

(上海) 国信证券
 公司网站: www.guosen.com.cn
60 铭称: 南京证券股份有限公司
 住所: 江苏省南京市大钟亭8号
 联系人: 张华东
 联系人: 徐朝晖
 电话: 025-83367888-4201
 传真: 025-83362066
 客服电话: 4008235888
 公司网站: www.njzq.com.cn
61 铭称: 华融证券股份有限公司
 住所: 北京市西城区金融大街8号
 办公地址: 北京市西城区金融大街8号A座三层、五层
 法定代表人: 丁祖诰
 联系人: 潘福生
 电话: 010-58568040
 传真: 010-58568040
 客服电话: 010-58581118
 公司网站: www.hrsec.com.cn
62 铭称: 浙商证券股份有限公司
 注册地址: 杭州市中大街1号
 办公地址: 杭州市中大街1号黄龙世纪广场A区6-7层
 法定代表人: 吴圣斌
 电话: 0571-87901033
 传真: 0571-87901119
 客服电话: 0571-967777
 公司网站: www.stocke.com.cn
63 铭称: 西南证券股份有限公司
 住所: 重庆市南岸区海棠溪2号合国际大厦A幢
 办公地址: 重庆市中区临江支路2号合国际大厦A幢
 法定代表人: 王珠林
 联系人: 高建斌
 电话: 023-63786464
 传真: 023-63786311
 客服电话: 4008-096-096
 公司网站: www.swsec.com.cn
64 铭称: 信达证券股份有限公司
 注册地址: 河北省石家庄市自强路35号
 办公地址: 河北省石家庄市自强路35号庄家金融大厦24层
 法定代表人: 高冠斌
 联系人: 刘亚静
 电话: 0311-66006093
 传真: 0311-66006093
 客服电话: 400-612-8888
 公司网站: www.xindasecurities.com.cn
65 铭称: 五矿证券有限公司
 注册地址: 云南省昆明市北京路155号附1号虹塔大厦9楼
 办公地址: 云南省昆明市北京路155号附1号虹塔大厦9楼
 法定代表人: 祝雨村
 电话: 0871-3577398
 传真: 0871-3578827
 公司网站: www.wmgzq.com.cn
66 铭称: 国金证券股份有限公司
 注册地址: 成都市东城根上街15号
 办公地址: 成都市东城根上街95号
 法定代表人: 冉云
 联系人: 冉云
 电话: 028-86690126
 传真: 028-86690129
 客服电话: 4006010109
 公司网站: www.guosen.com.cn
67 铭称: 中天证券股份有限公司
 注册地址: 辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
 办公地址: 辽宁省沈阳市和平区光荣街23甲
 法定代表人: 李秀华
 联系人: 李秀华
 电话: 024-23266917
 传真: 024-2327498
 客服电话: 400-6180-315
 公司网站: www.stockera.com.cn
68 铭称: 国联证券股份有限公司
 注册地址: 江苏省无锡市太湖新城14号
 办公地址: 江苏省无锡市太湖新城14号
 法定代表人: 徐朝晖
 联系人: 李秀华
 电话: 400-8888-929
 传真: 010-64408820
 客服电话: 400-6180-315
 公司网站: www.guosen.com.cn
69 铭称: 新时代证券股份有限公司
 注册地址: 北京市西城区金融大街14号A座三层
 办公地址: 北京市西城区金融大街14号A座三层
 法定代表人: 周志林
 联系人: 徐朝晖
 电话: 010-83514494
 传真: 010-83561094
 网站: www.xdsd.com.cn
70 铭称: 日信证券有限责任公司
 注册地址: 呼和浩特市新城区林荫路18号
 办公地址: 呼和浩特市新城区林荫路18号
 法定代表人: 孔佑宏
 联系人: 陈书彬
 电话: 010-88068630-730
 101-88068630-737
 客服电话: 010-64412537
 网站: www.rbxz.com.cn
 客服电话: 010-88068630
 公司网站: www.rbxz.com.cn
 名称: 广东证券股份有限公司
 住所: 广东省珠海市拱北情侣南路255号4层
 办公地址: 广州市天河区德信路1号保利国际广场南塔31-33楼
 法定代表人: 王志伟
 联系人: 李尔华
 电话: 020-80899120
 传真: 020-80899175
 (三) 出具法律意见书的律师事务所
 名称: 国浩律师集团(广州)事务所
 住所: 广东省广州市体育西路189号城建大厦9楼
 负责人: 程秉
 电话: 020-38799345
 传真: 020-38799335
 经办律师: 程秉、郭小英
 联系人: 程秉

(四) 审计基金资产的会计师事务所
 名称: 德勤华永会计师事务所有限公司
 办公地址: 上海市延安东路222号外滩中心30楼
 法人代表: 卢伯毅
 联系人: 胡小敏
 电话: 021-61418888
 传真: 021-63300003
 经办注册会计师: 胡小敏、洪洪明

四、基金名称
五、基金的类型
 契约型开放式

六、基金的投资目标
 依托中国经济快速发展的宏观经济和高成长性的资本市场,通过适时调整价值类和成长类股票的配置比例和股票精选,寻求基金资产长期增值。

七、基金的投资方向
 股票、债券、权证和中国证监会允许基金投资的其他金融工具,其中股票配置比例为60-95%,债券比例0-35%,现金或者到期日在一年以内的政府债券大于等于5%,权证等新的金融工具在法律允许范围内进行投资,不得投资于基金合同约定的范围之外。

八、基金的投资策略
 本基金将股票资产分为价值类股票和成长类股票两类风格资产,在两类资产中运用不同的方法分别筛选具有投资价值股票,同时保持两类资产的适当均衡配置,构建股票投资组合。

九、资产配置策略
 1. 大类资产配置策略
 本基金根据宏观经济、政策等因素和市场波动周期的判断进行相应的仓位调整决策。

十、风险控制措施
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

十一、基金的费用
 (一) 基金费用的种类
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;
 4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所和律师费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 银行汇兑费用;
 8. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

十二、基金的信息披露
 1. 基金年度报告: 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 2. 基金中期报告: 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 3. 基金季度报告: 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 4. 基金净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位净值和基金份额净值。
 5. 基金申购赎回价格: 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位申购赎回价格和基金份额申购赎回价格。
 6. 基金资产净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金资产净值和基金份额净值。
 7. 基金定期报告: 基金管理人应当在每个会计年度结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 8. 基金临时报告: 基金管理人应当在重大事件发生之日起二个工作日内,编制完成基金临时报告,将临时报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 9. 基金清算报告: 基金合同终止时,基金管理人应当立即组织清算,并编制基金清算报告,将清算报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。

十三、基金的风险控制
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

十四、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

十五、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

十六、基金的风险收益特征
 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十七、基金的投资范围
 本基金的投资范围为: 具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

十八、基金的投资策略
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在资产配置、行业配置、个股选择三个层面进行投资。

十九、基金的投资流程
 1. 投资决策委员会: 负责制定基金投资的大类资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略。
 2. 基金经理: 根据投资决策委员会的授权,负责基金投资组合的构建和调整。
 3. 研究员: 负责提供宏观经济、行业、个股的研究支持。
 4. 交易部: 负责执行基金经理的投资指令,确保交易的安全、准确、及时。

二十、基金的投资业绩
 截至2011年12月31日,本基金业绩如下:
 净值增长率: 1.948,146.597,0.12
 业绩比较基准: 1.948,146.597,0.12

二十一、基金的投资风险
 1. 市场风险: 基金资产投资于股票,其价值会因股市价格波动而受到影响。
 2. 信用风险: 基金资产投资于债券,其价值会因债券发行人违约而受到影响。
 3. 流动性风险: 基金资产投资于流动性较差的资产,可能导致无法及时变现。
 4. 操作风险: 基金管理人内部控制系统不完善,可能导致操作失误。

二十二、基金的投资费用
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;
 4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所和律师费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 银行汇兑费用;
 8. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

二十三、基金的信息披露
 1. 基金年度报告: 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 2. 基金中期报告: 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 3. 基金季度报告: 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 4. 基金净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位净值和基金份额净值。
 5. 基金申购赎回价格: 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位申购赎回价格和基金份额申购赎回价格。
 6. 基金资产净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金资产净值和基金份额净值。
 7. 基金定期报告: 基金管理人应当在每个会计年度结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 8. 基金临时报告: 基金管理人应当在重大事件发生之日起二个工作日内,编制完成基金临时报告,将临时报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 9. 基金清算报告: 基金合同终止时,基金管理人应当立即组织清算,并编制基金清算报告,将清算报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。

二十四、基金的风险控制
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

二十五、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

二十六、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

二十七、基金的风险收益特征
 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

二十八、基金的投资范围
 本基金的投资范围为: 具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

二十九、基金的投资策略
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在资产配置、行业配置、个股选择三个层面进行投资。

三十、基金的投资流程
 1. 投资决策委员会: 负责制定基金投资的大类资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略。
 2. 基金经理: 根据投资决策委员会的授权,负责基金投资组合的构建和调整。
 3. 研究员: 负责提供宏观经济、行业、个股的研究支持。
 4. 交易部: 负责执行基金经理的投资指令,确保交易的安全、准确、及时。

三十一、基金的投资业绩
 截至2011年12月31日,本基金业绩如下:
 净值增长率: 1.948,146.597,0.12
 业绩比较基准: 1.948,146.597,0.12

三十二、基金的投资风险
 1. 市场风险: 基金资产投资于股票,其价值会因股市价格波动而受到影响。
 2. 信用风险: 基金资产投资于债券,其价值会因债券发行人违约而受到影响。
 3. 流动性风险: 基金资产投资于流动性较差的资产,可能导致无法及时变现。
 4. 操作风险: 基金管理人内部控制系统不完善,可能导致操作失误。

三十三、基金的投资费用
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;
 4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所和律师费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 银行汇兑费用;
 8. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

三十四、基金的信息披露
 1. 基金年度报告: 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 2. 基金中期报告: 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 3. 基金季度报告: 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 4. 基金净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位净值和基金份额净值。
 5. 基金申购赎回价格: 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位申购赎回价格和基金份额申购赎回价格。
 6. 基金资产净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金资产净值和基金份额净值。
 7. 基金定期报告: 基金管理人应当在每个会计年度结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 8. 基金临时报告: 基金管理人应当在重大事件发生之日起二个工作日内,编制完成基金临时报告,将临时报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 9. 基金清算报告: 基金合同终止时,基金管理人应当立即组织清算,并编制基金清算报告,将清算报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。

三十五、基金的风险控制
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

三十六、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

三十七、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

三十八、基金的风险收益特征
 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

三十九、基金的投资范围
 本基金的投资范围为: 具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

四十、基金的投资策略
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在资产配置、行业配置、个股选择三个层面进行投资。

四十一、基金的投资流程
 1. 投资决策委员会: 负责制定基金投资的大类资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略。
 2. 基金经理: 根据投资决策委员会的授权,负责基金投资组合的构建和调整。
 3. 研究员: 负责提供宏观经济、行业、个股的研究支持。
 4. 交易部: 负责执行基金经理的投资指令,确保交易的安全、准确、及时。

四十二、基金的投资业绩
 截至2011年12月31日,本基金业绩如下:
 净值增长率: 1.948,146.597,0.12
 业绩比较基准: 1.948,146.597,0.12

四十三、基金的投资风险
 1. 市场风险: 基金资产投资于股票,其价值会因股市价格波动而受到影响。
 2. 信用风险: 基金资产投资于债券,其价值会因债券发行人违约而受到影响。
 3. 流动性风险: 基金资产投资于流动性较差的资产,可能导致无法及时变现。
 4. 操作风险: 基金管理人内部控制系统不完善,可能导致操作失误。

四十四、基金的投资费用
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;
 4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所和律师费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 银行汇兑费用;
 8. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

四十五、基金的信息披露
 1. 基金年度报告: 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 2. 基金中期报告: 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 3. 基金季度报告: 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 4. 基金净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位净值和基金份额净值。
 5. 基金申购赎回价格: 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位申购赎回价格和基金份额申购赎回价格。
 6. 基金资产净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金资产净值和基金份额净值。
 7. 基金定期报告: 基金管理人应当在每个会计年度结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 8. 基金临时报告: 基金管理人应当在重大事件发生之日起二个工作日内,编制完成基金临时报告,将临时报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 9. 基金清算报告: 基金合同终止时,基金管理人应当立即组织清算,并编制基金清算报告,将清算报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。

四十六、基金的风险控制
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

四十七、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

四十八、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

二十九、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

三十、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

三十一、基金的风险收益特征
 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

三十二、基金的投资范围
 本基金的投资范围为: 具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

三十三、基金的投资策略
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在资产配置、行业配置、个股选择三个层面进行投资。

三十四、基金的投资流程
 1. 投资决策委员会: 负责制定基金投资的大类资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略。
 2. 基金经理: 根据投资决策委员会的授权,负责基金投资组合的构建和调整。
 3. 研究员: 负责提供宏观经济、行业、个股的研究支持。
 4. 交易部: 负责执行基金经理的投资指令,确保交易的安全、准确、及时。

三十五、基金的投资业绩
 截至2011年12月31日,本基金业绩如下:
 净值增长率: 1.948,146.597,0.12
 业绩比较基准: 1.948,146.597,0.12

三十六、基金的投资风险
 1. 市场风险: 基金资产投资于股票,其价值会因股市价格波动而受到影响。
 2. 信用风险: 基金资产投资于债券,其价值会因债券发行人违约而受到影响。
 3. 流动性风险: 基金资产投资于流动性较差的资产,可能导致无法及时变现。
 4. 操作风险: 基金管理人内部控制系统不完善,可能导致操作失误。

三十七、基金的投资费用
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;
 4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所和律师费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 银行汇兑费用;
 8. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

三十八、基金的信息披露
 1. 基金年度报告: 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 2. 基金中期报告: 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 3. 基金季度报告: 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 4. 基金净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位净值和基金份额净值。
 5. 基金申购赎回价格: 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位申购赎回价格和基金份额申购赎回价格。
 6. 基金资产净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金资产净值和基金份额净值。
 7. 基金定期报告: 基金管理人应当在每个会计年度结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 8. 基金临时报告: 基金管理人应当在重大事件发生之日起二个工作日内,编制完成基金临时报告,将临时报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 9. 基金清算报告: 基金合同终止时,基金管理人应当立即组织清算,并编制基金清算报告,将清算报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。

三十九、基金的风险控制
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

四十、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

四十一、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

四十二、基金的风险收益特征
 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

四十三、基金的投资范围
 本基金的投资范围为: 具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

四十四、基金的投资策略
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在资产配置、行业配置、个股选择三个层面进行投资。

四十五、基金的投资流程
 1. 投资决策委员会: 负责制定基金投资的大类资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略。
 2. 基金经理: 根据投资决策委员会的授权,负责基金投资组合的构建和调整。
 3. 研究员: 负责提供宏观经济、行业、个股的研究支持。
 4. 交易部: 负责执行基金经理的投资指令,确保交易的安全、准确、及时。

四十六、基金的投资业绩
 截至2011年12月31日,本基金业绩如下:
 净值增长率: 1.948,146.597,0.12
 业绩比较基准: 1.948,146.597,0.12

四十七、基金的投资风险
 1. 市场风险: 基金资产投资于股票,其价值会因股市价格波动而受到影响。
 2. 信用风险: 基金资产投资于债券,其价值会因债券发行人违约而受到影响。
 3. 流动性风险: 基金资产投资于流动性较差的资产,可能导致无法及时变现。
 4. 操作风险: 基金管理人内部控制系统不完善,可能导致操作失误。

四十八、基金的投资费用
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;
 4. 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所和律师费;
 5. 基金份额持有人大会费用;
 6. 基金的证券交易费用;
 7. 银行汇兑费用;
 8. 按照国家有关规定和基金合同约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

四十九、基金的信息披露
 1. 基金年度报告: 基金管理人应当在每年结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 2. 基金中期报告: 基金管理人应当在上半年结束之日起两个月内,编制完成基金中期报告,将中期报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 3. 基金季度报告: 基金管理人应当在每个季度结束之日起十五个工作日内,编制完成基金季度报告,将季度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 4. 基金净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位净值和基金份额净值。
 5. 基金申购赎回价格: 基金管理人应当在每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金单位申购赎回价格和基金份额申购赎回价格。
 6. 基金资产净值公告: 基金管理人应当在不晚于每个开放日的次日,通过指定网站、基金销售机构网站或营业网点,披露前一开放日的基金资产净值和基金份额净值。
 7. 基金定期报告: 基金管理人应当在每个会计年度结束之日起三个月内,编制完成基金年度报告,将年度报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 8. 基金临时报告: 基金管理人应当在重大事件发生之日起二个工作日内,编制完成基金临时报告,将临时报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。
 9. 基金清算报告: 基金合同终止时,基金管理人应当立即组织清算,并编制基金清算报告,将清算报告正本报中国证监会备案,并同时在指定网站上披露。

五十、基金的风险控制
 1. 估值风险控制
 本基金管理人定期对估值方法进行合理性分析,在估值系统中找到基本数据源,及时更新估值数据,确保估值准确性。

五十一、基金的投资组合
 截至2011年12月31日,本基金投资组合如下:
 股票: 18,441,186.419,89.10
 债券: 18,441,186.419,89.10
 其他: 0.000,0.00

五十二、基金业绩比较基准
 本基金业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

五十三、基金的风险收益特征
 本基金为股票型基金,其预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

五十四、基金的投资范围
 本基金的投资范围为: 具有良好流动性的金融工具,包括股票、债券、权证、货币市场工具、资产支持证券、股指期货、国债期货等。

五十五、基金的投资策略
 本基金采用自上而下和自下而上相结合的投资策略,在资产配置、行业配置、个股选择三个层面进行投资。

五十六、基金的投资流程
 1. 投资决策委员会: 负责制定基金投资的大类资产配置策略、行业配置策略、个股选择策略。
 2. 基金经理: 根据投资决策委员会的授权,负责基金投资组合的构建和调整。
 3. 研究员: 负责提供宏观经济、行业、个股的研究支持。
 4. 交易部: 负责执行基金经理的投资指令,确保交易的安全、准确、及时。

五十七、基金的投资业绩
 截至2011年12月31日,本基金业绩如下:
 净值增长率: 1.948,146.597,0.12
 业绩比较基准: 1.948,146.597,0.12

五十八、基金的投资风险
 1. 市场风险: 基金资产投资于股票,其价值会因股市价格波动而受到影响。
 2. 信用风险: 基金资产投资于债券,其价值会因债券发行人违约而受到影响。
 3. 流动性风险: 基金资产投资于流动性较差的资产,可能导致无法及时变现。
 4. 操作风险: 基金管理人内部控制系统不完善,可能导致操作失误。

五十九、基金的投资费用
 1. 基金管理人的管理费;
 2. 基金托管人的托管费;
 3. 基金合同生效后基金的基金信息披露费用;<