建信优势动力股票型证券投资基金

招募说明书(更新)摘要

2010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

二〇一〇年十月

【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,由于本基金可能因为暂时未达到上市条件而不能上市交易所产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险,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2010年9月18日,有关财务数据和净值表现截止日为2010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:010-66228888
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%
美国信安金融服务公司	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。公司章程中明确公司股东通过股东会依法行使权利,不以任何形式直接或者间接干预公司的经营管理和基金资产的投资运作。

董事会为公司的决策机构,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权和对总经理等经营管理人员的监督和奖惩权。

公司设监事会,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、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、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、北京和上海分公司。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大学商学院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处长,中国建设银行国际业务部处长,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机构业务部总经理,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。历任中国建设银行筹资部证券处副处长,中国建设银行筹资部、零售业务部证券处处长,中国建设银行个人银行业务部副总经理。

马梅琴女士,董事,现任中国建设银行个人存款与投资部副总经理。1984年获中央财政金融学院学士学位。历任中国建设银行筹资储蓄部证券处副处长、中国建设银行筹资储蓄部外币储蓄处处长、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。

俞斌先生,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长助理、副行长,中国建设银行财务会计部处长。

欧阳伯权先生,董事,现任美国信安金融集团总裁—亚洲。1977年获加拿大滑铁卢大学城市设计及环境规划系学士学位。历任加拿大安泰保险公司管理级培训员、团体核保总监,美国友邦保险公司亚洲区团体保险部副总裁,信安国际有限公司亚洲区行政总裁。

殷红军先生,董事,现任中国华电集团资本控股有限公司副总经理、党组成员。1995年毕业于山东省教育学院数学系,获学士学位;1998年毕业于首都经济贸易大学经济信息系,获硕士学位。历任中国电力财务公司债券基金部项目经理、华电集团财务有限公司投资咨询部副经理(主持工作)、中国华电集团公司改制重组办公室、体制改革办公室一处副处长、中国华电集团公司体制改革办公室一处、体制改革处处长、中国华电集团公司政策与法律事务部政策研究处处长。顾建国先生,独立董事,现任香港华建国际集团公司总经理。1984年获浙江工业大学管理工程学学士学位,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学博士学位。历任中国建设银行总行信托投资公司总裁助理兼财会部经理、中国建设银行总行会计部副总经理、香港华建国际集团公司总经理。

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、Bechwith 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学硕士学位。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,现任中国建设银行人力资源部副总经理(部门总经理级)。历任中国建设银行人事部劳动工资处副处长、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,现任信安国际公司亚洲区财务分析专员,负责信安亚洲区营运公司财务事务管理、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。

唐湘辉女士,监事,现任中国华电集团资本控股有限公司金融管理部经理。1994年获北京物资学院经济学学士,2007年获得清华-麦考瑞大学应用金融硕士。历任中电联电力财会与经济发展研究中心职员、原电力工业部经济调节司科员、国家电力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)、中国华电集团财务有限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处长(主持工作)、华电扬州发电有限公司副总经理(挂职锻炼)。

翟峰先生,职工监事,现任建信基金管理有限责任公司监察稽核部总监。1988年获得安徽省安庆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,秘鲁首钢铁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。

吴洁女士,职工监事,现任建信基金管理有限责任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处副处长、中国建设银行资金部交易风险管理处、综合处高级副经理(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系学士学位。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)、建信基金管理有限责任公司(任督察长)。

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集团、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有限责任公司,任总经理助理;2008年6月起任副总经理。

王新艳女士,副总经理。注册金融分析师(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16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16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,2010年5月起任副总经理。2009年12月17日起任建信恒久价值股票型证券投资基金的基金经理;2010年4月27日起任建信核心精选股票型证券投资基金的基金经理。

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,宝盈基金管理公司首席顾问(公司副总经理级),建信基金管理有限责任公司监事长。

5、本基金基金经理

徐杰女士,硕士,证券从业七年。1998年7月毕业于北京师范大学数学系统计与概率专业,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有限责任公司,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。

历任基金经理:
自基金合同生效2008年3月19日至2009年8月31日:陈鹏、徐杰;
2009年9月1日至今: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,副总经理。
汪沛先生,投资管理部总监。
梁洪昀先生,投资管理部副总监。
卓利伟先生,建信恒久价值股票型证券投资基金基金经理。

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
办公地址:上海市仙霞路18号
邮政编码:200336
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:021-32169999

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》杂志公布的2009年全球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2010年6月末,交通银行资产总额超过人民币3.7万亿元,2010年上半年实现净利润人民币203.57亿元。

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,是一支诚实勤勉、积极进取、开拓创新、奋发向上的资产托管从业人员队伍。

(二)主要人员情况

牛锡明先生,交通银行行长,哈尔滨工业大学经济学硕士,高级经济师。2009年12月起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副行长、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。

谷娜莎女士,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、交通银行信托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巡查处处长;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2010年6月末,交通银行共托管证券投资基金49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)、富国汉兴封闭、富国天益价值股票、光大保德信中小盘股票、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、汇丰晋信低碳先锋股票、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、农银恒久增利债券、农银行业成长股票、农银平衡双利混合、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、鹏华信用增利债券、融通行业景气混合、泰达宏利成长股票、泰达宏利风险预算混合、泰达宏利稳定股票、泰达宏利周期股票、天治创新先锋股票、天治核心成长股票(LOF)、万家公用事业行业股票(LOF)、易方达科汇灵活配置混合、易方达科瑞封闭、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、兴业磐稳增利债券、华富中证100指数。此外,还托管了全国社会保障基金、保险资产、企业年金、QFII、QDII、信托计划、证券公司集合资产计划、ABS、产业基金、专户理财等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:010-66228800

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

(1)中国建设银行股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼(长安兴融中心)
法定代表人:郭树清
客服电话:95533
网址:www.ccb.com

(2)交通银行股份有限公司
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:胡怀邦
客服电话:95559
网址:www.95559.com.cn

(3)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:姜建清
客服电话:95588
网址:www.icbc.com.cn

(4)中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人:孔丹
联系人:秦莉
联系电话:010-65541405
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

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交易。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
住所:北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人:金颖
办公地址:北京西城区金融大街27号投资广场23层
电话:(010)58598839
传真:(010)58598907

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:北京市德恒律师事务所
住所:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座12层
负责人:王丽
联系人:徐建军
电话:010-66575888
传真:010-65232181
经办律师:徐建军、李晓明

(四)审计基金资产的会计师事务所

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(邮编:200120)
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:杨绍信
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,通过对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来获取超额收益。

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。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性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、行业动量指标等,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,基金管理人会定期根据市场变化,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整。

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。

各行业之间的预期收益、风险及其相关性仍然是制定行业配置决策时的根本因素,因而基金管理人的研究将围绕着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。

内生性成长动力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治理水平等因素,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市、大股东资产注入的可能性以及公司的并购价值和整合前景等,将重点关注上市公司和其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。

本基金奉行"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的对象。

3、债券投资策略

本基金的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配置比例。

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、回购套利等组合管理手段进行日常管理。

(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、有较好下行保护的债券。

4、权证投资策略

本基金将通过对权证标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

本基金将仔细研究资产支持证券池中资产的情况以及发行主体的资信,认真分析相关证券的结构,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、基金的业绩比较基准

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的证券投资基金品种。

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2010年7月19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。

本投资组合报告所载数据为2010年4月1日至2010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	2,695,936,476.55	70.45
	其中:股票	2,695,936,476.55	70.45
2	固定收益投资	-	-
	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	830,751,395.38	21.71
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	297,290,695.37	7.77
6	其他资产	2,935,899.79	0.08
	合 计	3,826,914,467.09	100.00

(二)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	192,910,814.76	5.07
C	制造业	1,122,437,099.83	29.53
C0	食品、饮料	356,787,745.54	9.39
C1	纺织、服装、皮毛	149,467,200.00	3.93
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	41,470,807.68	1.09
C4	石油、化学、塑胶、塑料	42,292,926.50	1.11
C5	电子	35,215,286.95	0.93
C6	金属、非金属	8,064,516.10	0.21
C7	机械、设备、仪表	240,131,675.62	6.32
C8	医药、生物制品	249,006,941.44	6.55
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	69,577,710.40	1.83
F	交通运输、仓储业	56,539,989.72	1.49
G	信息技术业	104,020,603.40	2.74
H	批发和零售贸易	274,617,228.06	7.22
I	金融、保险业	731,669,377.31	19.25
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	86,666,531.25	2.28
L	传播与文化产业	3,494,421.00	0.09
M	综合类	54,002,700.82	1.42
	合 计	2,695,936,476.55	70.92

(三)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	000001	深发展A	11,599,829	201,837,024.60	5.31
2	601318	中国平安	3,799,993	169,289,688.15	4.45
3	002029	七匹狼	4,982,240	149,467,200.00	3.93
4	000538	云南白药	2,299,475	148,316,137.50	3.90
5	600887	伊利股份	4,899,793	143,955,918.34	3.79
6	601601	中国太保	6,249,928	142,310,860.56	3.74
7	600036	招商银行	10,260,400	133,487,804.00	3.51
8	601989	中国重工	15,883,632	99,113,863.68	2.61
9	600559	老白干酒	4,043,524	96,721,094.08	2.54
10	000729	燕京啤酒	4,533,356	89,760,448.80	2.36

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

(五)报告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明细

本基金本报告期末未持有债券。

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1、本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

3、其他资产的构成

序号	名 称	金 额(元)
1	存出保证金	2,343,895.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	363,917.16
4	应收利息	228,086.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合 计	2,935,899.79

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000001	深发展A	201,837,024.60	5.31	筹划重大资产重组事项
2	601318	中国平安	169,289,688.15	4.45	筹划重大资产重组事项
3	601989	中国重工	99,113,863.68	2.61	筹划重大资产重组事项

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2010年6月30日。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。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。

1、本报告期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	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2008年3月19日—2008年12月31日	-42.80%	2.08%	-47.00%	2.78%	4.20%	-0.70%
2009年1月1日—2009年12月31日	63.64%	1.69%	84.49%	1.85%	-20.85%	-0.16%
2010年1月1日—2010年6月30日	-12.50%	1.19%	-25.54%	1.43%	13.04%	-0.24%
自基金合同生效2008年3月19日-2010年6月30日	-18.10%	1.76%	-27.19%	2.17%	9.09%	-0.41%

2、自基金合同生效以来基金份额净值及其业绩比较基准的变动情况

建信优势动力股票型证券投资基金
累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2008年3月19日至2010年6月30日)

注:1、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。因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资不符合基金合同约定的投资比例规定的,基金管理人应当在10个工作日内进行调整。

2、本基金的投资范围为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。其中,股票投资比例范围为基金资产的60%-100%,权证投资比例范围为基金资产净值的0-3%。固定收益类证券和现金投资比例范围为基金资产的0-40%,其中,资产支持证券投资比例范围为基金资产净值的0-20%,现金和到期日在一年以内的政府债券等短期金融工具的比例最低可以为0。

3、本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

十三、基金的费用概览

(一)与基金运作有关的费用

1、基金费用的种类

(1)基金管理人的管理费(包括业绩报酬);
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金上市费用;
(4)基金的证券交易费用;
(5)基金合同生效以后的信息披露费用;
(6)基金份额持有人大会费用;
(7)基金合同生效以后的会计师费和律师费;
(8)按照国家有关规定可以列入的其他费用。

2、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

(1)基金管理费

本基金上市交易前的基金管理费按前一日的基金资产净值的1%的年费率计提,计算方法如下:

$H=E×1\%÷当年天数$

H为每日应付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值。

本基金上市交易后的基金管理费按前一日的基金资产净值的1.25%的年费率计提,计算方法如下:

$H=E×1.25\%÷当年天数$

H为每日应付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值。

基金管理人的管理费逐日计提,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,基金托管人复核确认后于次月首日起15个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(2)业绩报酬

基金合同生效后第二个自然年起,基金管理人可在同时满足以下条件的前提下,按当年的年平均基金资产净值提取0.5%的业绩报酬:

①从年初到年底的基金份额净值增长率超过同期业绩比较基准收益率。
②从年初到年底的基金份额净值增长率超过同期一年期定期存款收益率+6%。
③年底时基金份额累计净值不得低于基金份额初始面值。
④未发生基金转换运作方式。
⑤符合基金收益分配条件或者其它法定要求。

基金份额净值增长率、同期业绩比较基准收益率根据中国证监会的证券投资基金信息披露编报规则第1号《主要财务指标的计算及披露》和证券投资基金信息披露编报规则第2号《基金净值表现的编制及披露》进行计算。

如果同期一年期定期存款利率发生变化,则按时间段计算累计收益率。假设在一年里面的前X1天一年期定期存款利率为Y1,接下去X2天一年期定期存款利率为Y2,以此类推,在后面剩余XN天一年期定期存款利率为YN,则该年一年期定期存款的收益率=(1+Y1/360)^X1×(1+Y2/360)^X2×……×(1+YN/360)^XN-1。

年平均基金资产净值计算方法如下:

F为年平均基金资产净值
Ei为每个证券交易所交易日的基金资产净值
N为每年的证券交易所交易日的天数。

基金管理人业绩报酬于每个基金会计年度结束后当日进行计算,由基金管理人计算并计提,基金托管人复核确认。如果能够提取业绩报酬,则基金管理人业绩报酬方案由基金管理人于次个基金会计年度第5个工作日公告,并在公开披露日报中国证监会备案。基金管理人业绩报酬于次个基金会计年度第10个工作日从基金资产中一次性支付给基金管理人。

(3)基金托管费

基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下:

$H=E×0.25\%÷当年天数$

H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,基金托管人复核后于次月首日起15个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。

本节第1条基金费用的种类中第(3)至第(7)项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用。

(二)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效之前的律师费、会计师费和信息披露费用等不得从基金财产中列支。

(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,并按照相关的法律法规的规定进行公告或备案。

十四、对招募说明书更新部分的说明

1、更新了"三、基金管理人"的"基金管理人概况"以及投资决策委员会成员变更信息;
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"十、基金的投资"中的"基金的投资组合报告";
4、更新了"十一、基金的业绩";
5、更新了"二十二、基金份额持有人的服务"的相关内容;
6、更新了"二十三、其他应披露事项",列示了本期基金刊登的相关临时公告。

建信基金管理有限责任公司
二〇一〇年十月三十日

(上接B10版)

七、基金的投资方向

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具。主要包括国内依法公开发售上市的股票、债券、短期金融工具、资产支持证券、权证以及经中国证监会批准的允许基金投资的其他金融工具。股票投资范围为所有在国内依法发售的,具有良好流动性的A股。债券投资的主要品种包括交易所和银行间两个市场的国债、金融债、企业债与可转换债,债券投资的品种与短期金融工具投资的品种不重叠。短期金融工具则包括到期日在一年以内的债券、债券回购、央行票据、各类银行存款等;经证监会、人民银行等有关部门批准后本基金还可以投资于商业票据等流动性良好的投资品种。

基金的投资范围限制为股票45%~75%、债券5%~35%、短期金融工具5%~35%、资产支持证券0~20%、权证0~3%。保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。具体配置比例由基金管理人根据对市场走势的判断做主动调整,以求基金财产在三类资产的投资中达到风险和收益的最佳平衡,但比例不超出上述限定范围。在法律法规有新规定的情况下,基金管理人可对上述比例做适度调整。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

(一)资产配置策略

本基金采取自上而下与自下而上相结合的主动管理,遵循积极主动的投资理念,依据国家有关法律、法规和基金合同的规定、宏观经济环境、国家政策和市场周期分析以及行业景气状况和上市公司基本面分析,对股票和债券、短期金融工具的比例进行动态调整。长期而言,基金将以宏观经济总体分析和市场周期分析为依据,根据产品定位,通过资产类别收益风险预测体系来调整资产配置。短期内,本基金将基于经济结构调整过程中政策、法规的相关变化,把握市场时机同时兼顾市场资金和结构的变化情况进行主动修正、调整资产配置,同时充分利用短期金融工具,作为动态资产配置的有效缓冲及收益补充。

(二)股票投资策略

依据基本面驱动资产定价理念,对公司的基本面进行深入分析,发掘公司基本面的投资价值。从公司的行业属性、核心竞争力、发展战略、财务状况、管理层等基本面因素入手,定量及定性相结合地分析公司盈利的持续性及增长情况,选择盈利稳定增长或具有高速增长潜力,同时价格未反映其价值的公司,构建股票资产组合。

1、行业评价

综合分析宏观经济、政策因素、周期因素等的影响,定性评价行业景气状况,进行上市公司行业成长性的预测;并对上市公司行业的成长性指标、价值性指标和市场表现指标进行综合评价,形成行业投资价值评价。通过重点研究重新进行上市公司行业成长性的预测,纵向和横向的对比行业上市公司整体的价格水平,进一步调整和优化行业评价结果,形成行业配置建议。

2、股票筛选

通过风险股剔除、流动性筛选、价值指标筛选剔除掉明显不具有投资价值的股票,并根据公司的财务数据、成长性预测数据,以及赢利能力、管理层素质、资本结构等因素,以定量与定性相结合的方法,筛选出进行重点研究的股票。

3、重点研究精选

通过对公司经营战略、技术状况、扩张能力、产品结构、生命周期、销售渠道等因素以及市值规模、市场比价指标(B/P, E/P, S/P等)、市场动量(Momentum)等指标的重点研究,筛选出具有投资价值的股票构成备选股票池。

根据重点研究的结果对公司进行财务分析和成长性预测,选择适当的方法进行估值,纵向和横向地对比上市公司的价格水平,总结投资要点与风险,给出投资建议,确定精选个股,建立股票目标组合。

(三)债券投资策略

债券投资管理的目标在于保持投资组合稳定收益和充分流动性的前提下,追求基金资产的长期增值。债券投资的构建将通过全面的宏观、市场和品种的研究分析,在各种定量辅助手段的支持下综合运用利率预测、价值评估、利率期限结构分析等投资策略,积极主动地预期市场变化,寻求各种市场机会,获得超过市场水平的平均收益。

1、宏观及利率分析

主要通过基准利率分析预测未来基准利率水平变化趋势与幅度,进行定量评价;通过利率期限结构分析,利用即期利率结构曲线构造技术和基准利率水平及变化趋势分析结果,预测未来利率期限结构曲线变化状况。

2、细化市场分析

统计分析各债券子市场的规模以及今后的发展趋势,密切关注市场的容量及交易方式变化趋势,结合利率水平及变化趋势、利率期限结构曲线分析结果,预测未来债券市场在各个层面的变化状况,进行短期的跨市场套利操作,并进行套期保值、放大杠杆提高收益以及无风险现金套利投资业务。

(四)短期金融工具投资策略

结合货币市场利率的预测与现金需求安排,采取现金流管理策略进行短期货币工具投资,以便在保证基金资产的安全性和流动性的基础上,获得较高的收益。重要策略包括:1、宏观分析:影响利率走势的主要因素;期限结构下影响短期利率走势的主要因素。2、政策分析:财政部新发债券对短期利率走势的影响因素;央行票据发行对短期利率走势的影响因素;财政部和央行、银监会的政策调控对短期利率走势的影响因素。3、资金面分析:市场资金面测算;现金管理。4、交易方式:短期金融工具品种和流动性选择;控制风险和杠杆放大。

(五)权证投资策略

在有效进行风险管理的前提下,通过对权证标的证券的基本面研究,结合多种期权定价模型,在确定权证合理价值的基础上,以主动投资为主,结合资产和组合特性,谨慎进行权证投资。

主要投资策略包括但不限于:1、在标的证券价值和趋势判断的基础上,利用权证的杠杆性进行趋势投资。2、利用权证的损失有限性,运用权证作为组合管理工具。3、运用权证组合技术,构建新的投资回报模式。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:

60%×中信标普300指数+20%×中信全债指数+20%×一年期定期存款利率

考虑到本基金的投资理念、风格和投资方向等因素,选取具有一定市场代表性的中信标普300指数、中信全债指数、一年定期存款利率作为业绩比较基准。

将来如有更合适的指数推出,基金管理人可以根据本基金的投资范围和投资策略,确定变更基金的比较基准或其权重构成。业绩比较基准的变更需履行相关程序后,经基金管理人公告,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

追求资产配置动态平衡、收益和长期资本增值平衡,风险适中。

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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2010年7月19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。

本投资组合报告所载数据截至2010年6月30日,本报告中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	875,434,173.56	58.19
	其中:股票	875,434,173.56	58.19
2	固定收益投资	518,119,818.50	34.44
	其中:债券	518,119,818.50	34.44
	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:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	103,825,451.77	6.90
6	其他各项资产	7,062,394.14	0.47
7	合计	1,504,441,837.97	100.00

(二)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	18,660,000.00	1.26
B	采掘业	90,715,815.54	6.11
C	制造业	326,895,434.92	22.01
C0	食品、饮料	99,743,041.50	6.72
C1	纺织、服装、皮毛	7,619,984.76	0.51
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	53,675,000.00	3.61
C4	石油、化学、塑胶、塑料	35,998,552.40	2.42
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	6,600,000.00	0.44
C7	机械、设备、仪表	118,066,856.26	7.95
C8	医药、生物制品	5,192,000.00	0.35
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	60,475,866.27	4.07
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	16,339,460.78	1.10
G	信息技术业	26,526,302.60	1.79
H	批发和零售贸易	54,906,750.89	3.70
I	金融、保险业	265,355,087.16	17.87
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	15,559,455.40	1.05
M	综合类	-	-
	合计	875,434,173.56	58.94

(三)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	601398	工商银行	19,000,483	77,141,960.98	5.19
2	601328	交通银行	10,357,075	62,246,020.75	4.19
3	600505	西昌电力	6,803,190	55,241,902.80	3.72
4	600069	银鸽投资	9,500,000	53,675,000.00	3.61
5	600489	中金黄金	999,919	51,655,815.54	3.48
6	600348	国阳新能	3,000,000	39,060,000.00	2.63
7	601939	建设银行	8,000,000	37,600,000.00	2.53
8	600000	浦发银行	2,729,910	37,126,776.00	2.50
9	601106	中国一重	6,000,000	32,220,000.00	2.17
10	600887	伊利股份	1,042,600	30,631,588.00	2.06

(四)报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	26,013,043.40	1.75
2	央行票据	347,029,000.00	23.36
3	金融债券	83,088,000.00	5.59
	其中:政策性金融债	83,088,000.00	5.59
4	企业债券	40,355,775.10	2.72
5	企业短期融资券	-	-
6	可转债	21,634,000.00	1.46
7	其他	-	-
8	合计	518,119,818.50	34.88

(五)报告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明细

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	1001037	10央行票据37	1,000,000	100,080,000.00	6.74
2	1001042	10央行票据42	1,000,000	100,000,000.00	6.73
3	1001021	10央行票据21	800,000	78,272,000.00	5.27
4	0901048	09央行票据48	700,000	68,677,000.00	4.62
5	080202	08国开02	500,000	52,665,000.00	3.55

(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

(七)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

(八)投资组合报告附注

1、报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的。

2、基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

3、其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,760,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	9,220.50
4	应收利息	5,276,909.54
5	应收申购款	16,264.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,062,394.14

4、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	125709	唐钢转债	21,634,000.00	1.46

5、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

6、投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

十二、基金的业绩

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资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

阶 段	基金净值增长率①	基金净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2004年3月15日至2004年12月31日	-5.46%	0.54%	-14.73%	0.78%	9.27%	-0.24%
2005年1月1日至2005年12月31日	2.67%	0.85%	-2.24%	0.80%	4.91%	0.05%
2006年1月1日至2006年12月31日	96.59%	0.99%	63.98%	0.84%	32.61%	0.15%
2007年1月1日至2007年12月31日	111.18%	1.65%	81.70%	1.37%	29.48%	0.28%
2008年1月1日至2008年12月31日	-42.27%	1.79%	-43.49%	1.80%	1.22%	-0.01%
2009年1月1日至2009年12月31日	63.14%	1.35%	51.91%	1.22%	11.23%	0.13%
2010年1月1日至2010年6月30日	-12.05%	0.91%	-16.51%	0.95%	4.46%	-0.04%

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用

与基金运作有关的费用包括:基金管理人的管理费;基金托管人的托管费;基金合同生效后的基金信息披露费用;基金合同生效后的与基金相关的会计师费和律师费;基金份额持有人大会费用;基金的证券交易费用;以及其它按照国家有关规定可以在基金资产中列支的其它费用。

1、基金管理费

本基金管理费按本基金前一日资产净值乘以1.5%管理费年费率来计算,计算方法如下:

每日应付的基金管理费=前一日本基金的资产净值×1.5%÷当年实际天数

基金管理费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

2、基金托管费

本基金托管费按本基金前一日资产净值乘以0.25%托管费年费率来计算,计算方法如下:

每日应付的基金托管费=前一日本基金资产净值×0.25%÷当年实际天数

基金托管费每日计提,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送划付指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日等,支付日期顺延。

(二)与基金销售有关的费用

1、基金的申购费与赎回费

(1)本基金申购费率不超过申购金额的1.5%,具体费率如下:

费用项	单笔金额	申购费率标准
申购费	100万元以下	1.5%
	100万元以上(含100万元)-200万元以下	1.2%
	200万元以上(含200万元)-500万元以下	0.8%
	500万元以上(含500万元)	每笔500元

(2)本基金赎回费率不超过赎回金额的0.5%,赎回费率随赎回基金份额持有年份的增加而递减,具体费率如下:

持有期限	一年以内	(含)满一年不满二年	(含)满二年不满三年	(含)三年以上
赎回费率	0.5%	0.35%	0.2%	0

(3)本基金的申购费用由基金申购人承担,归基金管理人及代销机构所有,主要用于本基金的市场推广、销售等各项费用。基金赎回费用由基金赎回人承担,赎回费将按照赎回当时适用的费率收取,所收取赎回费的25%归入基金资产,其余部分作为登记结算费和其他手续费支出。

(4)基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整申购和赎回费率,调整后的申购费率和赎回费率在最新的招募说明书(更新)中列示。上述费率如发生变更,基金管理人应最迟于新的费率实施前3个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

(5)基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划,针对特定地域范围、特定行业、特定职业的投资者以及以特定交易方式(如网上交易等)等定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,按相关监管部门要求履行相关手续后,基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调整基金申购费率和基金赎回费率,并在至少一种中国证监会指定媒体予以公告。

2、申购份额、赎回金额与基金份额净值的计算

(1)申购份额的计算

申购费用适用比例费率时,申购份额的计算方法如下:

净申购金额=申购金额/(1+申购费率)
申购费用=申购金额-净申购金额
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

申购费用为固定金额时,申购份额的计算方法如下:

申购费用=固定金额
净申购金额=申购金额-申购费用
申购份额=净申购金额/T日基金份额净值

例一:假定T日的基金份额净值为1.200元,若三笔申购金额分别为1,000元、100万元、200万元,则各笔申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购1	申购2	申购3
申购金额(元,A)	1,000.00	1,000,000.00	2,000,000.00
适用申购费率(B)	1.5%	1.2%	0.8%
净申购金额(C=A/(1+B))	985.22	988,142.29	1,984,126.98
申购费用(D=A-C)	14.78	11,857.71	15,873.02
申购份额(E=C/1.200)	821.02	823,451.91	1,653,439.15

若申购金额为500万元,则申购负担的申购费用和获得的基金份额计算如下:

	申购4
申购金额(元,A)	5,000,000.00
申购费用(B)	500.00
净申购金额(C=A-B)	4,999,500.00
申购份额(D=C/1.200)	4,166,250.00

(2)赎回金额的计算

赎回费=赎回当日本基金份额净值×赎回份额×赎回费率
赎回金额=赎回当日本基金份额净值×赎回份额-赎回费

例二:某投资者赎回本基金10,000份,持有期为6个月,赎回费率为0.5%,假设赎回当日该基金份额净值为1.100元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费=1.100×10,000×0.5%=55.00元
赎回金额=1.100×10,000-55=10,945.00元

(3)基金份额资产净值的计算公式

T日基金份额净值=T日闭市后的基金资产净值/T日基金份额的余额数量

T日的基金份额净值在当天收市后计算,并在T+1日内公告。遇特殊情况,可以适当延迟计算或公告基金份额净值,并报中国证监会备案。

十四、对招募说明书更新部分的说明

华夏经典配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《华夏经典配置混合型证券投资基金基金合同》及其他法律法规的要求,对本基金管理人于2010年4月29日刊登的本基金招募说明书(更新)进行了更新,主要更新内容如下:

(一)更新了"二、释义"相关内容。
(二)更新了"三、基金管理人"相关内容。
(三)更新了"四、基金托管人"相关内容。
(四)更新了"五、相关服务机构"相关信息。
(五)更新了"九、基金份额的申购与赎回"相关内容。
(六)更新了"十、基金的非交易过户与转托管等业务"相关内容。
(七)更新了"十一、基金的投资"中投资组合报告部分,该部分均按有关规定编制。
(八)更新了"十二、基金的业绩",该部分内容均按有关规定编制,并经托管人复核。
(九)更新了"二十二、基金托管协议的内容摘要"相关内容。
(十)更新了"二十三、对基金份额持有人的服务"相关内容。
(十一)更新了"二十四、其他应披露事项",披露了自上次招募说明书更新截止日以来涉及本基金的相关公告。

华夏基金管理有限公司
二〇一〇年十月三十日