观经济、行业、子行业、上市公司的详细分析来选择具备良好内生性成长或外延式扩张动力,而且价值被低估的优势上市公司。

内生性成长等方面重点关注上市公司的产品或服务的供需情况、竞争结构以及公司的管理和成长水平等因素,所依据的指标主要是上市公司的净资产收益率(ROE)。

外延式扩张动力方面主要考虑上市公司整体上、大股东资产注入的可能性以及公司的并购价值整合前景等,将重点关注上市公司和关联方的优质资产状况和扩张战略等因素,所依据的指标主要是上市公司每股收益(EPS)的预期增长幅度。

在具备良好内生性成长或外延式扩张动力的备选股票构成的股票池基础上,本基金管理人将通过绝对估值与相对估值,结合上市公司的成长性对其股票的内在价值进行判断并与当前股价进行比较,对股票的投资价值做出判断。所依据的指标包括上市公司未来预期利润水平、预期市盈率水平等等。

本基金管理人“成长与价值相结合”的选股原则,即选择具有良好内生性成长或外延式扩张动力,而且价值被低估的优势上市公司进行投资。同时,投资业绩比较基准中的股票将是本基金重点关注对象。

3、债券投资策略

本基金债券投资策略主要包括债券投资组合策略和个券选择策略。

①债券投资组合策略

本基金在综合分析宏观经济和货币政策的基础上,采用久期控制下的主动性投资策略,并本着风险收益配比最优、兼顾流动性的原则确定债券各类属资产的投资比例。

在债券组合的具体构造和调整上,本基金综合运用久期调整、收益率曲线形变预测、信用利差管理、回购套利等组合手段进行日常管理。

②个券选择策略

在个券选择上,本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估个券的风险收益。

具有以下一项或多项特征的债券,将是本基金重点关注的对象:

- ①有较高信用等级的债券;
- ②在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下,到期收益率较高的债券;
- ③有良好流动性的债券;
- ④风险水平合理、有效下行保护的债券。

本基金将通过对标证券的股票基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,综合运用杠杆策略、价值挖掘策略、获利保护策略、价差策略、双向权证策略、卖空保护性的认购权证策略、买入保护性的认沽权证策略等策略获取权证投资收益。

5、资产支持证券投资策略

本基金将深入研究资产支持证券中资产的情况以及发行主体的资信,认真分析相关证券的基础,综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等级分析、流动性评估等方法来评估资产支持证券的风险收益。重点关注具有以下一项或多项特征的产品:

- ①有较高信用等级;
- ②在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下,收益率较高;
- ③风险水平合理,有较好下行保护。

**九、基金的投资比较基准**

本基金投资业绩比较基准为:90%×沪深300指数收益率+10%×中国债券总指数收益率。

**十、基金的风险收益特征**

本基金属于股票型证券投资基金,一般情况下其风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,属于较高风险收益特征证券投资基金品种。

**十一、基金的投资组合报告**

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责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2009年7月15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、误导性陈述或重大遗漏。

本投资组合报告所载数据为2009年4月1日至2009年6月30日,本报告所列财务数据未经审计。

(一)报告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	权益投资	3,487,378,664.74	91.13
2	固定收益投资	3,487,378,664.74	91.13
	其中:债券	--	--
	资产支持证券	--	--
3	金融衍生品投资	--	--
4	买入返售金融资产	--	--
	其中:买入返售金融资产	--	--
5	银行存款和结算备付金合计	277,220,998.56	7.24
6	其他资产	62,015,177.89	1.62
	合计	3,826,614,841.19	100.00

本报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农林、牧、渔业	--	--
B	采掘业	319,636,242.59	8.50
C	制造业	1,145,915,855.97	30.47
D0	食品、饮料	245,091,957.91	6.52
D1	纺织、服装	--	--
D2	木材、家具	--	--
D3	造纸、印刷	28,839,942.32	0.77
D4	石油、化学、塑胶、塑料	116,660,185.49	3.09
D5	金属、非金属	--	--
D6	金属、非金属	259,706,736.45	6.90
D7	机械、设备、仪表	287,366,120.01	7.64
D8	医药、生物制品	208,809,913.79	5.55
D9	其他制造业	--	--
D	电力、煤气及水的生产和供应业	--	--
E	建筑业	--	--
F	交通运输、仓储业	--	--
G	信息技术业	182,755,407.00	4.86
H	批发和零售贸易	275,683,008.78	7.33
I	金融、保险业	847,405,624.07	22.53
J	房地产业	471,954,953.51	12.55
K	社会服务业	41,800,000.00	1.11
L	传播与文化产业	28,899,841.05	0.77
M	综合类	173,327,731.77	4.61
	合计	3,487,378,664.74	92.72

本报告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投资明细

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	600036	招商银行	8,999,949	201,688,857.09	5.36
2	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
3	601318	中国平安	4,000,000	148,380,000.00	3.95
4	000083	西山煤电	3,026,644	120,396,655.60	3.20
5	600000	浦发银行	5,000,000	115,100,000.00	3.06
6	000001	深发展A	5,227,898	114,072,734.36	3.03
7	601899	紫金矿业	10,599,941	108,119,398.20	2.87
8	000540	中天城投	10,905,147	106,547,566.56	2.88
9	000092	华鲁恒泰	11,499,920	85,214,420.20	2.27
10	600519	贵州茅台	55,000	81,405,500.00	2.16

(二)前十名基金重仓持有的债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
2	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
3	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
4	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
5	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
6	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
7	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
8	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
9	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41
10	000002	万科A	13,000,000	165,750,000.00	4.41

(三)其他费用

按照国家有关规定和基金合同约定,基金管理人可以在基金财产中列支其他的费用,并按照国家有关法律法规的规定进行公告或说明。

**十四、对招募说明书更新部分的情况**

1、更新了“四、基金管理人”的“基金管理人概况”以及基金经理变更相关情况;

2、更新了“四、基金托管人”的基本情况及相关业务经营情况;

3、更新了“五、基金的投资”中的“基金的投资组合报告”;

4、更新了“十一、基金的投资”;</