

申万巴黎新经济混合型证券投资基金 2010年半年度报告摘要

基金管理人:申万巴黎基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一〇年八月二十七日

1 重要提示

本基金管理人谨将本报告所载资料作客观陈述,不构成任何投资建议,并不对其内容的真实性、准确性和完整性作任何保证。本半年度报告已经过会计师事务所审计,并由会计师事务所出具了标准无保留意见的审计报告。本半年度报告所载资料均来源于基金管理人内部,并由基金管理人负责。基金托管人对本中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年08月18日复核了本中国工商银行的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,投资者投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应请仔细阅读本报告正文。本报告中财务资料未经审计。本报告日期为2010年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	申万巴黎新经济混合
基金代码	310358
交易代码	310358
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2006年12月6日
基金管理人	申万巴黎基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,397,977,954.30份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于受益于社会和经济发展的具有成长性且估值合理的上市公司股票,在有效控制风险和保持基金资产良好流动性的前提下,保持基金资产的持续增值,为投资者获取超越业绩基准的收益。
投资策略	本基金遵循资产配置管理人擅长的双轮驱动的资产配置策略,“自上而下”地进行资产配置,并采用主动资产配置策略结合市场情况对行业数据进行进一步资产配置,重点投资于固定收益类资产和具有良好成长性的股票资产。在股票的基本分析、社会和经济形势综合评估、对上市公司财务状况和经营业绩等方面进行综合评价,并跟踪股票的市场价格表现,选择估值合理、成长性良好且估值合理的股票,并采用分散化投资组合策略,严格控制投资组合的仓位,保持投资组合的流动性。
业绩比较基准	新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%
风险收益特征	本基金是一只进行主动投资的股票型证券投资基金,其风险和预期收益均高于平衡型基金,属于证券投资基金中的中高风险品种。本基金通过资产配置,精选个股投资策略,有效控制投资组合的风险,力争实现基金资产的长期增值。

2.3 基金管理人及基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	申万巴黎基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
姓名	宋丙寅	郭阳云
联系电话	021-23211188	010-66105799
电子邮箱	service@swpp.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	400808588	95588
传真	021-23261199	010-66105798

2.4 信息披露方式

基金半年度报告正文的披露互联网网址: <http://www.swpp.com>
申万巴黎基金官方网站: <http://www.swpp.com>

3 主要财务数据和财务指标

3.1 主要财务数据和财务指标

项目	报告期末(2010年6月30日)	本报告期末比上年末增减
本期已实现收益	-207,686,852.88	-
本期利润	-1,195,408,706.08	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1819	-
基金份额净值增长率	-23.71%	-
期末基金份额总额	6,397,977,954.30	1,115,749.58
期末可供分配基金份额总额	6,397,977,954.30	1,115,749.58
期末基金资产净值	3,781,577,962.19	1,115,749.58
期末基金份额净值	0.5911	0.0002

3.2 基金净值表现

注:1.本基金采用收益法计算基金净值增长率,投资收益包括:通过公允价值变动收益扣除相关费用后的余额,本期利润为本基金已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金净值指标已扣除了基金的管理费、托管费和其他各项费用,但不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如:申购费、赎回费等)计入认购或交易基金的各项费用后,实际收益水平要低于所列数据。

3.3 基金业绩比较基准

3.3.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去一个月	-8.21%	1.69%	-9.90%
过去三个月	-19.58%	1.79%	-21.37%
过去六个月	-23.71%	1.53%	-25.24%
过去一年	-16.05%	1.79%	-17.84%
过去三年	-19.66%	1.88%	-21.54%
基金成立以来至今	37.83%	1.92%	35.91%

注:本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

注:本基金净值增长率以基金份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2006年12月6日至2010年6月30日

注:根据本基金合同约定,本基金股票资产投资比例不低于基金资产的45%至95%,一般情况下为80%至95%,当基金管理人通过评估认为市场下跌时,可下调股票资产投资比例至45%以上;当基金资产净值比例不低于基金资产的45%至95%时,基金管理人可根据市场情况调整股票资产投资比例,但基金资产净值比例不低于基金资产的45%以上,通常情况下为5%至20%,其中现金类及货币市场工具与基金资产的5%以上,上述投资比例限制在基金合同生效后6个月起生效,基金合同生效后6个月时,本基金已达到上述比例限制。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经营情况

4.1.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.1.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.2 基金管理人及基金经营情况

4.2.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.2.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3.3.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.3.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.3.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3.3.3.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.3.3.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率

benchmark (t) = 0.85 * benchmark (t-1) + 0.15 * 金融同业存款利率

其中 t=1,2,3,...

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3 基金管理人及基金经营情况

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.1 基金管理人及基金经营情况
申万巴黎基金管理有限公司由中国工商银行股份有限公司和中国工商银行资产管理有限责任公司共同发起,由一家中法合资基金管理公司,公司成立于2004年1月15日,注册地在上海,注册资本为1.5亿元人民币,其中,申万巴黎资产管理股份有限公司持有67%的股权,法国巴黎资产管理持有33%的股权。

公司成立以来业务增长迅速,在北京、广州等地建立了分公司,截至2010年6月30日,公司旗下管理了1只股票型、混合型基金,债券型、货币型证券投资基金和9只开放式基金,形成了完善而丰富的产品线。公司旗下基金管理资产规模超过100亿元,客户数量超过170万户。

4.3.3.3.3.3.3.3.3.3.2 基金经营业绩

本基金的业绩比较基准为新华华时A200指数收益率*85%+金融同业存款利率*15%,其中,新华华时A200指数作为衡量股票投资部分的业绩基准,金融同业存款利率作为衡量非股票投资部分的业绩基准。

作为专项指标而提供的指数,新华华时指数体系具有一定的优势和影响力;新华华时指数体系,新华华时A200指数的市场代表性较强,比较适合作为股票投资的比较基准。而本基金在一般情况下主要投资于股票投资,在股票资产上进行持续投资以跟踪指数的特定投资证券,故业绩比较基准和利率组合作为本基金的业绩比较基准。

本基金的业绩基准按照线性回归方法进行计算,计算方式如下:

benchmark (t) = 0.85 * 新华华时A200指数 + 0.15 * 金融同业存款利率