海富通中小盘股票型证券投资基金更新招募说明书摘要

（2012年第2号）

基金管理人：海富通基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

海富通中小盘股票型证券投资基金（以下简称“本基金”）经2010年1月18日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】83号文核准募集。本基金的基金合同于2010年4月14日正式生效。本基金类型为契约型开放式。

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《基金法》、《运作办法》、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。

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。当投资者赎回时，所得或会高于或低于投资者先前所支付的金额。

基金的过往业绩并不预示其未来表现。基金管理人所管理的其它基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。投资有风险，投资者在申购本基金时应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2012年10月14日，有关财务数据和净值表现截止日为2012年9月30日。

本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：邵国有

成立时间：2003年4月18日

电话：021-38650999

联系人：包瑾

注册资本：1.5亿元人民币

股权结构：海通证券股份有限公司51%、法国巴黎投资管理BE控股公司49%。

（二）主要人员情况

邵国有先生，董事长，副教授。历任吉林大学校党委副书记、长春师范学院校党委书记、长春新世纪广场有限公司副董事长兼总经理、海通证券股份有限公司宣传培训中心总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事长。

吉宇光先生，董事，硕士，高级经济师。历任交通银行北京分行办公室副主任、交通银行北京分行证券部经理、海通证券北京朗家园营业部总经理等职。1997年至今任海通证券股份有限公司副总裁。

艾德加（Stewart Edgar）先生，董事，英国籍，学士。历任英国Ivory & Sime公共有限公司基金经理，美国Fiduciary国际信托公司研究部主任、高级副总裁，英国HD国际有限公司高级基金经理、董事，美国F&C管理公司高级基金经理、董事，比利时富通基金管理公司董事总经理，法国巴黎投资管理公司亚太区董事总经理。

田仁灿先生，董事、总经理，比利时籍，工商管理硕士。历任法国金融租赁Euroequipement S.A.公司总裁助理，富通银行区域经理、大中华地区主管，富通基金管理亚洲有限公司投资经理、业务发展部总经理、首席执行官。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、总经理。

张文伟先生，董事、副总经理，硕士，高级经济师。历任交通银行郑州分行铁道支行行长、紫荆山支行行长、私人金融处处长，海通证券办公室主任，海通证券投资银行总部副总经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司董事、副总经理。

郑国汉先生，独立董事，经济学硕士及博士学位。历任美国佛罗里达州大学经济系副教授、香港科技大学经济系教授、香港科技大学商学院经济系教授及系主任和商学院副院长，现任商学院院长及经济系讲座教授。

巴约特（Marc Bayot）先生，独立董事，比利时籍，布鲁塞尔大学工商管理硕士。布鲁塞尔大学经济学荣誉教授，Pionner投资公司独立副董事长、Fundconnect独立董事长、Degroof资产管理公司独立董事和法国巴黎银行B Flexible SICAV独立董事。

杨国平先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任上海杨树浦煤气厂党委副书记、代书记，上海市公用事业管理局党办副主任，上海市出租汽车公司党委书记，现任大众交通（集团）股份有限公司董事长兼总经理、上海大众公用事业（集团）股份有限公司董事长、上海交大昂立股份有限公司董事长。

王明权先生，独立董事，硕士，高级经济师。历任武汉市人民政府副市长、交通银行行长、党委（组）书记、副董事长、中国光大（集团）总公司董事长、党委书记。现任全国人大代表、全国人大财经委员会委员。

李磊前先生，监事长，经济学硕士，高级经济师。历任安徽省财政厅中企处副主任科员，安徽省国有资产管理局科长，海通证券计划财务部副总经理、总经理和财务总监。

谷若鸿（Mr. Laurent couraudon）先生，法国籍，国际贸易硕士。历任法国巴黎银行瑞士日内瓦分行商品及贸易融资部高级客户经理，法国巴黎银行莫斯科代表处能源及商品融资首席代表，法国外贸银行莫斯科分行董事及企业金融部主管，法国巴黎银行俄罗斯分行业务拓展主管，法国巴黎银行莫斯科分行首席执行官兼俄罗斯区总裁，现任法国巴黎银行（中国）有限公司董事会主席兼中国区总裁。

奚万荣先生，监事，经济学硕士。中国注册会计师协会非执业会员。历任海南省建行秀英分行会计主管、海通证券股份有限公司监察稽核部稽核员。2003年4月至今任海富通基金管理有限公司稽核经理、监察稽核总监。

章明女士，督察长，硕士。历任加拿大BBCC Tech & Trade Int'l Inc公司高级财务经理、加拿大Future Electronics公司产品专家，国信证券业务经理和副高级研究员，海通证券股份有限公司对外合作部经理。2003年至今任海富通基金管理有限公司督察长。

陈洪先生，副总经理，硕士。历任君安证券有限公司投资经理、广东发展银行深圳分行业务经理、富通基金管理亚洲有限公司基金经理。2003年4月至今任海富通精选混合基金经理，2003年4月至2012年9月任海富通基金管理有限公司投资总监，2005年7月至2006年9月任海富通股票基金经理，2006年3月至9月任海富通收益增长混合基金经理，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理，2007年2月至2007年8月任海富通风格优势股票基金经理，2007年4月至2007年8月任海富通精选贰号混合基金经理，2008年6月至2011年2月任海富通中国海外股票（QDII）基金经理。

阎小庆先生，副总经理，硕士。历任中国人民银行上海分行助理经济师、富通银行欧洲管理实习生、法国东方汇理银行市场部副经理、法国农业信贷银行上海华东区首席代表、富通基金管理公司上海代表处首席代表、海富通基金管理有限公司市场总监，2006年5月起，任海富通基金管理有限公司副总经理。

程崇先生，基金经理，硕士，CFA。历任金信管理研究公司研究所研究员，国金证券研究所研究员，曾当选《新财富》2005年度最佳行业分析师。2006年7月加入海富通基金管理有限公司，历任股票分析师、非公募股票组合投资经理。2010年4月起任海富通中小盘股票基金经理。

投资决策委员会常设委员有：田仁灿，总经理；陈洪，副总经理；戴德舜，投资总监；蒋征，股票相对收益组合部总监；丁俊，研究总监；邵佳民，固定收益组合管理部总监；杜晓海，定量及风险管理总监。投资决策委员会主席由总经理担任。讨论内容涉及特定基金的，则该基金经理出席会议。

上述人员之间不存在近亲属关系。

二、基金托管人

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街55号

成立时间：1984年1月1日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币349,018,545,827元

联系电话：010-66105799

联系人：赵会军

三、相关服务机构

（一）基金份额发售机构

1、直销机构

名称：海富通基金管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴花园石桥路66号东亚银行金融大厦36-37层

法定代表人：邵国有

全国统一客户服务号码：40088-40099（免长途话费）

电话：021-38650797

传真：021-33830160

2、代销机构

①）中国工商银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街55号（100032）

法定代表人：姜建清

客户服务电话：95588

电话：010-66107900

传真：010-66107914

网址：www.icbc.com.cn

②）中国建设银行股份有限公司

注册地址：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

法定代表人：王洪章

传真：010-66275654

客户服务电话：95533

联系人：张静

网址：www.ccb.com

③）中国银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门内大街1 号

法定代表人：肖钢

电话：010-66596688

传真：010-66593777

客户服务电话：95566

网址：www.boc.cn

④）中国农业银行股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

客户服务电话：95599

传真：010-85108557

网址：www.abchina.com

⑤）交通银行股份有限公司

地址：上海市银城中路188号

法定代表人：胡怀邦

客户服务电话：95559

联系人：曹榕

网址：www.bankcomm.com

⑥）招商银行股份有限公司

地址：深圳市深南大道7088号招商银行大厦

法定代表人：傅育宁

客户服务电话：95555

联系人：邓敏鹏

网址：www.cmbchina.com

⑦）平安银行股份有限公司

地址：广东省深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦

法定代表人：孙建一

客户服务电话：95511-3

开放式基金业务传真：0755-25879453

联系人：周晓薇

网址：www.bank.pingan.com

⑧）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市中山东一路12号

法定代表人：吉晓辉

客户服务热线：95528

联系人：徐伟、汤嘉惠

网址：www.spdb.com.cn

⑨）中国民生银行股份有限公司

地址：北京市西城区复兴门大街2号

法定代表人：董文标

客户服务电话：95568

联系人：董云巍

网址：www.cmbc.com.cn

⑩）中信银行股份有限公司

地址：北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人：田国立

客户服务电话：95558

联系人：赵树林

网址：www.ecitic.com/bank

⑪）浙商银行股份有限公司

地址：中国杭州市庆春路288号

法定代表人：张达洋

客服电话：95527

联系人：毛真海

网址：www.czbank.com

⑫）华夏银行股份有限公司

地址：北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人：吴建

客户服务电话：95577

网址：www.hxb.com.cn

⑬）海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路689号海通证券大厦

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

联系人：李笑鸣

网址：www.htsec.com

⑭）中信证券股份有限公司

地址：北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦

法定代表人：王东明

电话：95558

联系人：陈忠

网址：http://www.cs.ecitic.com/

⑮）光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闸路1508号

法定代表人：徐浩明

客户服务电话：95525

联系人：刘晨、李芳芳

网址：www.ebscn.com

⑯）国泰君安证券股份有限公司

地址：上海市浦东新区商城路618号

法定代表人：万建华

客户服务电话：95521

联系人：芮敏祺、吴倩

网址：www.gtja.com

⑰）中信建投证券股份有限公司

地址：北京市朝阳门内大街188号

法定代表人：王常青

客户服务电话：400-8888-108

联系人：权唐

网址：www.csc108.com

⑱）华泰证券股份有限公司

地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦

法定代表人：吴万善

客户服务电话：95597

联系人：肖亦玲

网址：www.htsc.com.cn

⑲）招商证券股份有限公司

地址：深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人：宫少林

客户服务电话：95565

联系人：林生迎

网址：www.newone.com.cn

⑳）兴业证券股份有限公司

地址：福建省福州市湖东路268号

法定代表人：兰荣

客户服务电话：95562

联系人：谢高得

网址：www.xyzq.com.cn

㉑）长江证券股份有限公司

地址：武汉市新华路特8号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

客户服务电话：95579

联系人：李良

长江证券客户服务网站：www.95579.com

㉒）申银万国证券股份有限公司

地址：上海市常熟路171号

法定代表人：储晓明

客户服务电话：95523

联系人：高天

网址：www.sywg.com.cn

㉓）国元证券股份有限公司

地址：安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人：蔡咏

客户服务电话：95578

联系人：陈琳琳

网址：www.gyzq.com.cn

㉔）华泰联合证券有限责任公司

地址：深圳市深南东路5047号深圳发展银行大厦25、24、10层

法定代表人：马昭明

客户服务电话：95513

联系人：盛宗凌

网址：www.lhzq.com

㉕）广发证券股份有限公司

法定代表人：孙树明

注册地址：广州天河区天河北路183-187号大都会广场43楼（4301-4316房）

办公地址：广东省广州天河北路大都会广场5、18、19、36、38、39、41、42、43、44楼

联系人：黄岚

统一客户服务热线：95575或致电各地营业网点

公司网站：www.gf.com.cn

㉖）东方证券股份有限公司

地址：上海市中山南路318号2号楼21层-29层

法定代表人：潘鑫军

客户服务电话：95503

联系人：吴宇

网址：www.dfzq.com.cn

㉗）国信证券股份有限公司

地址：深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦16层到26层

法定代表人：何如

客户服务电话：95536

联系人：齐晓燕

网址：www.guosen.com.cn

㉘）中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座

法定代表人：陈有安

客户服务电话：4008-888-888

联系人：田薇

网址：www.chinastock.com.cn

㉙）平安证券有限责任公司

地址：深圳市福田区金田路大中华国际交易广场8楼

法定代表人：杨宇翔

客户服务电话：95511转8

联系人：郑舒丽

网址：stock.pingan.com

㉚）中信证券（浙江）有限责任公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层

法定代表人：沈强

客户服务电话：96598

联系人：俞会亮

网址：www.bigsun.com.cn

㉛）中信万通证券有限责任公司

地址：青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层

法定代表人：杨宝林

客户服务电话：0532-96577

联系人：吴忠超

网址：www.zxwt.com.cn

㉜）东北证券股份有限公司

地址：吉林省长春市自由大路1138号

法定代表人：矫正中

客户服务电话：4006000686

联系人：潘锴

网址：www.nesc.cn

㉝）瑞银证券有限责任公司

地址：北京市西城区金融大街7号英蓝国际金融中心12层、15层

法定代表人：刘弘

客户服务电话：400-887-8827

联系人：谢亚凡

网址：www.ubssecurities.com

㉞）德邦证券有限责任公司

地址：上海市福山路500号城建国际中心26层

法定代表人：姚文平

客户服务电话：4008888128

联系人：罗芳

网址：www.tebon.com.cn

㉟）宏源证券股份有限公司

地址：新疆乌鲁木齐市文艺路233号

办公地址：北京市西城区太平桥大街19号

法定代表人：冯戎

客户服务电话：4008-000-562

联系人：李巍

网址：www.hysec.com

㊱）齐鲁证券有限公司

地址：山东省济南市经七路86 号

法定代表人：李玮

客户服务电话：95538

联系人：孙蒙志

网址：www.qlzq.com.cn

㊲）第一创业证券股份有限公司

地址：广东省深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场B座25、26层

法定代表人：刘学民

客户服务电话：4008881888

联系人：魏颖

网址：http://www.fcsc.com

㊳）湘财证券有限责任公司

地址：湖南省长沙市天心区湘府中路198号新南城商务中心A栋11楼

法定代表人：林俊波

客户服务电话：400-888-1551

联系人：鲁雁先

网址：www.xcsc.com

㊴）友信证券股份有限公司

地址：深圳市福田区金田路4018号安联大厦35楼

法定代表人：牛冠兴

客户服务电话：400-800-1001

联系人：陈剑虹

网址：www.essence.com.cn

㊵）中国中投证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第18层至21层

法定代表人：龙增来

客户服务电话：95532或400-600-8008

联系人：刘毅

网址：http://www.china-invs.cn/

㊶）中国国际金融有限公司

地址：北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层

法定代表人：李剑阁

公司总机：010-65051166（北京）；021-58796226（上海）

联系人：易建军

网址：www.cicc.com.cn

㊷）中国民族证券有限责任公司

地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦A座6层-9层

法定代表人：赵大建

客户服务电话：400-889-5618

联系人：李薇

网址：www.e5618.com

㊸）华宝证券有限责任公司

地址：上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

法定代表人：陈林

客户服务电话：400-820-9898

联系人：刘闻川

网址：www.cnhbstock.com

㊹）华福证券有限责任公司

地址：福州五四路新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

客户服务电话：0591-96326

联系人：张腾

网址：www.gfhfzq.com.cn

㊺）信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼

法定代表人：高冠江

客户服务电话：400-800-8899

联系人：唐静

网址：www.cindasc.com

㊻）渤海证券股份有限公司

地址：天津市南开区宾水西道8号

法定代表人：杜庆平

客户服务电话：400-651-5988

联系人：王兆权

网址：www.ewww.com.cn

㊼）世纪证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42楼

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199599

联系人：张婷

网址：www.csco.com.cn

㊽）中银国际证券有限责任公司

地址：上海市浦东银城中路200号中银大厦39层

法定代表人：许刚

客户服务电话：400-6208-888、021-61195566

联系人：张静

网址：www.bocichina.com.cn

㊾）长城证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层

法定代表人：黄耀华

客户服务电话：4006666888

联系人：高峰

网址：www.cgws.com

㊿）方正证券股份有限公司

地址：湖南长沙芙蓉中路2段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

客户服务电话：95571

联系人：彭博

网址：www.foundersc.com

(51) 东莞证券有限责任公司

地址：广东省东莞市莞城区可园南路1 号金源中心30 楼

法定代表人：游锦辉

客户服务电话：961130（省内直拨，省外请在前加拨区号0769）

联系人：梁建伟

网址：www.dgzq.com.cn

(52) 广州证券有限责任公司

地址：广州市越秀区先烈中路69号东山广场主楼17楼

法定代表人：刘东

客户服务电话：020-961303

联系人：林洁茹

网址：www.gzs.com.cn

(53) 上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区西藏中路336号

法定代表人：郁忠民

客户服务电话：4008918918、021-962518

联系人：陈翔

网址：www.962518.com

(54) 大通证券股份有限公司

地址：大连市沙河口区会展路129号

法定代表人：于宏民

客户服务电话：4008169169

联系人：谢立军

网址：www.daton.com.cn

(55) 江海证券有限公司

地址：哈尔滨市香坊区赣水路56号

法定代表人：孙名扬

联系人：高悦铭

客服电话：400-666-2288

网址：www.jhzq.com.cn

(56) 山西证券股份有限公司

地址：山西省太原市府西街69号山西国际贸易中心东塔楼

法定代表人：侯巍

客户服务电话：400-666-1618

联系人：张治国

网址：www.i618.com.cn

(57) 国都证券有限责任公司

地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层、10层

法定代表人：常喆

客户服务电话：400-818-8118

联系人：黄静

网址：www.guodu.com

(58) 东兴证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：崔海涛

客户服务电话：4008-888-993

联系人：黄英

网址：www.dxzq.net

(59) 财富证券有限责任公司

地址：湖南长沙芙蓉中路二段80号顺天国际财富中心26-28层

法定代表人：周晖

电话：0731-84403360

联系人：朱友谊

网址：www.cfzq.com

(60) 民生证券有限责任公司

地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A层16-18层

法定代表人：余政

客户服务电话：4006198888

联系人：赵明

网址：www.mszq.com

(61) 华龙证券有限责任公司

地址：甘肃省兰州市东岗西路638号

法定代表人：李晓安

客户服务电话：4006898888

联系人：李昕田

网址：www.hlzqgs.com

(62) 红塔证券股份有限公司

地址：云南省昆明市北京路155号附一号红塔大厦9楼

法定代表人：况雨林

客户服务电话：0871-3577942

联系人：刘晓明

网址：www.hongtastock.com

(63) 日信证券有限责任公司

地址：呼和浩特市新城区锡林南路18号

法定代表人：孔佑杰

客户服务电话：010-88086830

联系人：冯杰

网址：www.rxzq.com.cn

(64) 英大证券有限责任公司

地址：深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层

法定代表人：赵文安

客户服务电话：4008698698

联系人：李欣

网址：www.ydsc.com.cn

(65) 中山证券有限责任公司

地址：深圳市福田区益田路6009号新世界中心29层

法定代表人：吴永良

客户服务电话：4001022011

联系人：李珍

网址：www.zszq.com

(66) 天相投资顾问有限公司

地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701

法定代表人：林义相

客户服务电话：010-66045678

联系人：林爽

网址：www.txsec.com

(67) 深圳众禄基金销售有限公司

地址：深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1、J单元

法定代表人：薛峰

客户服务电话：4006-788-887

联系人：张玉静

网址：www.zlfund.cn 及 www.jjmmw.com

(68) 杭州数米基金销售有限公司

地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

联系人：周嫣旻

网址：www.fund123.cn

(69) 上海好买基金销售有限公司

地址：上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

法定代表人：杨文斌

客户服务电话：400-700-9665

联系人：唐眉

网址：www.ehowbuy.com

(70) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

地址：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-089-1289

联系人：张裕

网址：www.erichfund.com

3、场内销售机构

具有开放式基金代销资格的、经中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员可成为本基金的场内销售机构，相关信息同时通过上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）登载。

基金管理人可以根据需要，增加其他符合要求的机构代理销售本基金，并按照相关规定及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中国证券登记结算有限责任公司

注册地址：北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人：金颖

电话：010-59378835

传真：010-59378907

联系人：任瑞新

（三）出具法律意见书的律师事务所

通力律师事务所

地址：上海市银城中路68号 时代金融中心19楼

负责人：韩炯

电话：021-31358666

传真：021-3135 8600

联系人：王利民

联系电话：021-31358666-8716

经办律师：秦悦民、王利民

（四）审计基金财产的会计师事务所

普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

法人代表：杨绍信

经办注册会计师：汪棣、金毅

电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：刘莉

四、基金的名称

本基金的名称：海富通中小盘股票型证券投资基金

五、基金的类型

基金类型：契约型开放式基金

六、基金的投资目标

本基金通过投资于具有高成长潜力和良好基本面的中小盘股票，在严格控制投资风险的前提下，实现基金资产的持续增值。

七、基金的投资方向和范围

本基金的投资范围限于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、国债、金融债、企业债、回购、央行票据、可转换债券、权证以及经中国证监会批准允许基金投资的其它金融工具。

基金投资组合中股票资产占基金资产的60%-95%，权证投资占基金资产净值的0%-3%，现金、债券、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产的5%-40%，其中，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%。本基金将不低于80%的股票资产投资于中小盘股票。

基金管理人每半年末将对中国A股市场中的股票按流通市值从小到大排序并相加，累计流通市值达到A股总流通市值2/3的这部分股票称为中小盘股票。

上述所称的流通市值指的是在国内证券交易所上市交易的股票的流通股本乘以收盘价。如果排序时股票暂停交易或停牌等原因造成计算修正的，本基金将根据市场情况，取停牌前收盘价或最能体现投资者利益最大化原则的公允价值计算流通市值。

此外，如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后相应调整本基金的投资比例上限规定。

八、基金的投资策略

本基金将通过分析宏观经济因素、政策导向因素、市场环境因素等，对证券市场系统性风险程度和中长期预期收益率进行动态监控，在投资范围内确定相应大类资产配置比例；其次通过对行业及个股进行定量与定性相结合的分析，精选具有良好基本面和成长潜力的中小盘上市公司进行投资。

1.资产配置策略

本基金将基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，形成对不同市场周期的预测和判断，通过灵活主动且有纪律的资产配置，确定组合中股票、债券、货币市场工具和其他金融工具的投资比例，追求较高的收益，同时规避市场的系统性风险。

在资产配置中，本基金主要考虑如下因素：宏观经济因素，包括宏观经济发展趋势，经济的景气周期研究等；货币因素，包括利率水平及其变化、CPI、货币政策等；市场估值因素，包括市场的相对定价水平、估值水平等；政策影响因素，包括不同政策发布对不同资产类别的影响分析等；市场气氛等。通过对各种因素的综合分析，确定本基金的资产配置。

2.股票投资策略

①）行业分析

在经济发展的不同阶段、政策导向和市场环境下，各行业会形成不同的景气状态，各个行业的发展会有很大的不同，因此行业配置将对于基金收益会有重要影响。

本基金将采用自上而下的行业分析方法，结合政策导向和市场环境等因素的综合分析，依据对行业基本面和景气周期的分析预测，判断各行业的景气程度，从而确定基金在一定时期内的行业布局。本基金将精选景气行业或者长期增长前景看好且具有良好投资价值的行业进行重点配置。在此基础上，本基金管理人将实施灵活的行业配置策略，通过跟踪不同行业的景气周期变化等因素，动态调整行业资产配置权重，积极把握行业景气变化中的投资机会。

②）股票分析

本基金的股票投资将兼顾个股的成长性和估值水平，寻找具有较强的持续成长能力，同时价值又没有被高估的股票。

1）价值分析

价值分析包括公司的品质分析及估值水平分析。健康的品质是公司未来持续成长的良好基础，也可以提高公司的抗风险能力，因此本基金对上市公司的价值分析首先将分析公司的品质，将着重对公司进行财务分析，考察每股收益率（EPS）、净资产收益率（ROE）等指标，另外将根据上市公司所处行业景气度及其在行业中的竞争地位等多方面的因素进行综合评估，挖掘上市公司的投资价值。

如果公司具有成长性，但是股价已经被严重高估，股票将丧失吸引力。因此本基金将对股票进行估值分析，本基金管理人将关注PE、PB、PS等指标。对于这些指标，除了静态分析以外，本管理人还将根据对公司的深入研究及盈利预测，进行动态分析。

2）成长分析

对于成长性分析，本基金管理人将重点关注企业的内涵式增长。内涵式增长主要是来自企业的管理技能的可复制、企业的创新能力、产品的竞争优势及公司抵抗风险持续生存的能力等。本基金将从定量分析及定性分析两方面分析企业的成长能力。

●定量分析

本基金的公司成长性分析体系将首先通过成长性指标分析公司的经营状况，本基金选取的成长性指标主要包括：PEG、每股收益增长率、净利润预测增长率、主营业务增长率等等。

●定性分析

公司成长性既受到公司的各种内部因素影响，又受到公司的各种外部因素影响，因此本基金的上市公司成长性评估将以宏观分析和行业分析作为评估的基础，对公司内部因素进行深刻理解和分析，挖掘上市公司保持高成长性和业绩增长的驱动因素，深入分析这些驱动因素是否具有可持续性，从而优选出品质优良、成长潜力高于平均水平的上市公司。定性分析包括行业前景分析等外部因素分析及公司商业模式、公司治理、管理层素质、产品竞争力、企业创新能力等内部因素分析。

本基金股票投资强调将定量的股票筛选和定性的公司研究有机结合，并实时应用风险控制手段进行组合调整。深入的公司研究和分析是发掘成长性股票的核心，通过定性的分析和定量的筛选，得出对公司未来盈利成长的潜力、质量以及持续性的评价，从而发掘出品质优良并具有持续成长性的股票。

3.债券投资策略

本基金的债券投资采取“自上而下”的投资策略，将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化等趋势，综合考虑不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，通过采取利率预期、久期管理、收益率曲线策略、收益率利差策略和套利等积极的投资策略，确定和构造合理的债券组合。

4.权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具，本基金将在控制风险的前提下，充分利用权证来达到控制下跌风险、实现保值和锁定收益的目的；此外，还将充分发掘可能的套利机会，以达到增值的目的。

5. 投资决策

1）决策依据

①）股投决策须符合有关法律、法规和基金合同的规定；

②）股投决策是根据本基金产品的特征决定不同风险资产的配比；

③）股投部策略分析师、股票分析师、固定收益分析师、定量分析师各自独立完成相应的研究报告，为投资策略提供依据。

2）. 决策程序

本基金采用投资决策委员会领导下的团队式投资管理模式。投资决策委员会不定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。基金经理、分析师、交易员在投资管理过程中既密切合作，又责任明确，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。具体的决策流程如下：

①）投资决策委员会依据国家有关基金投资方面的法律和行业管理法规，决定公司针对市场环境重大变化所采取的对策；决定投资决策程序和风险控制系统及做出必要的调整；对旗下基金重大投资的批准与授权等。

②）股投总监在公司有关规章制度授权范围内，对重大投资进行审查批准；并且根据基金合同的有关规定，在组合业绩比较基准的基础上，制定各组合资产和行业配置的偏差度指标。

③）分析师根据宏观经济、货币财政政策、行业发展动向和上市公司基本面等进行分析，提出宏观策略意见、债券配置策略及行业配置意见。

④）定期不定期召开基金经理例会，基金经理们在充分听取各分析师意见的基础上，确立公司对市场、资产和行业的投资观点，该投资观点是指导各基金进行资产和行业配置的依据。

⑤）基金经理在投资总监授权下，根据基金经理例会所确定的资产/行业配置策略以及偏差度指标，在充分听取策略分析师宏观配置意见、股票分析师行业配置意见及固定收益分析师的债券配置意见，进行投资组合的资产及行业配置；之后，在股票分析师设定的股票池内，根据所管理组合的风险收益特征和流动性特征，构建基金组合。

⑥）基金经理下达交易指令到交易室进行交易。

⑦）定量分析师负责对投资组合进行事前、事中、事后的风险评估与控制。

⑧）定量分析师负责完成内部基金业绩评估，并完成有关评价报告。

投资决策委员会有权根据市场变化和实际情况的需要，对上述投资管理程序做出调整。

九、基金的业绩比较基准

基金业绩比较基准=中证700指数×80%+上证国债指数×20%

中证700指数由中证指数有限公司发布，其成份股由中证500和中证200成份股一起构成，综合反映沪深证券市场内中小市值公司的整体状况，其中中证200指数综合反映沪深证券市场内中市值公司的整体状况，中证500指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的股票指数时，本基金可以在履行相关程序后变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金是股票型基金，属于高风险、高预期收益的投资品种。其预期收益、预期风险高于货币型基金和债券型基金。

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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2012年11月6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止至2012年9月30日（“报告期末”）。

1、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	745,522,865.46	84.89
	其中：股票	745,522,865.46	84.89
2	固定收益投资	49,980,000.00	5.69
	其中：债券	49,980,000.00	5.69
	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	79,597,787.07	9.06
6	其他各项资产	3,070,876.09	0.35
7	合计	878,171,528.62	100.00

2、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	-	-
C	制造业	478,229,365.24	54.66
C0	食品、饮料	97,038,289.81	11.09
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	5,843,337.68	0.67
C4	石油、化学、塑胶、塑料	41,196,781.08	4.71
C5	电子	2,043,609.40	0.23
C6	金属、非金属	7,379,993.65	0.84
C7	机械、设备、仪表	43,032,441.30	4.92
C8	医药、生物制品	281,694,912.32	32.19
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	69,366,926.16	7.93
E	建筑业	6,368,000.00	0.73
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	86,817,034.31	9.92
H	批发和零售贸易	43,736,791.50	5.00
I	金融、保险业	27,047,611.50	3.09
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	33,957,136.75	3.88
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	745,522,865.46	85.20

3、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	000799	酒鬼酒	843,923	46,162,588.10	5.28
2	002450	康得新	1,909,026	41,196,781.08	4.71
3	600332	广州药业	1,804,870	37,541,296.00	4.29
4	300289	利德曼	1,735,843	36,452,703.00	4.17
5	600011	华能国际	3,979,364	25,189,374.12	2.88
6	600062	华润双鹤	1,079,907	24,654,276.81	2.82
7	000028	国药一致	700,000	23,730,000.00	2.71
8	600557	康缘药业	1,199,892	23,349,898.32	2.67
9	000430	张家界	2,300,231	21,277,136.75	2.43
10	000963	华东医药	579,907	20,006,791.50	2.29

4、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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	49,980,000.00	5.71
	其中：政策性金融债	49,980,000.00	5.71
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-