(上接D29版)

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	31,387,511.20	1.91
B	采掘业	104,056,360.95	6.32
C	制造业	590,743,828.20	35.87
C0	食品、饮料	28,681,475.30	1.74
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	18,116,366.94	1.10
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	10,924,822.42	0.66
C5	电子	91,314,025.53	5.54
C6	金属、非金属	185,712,439.62	11.28
C7	机械、设备、仪表	242,266,698.39	14.71
C8	医药、生物制品	13,728,000.00	0.83
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	25,750,000.00	1.56
F	交通运输、仓储业	64,888,742.07	3.94
G	信息技术业	136,412,119.93	8.28
H	批发和零售贸易	39,708,642.20	2.41
I	金融、保险业	188,585,293.54	11.45
J	房地产业	167,948,123.64	10.20
K	社会服务业	100,871,489.14	6.13
L	传播与文化产业	57,947,052.06	3.52
M	综合类	25,270,435.08	1.53
	合计	1,533,569,598.01	93.12

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	600030	中信证券	3,999,977	47,159,728.83	2.86
2	300058	蓝色光标	1,999,839	42,596,570.70	2.59
3	600837	海通证券	3,999,867	38,318,725.86	2.33
4	300070	碧水源	1,088,200	37,793,186.00	2.29
5	000776	广发证券	2,599,684	35,355,702.40	2.15
6	600428	中远航运	9,999,874	34,799,561.52	2.11
7	601555	东吴证券	3,999,899	34,199,136.45	2.08
8	600720	祁连山	2,888,968	33,656,477.20	2.04
9	601318	中国平安	800,000	33,552,000.00	2.04
10	300168	万达信息	2,321,918	32,042,468.40	1.95

4、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投资。
5、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投资。
6、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。
7、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。
8、投资组合报告附注
(1)报告期内本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,也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚,无证券投资决策程序需特别说明。
(2)本基金根据中国股市价值驱动因子与成长驱动因子的变动趋势,调整评估个股"价值因子"与"成长因子"的权重比例,自下而上精选个股,没有特定的股票备选库。
(3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,563,082.75
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	108,000.00
4	应收利息	22,430.68
5	应收申购款	504,942.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,198,456.01

(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
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

八、基金的业绩

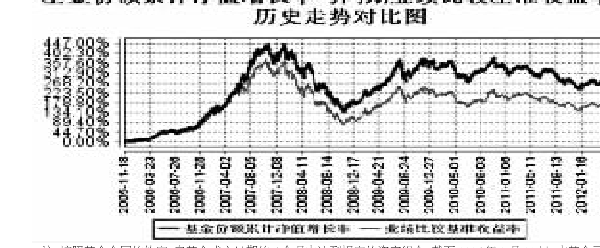
基金业绩截止日为2012年9月30日。基金过往业绩不代表未来表现,本报告中所列数据未经审计。
1、净值增长率与同期比较基准收益率比较

阶段	净值增长率①	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
2005/11/18-2005/12/31	2.64%	0.20%	6.19%	0.63%	-3.55%	-0.43%
2006/01/01-2006/12/31	117.73%	1.08%	92.16%	1.13%	25.57%	-0.05%
2007/01/01-2007/12/31	129.41%	1.82%	117.16%	1.84%	12.25%	-0.02%
2008/01/01-2008/12/31	-47.54%	2.14%	-55.80%	2.43%	8.26%	-0.29%
2009/01/01-2009/12/31	73.56%	1.55%	73.25%	1.65%	0.31%	-0.10%
2010/01/01-2010/12/31	-5.46%	1.19%	-10.29%	1.26%	4.83%	-0.07%
2011/01/01-2011/12/31	-21.11%	0.90%	-19.13%	1.05%	-1.98%	-0.15%
2012/01/01-2012/06/30	-0.49%	1.02%	5.04%	1.05%	-5.53%	-0.03%
2005/11/18-2012/09/30	225.72%	1.48%	144.94%	1.58%	80.78%	-0.10%

2、基金累计净值增长率与比较基准收益率走势对比

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2005年11月17日至2012年9月30日)

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注:按照基金合同的约定,自基金成立日期的6个月内达到规定的资产组合,截至2006年3月31日,本基金已达到合同规定的资产配置比例。

九、基金份额的申购和赎回

(一)基金份额申购和赎回的场所
本基金的销售机构包括基金管理人和基金管理人委托的代销机构。具体销售网点将由基金管理人在份额发售公告或其他公告中列明。基金管理人可以根据情况变更或增减代销机构,并予以公告。
投资人可以在销售机构办理基金销售业务的营业场所或按销售机构提供的其他方式办理基金的申购与赎回。具体办法另行公告。
(二)申购与赎回的开放日及时间
1、开放日及开放时间
上海证券交易所和深圳证券交易所同时开放交易的工作日为本基金的开放日。具体业务办理时间以销售机构公布时间为准。
基金合同生效后,若出现新的证券交易市场、证券交易所时间变更或其他特殊情况,基金管理人将视情况对前述开放日及时间进行相应的调整并公告。
2、申购、赎回开始日及业务办理时间
本基金自2005年12月19日起开始办理日常申购、赎回业务。
基金管理人不得在基金合同约定之外的日期或者时间办理基金份额的申购、赎回或者转换。投资人在基金合同约定之外的日期和时间提出申购、赎回或者转换申请的,视同下次开放时间提交的申请。
(三)申购与赎回的原则
1、"未知价"原则,即基金的申购与赎回价格以受理申请当日收市后计算的基金份额净值为基准进行计算;
2、基金采用金额申购和份额赎回的方式,即申购以金额申请,赎回以份额申请;
3、基金份额持有人在赎回基金份额时,基金管理人按先进先出的原则,即对该基金份额持有人在该销售机构的基金份额进行处理时,申购确认日期在先的基金份额先赎回,申购确认日期在后的基金份额后赎回,以确定所适用的赎回费率;
4、当日的申购与赎回申请可以在当日交易时间结束前撤销,在当日的交易时间结束后不得撤销;
5、基金的申购和赎回以书面或经基金管理人认可的其他方式进行;
6、基金管理人在不损害基金份额持有人权益的情况下可更改上述原则,但最迟应在新的原则实施前三个工作日予以公告。
(四)申购与赎回的程序
1、申购和赎回的申请方式
基金投资人须按基金管理人和销售机构规定的手续,在开放日的业务办理时间提出申购或赎回的申请。
投资人申购本基金,须按销售机构规定的方式备足申购资金。
投资人提交赎回申请时,在其提出赎回申请的销售机构(网点)交易账号内必须有足够的基金份额余额。
2、申购和赎回申请的确认
基金管理人应以在基金申购、赎回的交易时间段内收到申购和赎回申请的当天作为申购或赎回申请日(T日),并在T+1日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2日及之后到其提出申购与赎回申请的网点进行成交查询。
3、申购和赎回的款项支付
申购采用全额交款方式,若资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。申购不成功或无效,申购款项将退回投资人账户。
投资人赎回申请成功后,赎回款项在自成交确认日起五个工作日内划往投资人银行账户。在发生巨额赎回时,赎回款项的支付办法按基金合同有关规定处理。
(五)申购与赎回的数额限制
1、申请申购基金的金额
通过代销网点和直销e网金申购本基金单笔最低金额为1,000元人民币(含申购费)。通过直销柜台首次申购的最低金额为10万元人民币(含申购费),追加申购最低金额为1,000元人民币(含申购费)。已有认购本基金记录的投资人不受首次申购最低金额的限制,但受追加申购最低金额的限制。
代销网点的投资人欲转入直销柜台进行交易要受直销柜台最低金额的限制。基金管理人可根据市场情况,调整首次申购的最低金额。
投资人可多次申购,对单个投资人累计持有份额不设上限限制。法律法规、中国证监会另有规定的除外。
2、申请赎回基金的份额
投资人可将其全部或部分基金份额赎回。本基金按照份额进行赎回,申请赎回份额精确到小数点后两位,单笔赎回份额不得低于100份。基金持有人赎回时或赎回后在销售机构(网点)保留的基金份额余额不足100份的,在赎回时需一次全部赎回。
基金管理人可根据市场情况调整上述申购与赎回的规定,但应最迟在调整生效前三个工作日在至少一种指定媒体予以公告。
(六)基金的申购费和赎回费
1、投资人在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。本基金的申购费率表如下:

申购金额	申购费率
500万(含)以上	每笔1000元
大于等于200万,小于500万	0.5%
大于等于100万,小于200万	1.0%
大于等于50万,小于100万	1.2%
50万以下	1.5%

本基金的申购费用由申购人承担,主要用于市场推广、销售、注册登记等各项费用,不列入基金财产。
2、赎回费随基金持有时间的增加而递减,费率如下:

持有时间	费率
两年以内(含两年)	0.5%
两年-三年(含三年)	0.3%
三年以上	0%

本基金的赎回费用由赎回人承担,其中25%的部分归入基金财产,其余部分用于支付注册登记费等相关手续费。

十、与基金管理人管理的其他基金转换

(一)基金转换申请人的范围
本基金的持有人均可以按照基金合同的规定申请和办理本基金与基金管理人管理的其他基金的转换。
(二)基金转换受理场所
基金转换受理场所与基金份额申购、赎回申请的受理场所相同。
本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、招商银行、中信银行、民生银行、中国银行、交通银行、申银万国证券、国泰君安证券、海通证券、兴业证券、中信建投证券、招商证券、光大证券、长江证券、东吴证券、中信证券(浙江)、渤海证券、恒泰证券、中投证券、平安证券、广发证券、华泰证券和中信证券受理本基金与公司管理的宝康系列基金、现金宝货币市场基金、多策略增长基金、先进成长基金、收益增长基金、行业精选基金和大盘精选基金间的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、招商银行、民生银行、交通银行、中信银行、申银万国证券、光大证券、招商证券、平安证券、国泰君安证券、中信证券、华泰证券、中信证券(浙江)、中信建投证券、兴业证券、长江证券、广发证券、东吴证券、中信证券、华泰证券、恒泰证券、渤海证券受理本基金与增强收益债券基金间的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、交通银行、招商银行、民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、国泰君安证券、中信建投证券、海通证券、招商证券、申银万国证券、中国银河证券、广发证券、东吴证券、兴业证券、中信证券、光大证券、平安证券、国信证券、中信万通证券、长城证券、安信证券、渤海证券、华宝证券、中金公司、齐鲁证券和长江证券受理本基金与中证100指数基金(前端收费模式)间的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、广发银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、国泰君安证券、海通证券、申银万国证券、光大证券、东兴证券、中信证券受理本基金与上证180价值ETF联接基金间的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、民生银行、中信银行、平安银行、浦发银行、渤海银行、江苏银行、华夏银行、申银万国证券、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、国信证券、中信证券(浙江)、中信万通证券、平安证券、东方证券、兴业证券、华泰证券、中银国际证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、东吴证券、中信证券、江海证券、安信证券、中金公司、华宝证券、华安证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、国都证券、东兴证券、东北证券、德邦证券、上海证券、方正证券已开通本基金与新兴产业基金间的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、招商银行、中国建设银行、中国银行、交通银行、中国民生银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、江苏银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、招商证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、中信证券(浙江)、国信证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、安信证券、中金公司、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、信达证券、江海证券、国都证券、东北证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券已开通本基金与本公司管理的可转债基金之间转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、中国民生银行、渤海银行、中信银行、国泰君安证券、申银万国证券、海通证券、光大证券、中信建投证券、广发证券、中信证券、长江证券、华福证券、国信证券、中国银河证券、齐鲁证券、华宝证券、上海证券、招商证券、信达证券、国都证券、华安证券、德邦证券、渤海证券、兴业证券、东海证券、江海证券、恒泰证券、国元证券、东吴证券、长城证券、华泰证券、中投证券、平安证券、东北证券、中航证券、安信证券、中银国际证券、中金公司、中信证券(浙江)开通本基金与本公司管理的上证180成长ETF联接基金之间的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、上海浦东发展银行、民生银行、渤海银行、中信银行、国泰君安证券、申银万国证券、海通证券、光大证券、中信建投证券、广发证券、中信证券、长江证券、华福证券、国信证券、中国银河证券、齐鲁证券、华宝证券、上海证券、招商证券、信达证券、国都证券、华安证券、德邦证券、渤海证券、兴业证券、东海证券、江海证券、恒泰证券、国元证券、东吴证券、长城证券、华泰证券、中投证券、平安证券、东北证券、中航证券、安信证券、中银国际证券、中国国际金融公司、中信证券(浙江)已开通本基金与上证180成长ETF联接基金的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国建设银行、中国银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中信银行、平安银行、渤海银行、民生银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、兴业证券、国信证券、中信万通证券、华泰证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、国都证券、德邦证券、上海证券、中航证券、招商证券、东北证券、西南证券、华福证券、中信建投证券、江海证券、国元证券、华安证券、中银国际证券、民生证券、中国国际金融公司、中信证券(浙江)、东海证券已开通本基金与医药生物基金的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、平安银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、中信证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融公司、中信证券(浙江)、中信万通证券、华泰证券、中银国际证券、华福证券、东北证券、招商证券、西南证券已开通本基金与中证短融50基金的转换业务。
本公司直销柜台、直销e网金、中国银行、中国建设银行、中国农业银行、交通银行、招商银行、中国民生银行、上海浦东发展银行、渤海银行、国泰君安证券、光大证券、海通证券、中国银河证券、中信建投证券、广发证券、长江证券、东吴证券、申银万国证券、平安证券、东方证券、国信证券、恒泰证券、长城证券、渤海证券、中国中投证券、华宝证券、齐鲁证券、信达证券、江海证券、国都证券、德邦证券、华安证券、上海证券、东海证券、中航证券、民生证券、中国国际金融公司、兴业证券、中银国际证券、华福证券、东北证券、安信证券、西南证券、东兴证券已开通本基金与资源优选基金的转换业务。
其他销售机构基金转换业务的具体办理时间、流程以销售机构及其网点的安排和规定为准。
基金转换只能在同一销售机构进行,转换的两只基金必须都是该销售机构代理销售的本公司管理的基金。
(三)基金转换受理时间
投资人可以在基金开放日的交易时间段申请办理基金转换业务,具体办理时间与基金申购、赎回业务办理时间一致。
(四)基金转换费用
本基金与公司管理的其他基金转换,转换费用由二部分组成:转出基金赎回费和转入基金与转出基金的申购补差费。
赎回费:按转出基金正常赎回时的赎回费率收取费用。其中25%归转出基金基金财产,其余作为注册登记费和相关的手续费。
申购补差费:按照转入基金与转出基金的申购费率的差额收取补差费。转出基金金额所对应的转出基金申购费率低于转入基金的申购费率的,补差费率为转入基金和转出基金的申购费率差额;转出基金金额所对应的转出基金申购费率高于转入基金的申购费率的,补差费为零。
(五)基金转换公式
1、基金转换公式为:
转出费用=转出份额*转出基金份额净值*转出基金赎回费率
转出总金额=转出份额*转出基金单位净值
净转出金额=转出总金额-转出费用
净转入金额=净转出金额/(1+补差费率)
(补差费率=转出基金申购费率与转入基金申购费率差)
转换补差费用=净转出金额-净转入金额
转入份额=净转入金额/转入基金单位净值
转入份额保留小数点后两位,小数点后两位以后的余额对应的部分计入基金财产。
2、基金管理人在不损害本基金份额持有人权益的情况下可更改上述公式,但应最迟在新的公式适用前3个工作日予以公告。
(六)不同基金之间的转换不影响投资者的持有基金时间的计算。
(七)基金转换的程序
1、基金转换的申请方式
基金份额持有人必须根据基金管理人和基金销售代理人规定的手续,在开放日的交易时间段内提出基金转换申请。
2、基金转换申请的确认
基金管理人以收到基金转换申请的当天作为基金转换申请日(T日),并在T+1工作日对该交易的有效性进行确认。投资人可在T+2工作日及之后到其提出基金转换申请的网点进行成交查询。
基金份额持有人申请转换时,基金管理人按先进先出的原则对该持有人基金账户在该销售机构托管的基金份额进行处理,即先确认的份额先转换,后确认的份额后转换。
(八)基金转换的数额限制
基金转换遵循"份额转换"的原则,转换申请份额精确到小数点后两位。从本基金、宝康系列基金、多策略增长基金、收益增长基金、先进成长基金、行业精选基金大盘精选基金、增强收益债券基金、中证100指数基金(前端收费模式)、上证180价值ETF联接基金、新兴产业基金、可转债基金、上证180成长ETF联接基金、医药生物基金、中证短融50基金、资源优选基金转出,单笔转换申请份额不得低于100份;从现金宝货币市场基金转出,单笔转换申请份额不得低于200份。因为转换等非赎回原因导致投资人在销售机构(网点)保留的基金份额余额少于该基金最低保留份额数量限制的,注册登记机构不作强制赎回处理。
(九)基金转换的注册登记
1、基金投资人提出的基金转换申请,在当日交易时间内可以撤销,交易时间结束后不得撤销。
2、基金注册登记机构在T+1日内对基金份额持有人基金转换申请进行确认,确认成功后为基金份额持有人办理相关的注册登记手续。
3、基金管理人可在法律法规允许的范围内,对上述注册登记办理时间进行调整,并最迟于开始实施前3个工作日予以公告。
(十)拒绝或暂停基金转换的情形及处理方式
1、除非出现如下情形,基金管理人不得拒绝或暂停接受基金份额持有人的基金转换申请:
(1)不可抗力;
(2)货币市场工具主要交易场所在交易时间非正常停市;
(3)基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔转换;
(4)暂停估值;
(5)法律、法规规定或中国证监会认定的其他情形。
如果基金份额持有人的基金转换申请被拒绝,基金份额持有人持有的原基金份额不变。
2、发生上述情形之一的,基金管理人应在当日立即向中国证监会备案。
3、发生基金合同或招募说明书中未予载明的事项,但基金管理人有正当理由认为需要拒绝或暂停接受基金转换申请的,应当报中国证监会备案。
4、暂停基金转换,基金管理人应立即在至少一种指定媒体上公告。
5、暂停期结束,基金管理人应当公告最新的基金收益和转份额的情况。
如果发生暂停的时间为1日,基金管理人应于重新开放日在至少一种指定信息披露媒体上刊登基金重新开放基金转换的公告,并公告最新的基金收益情况。
如果发生暂停的时间超过1日但少于两周,暂停结束,重新开放基金转换时,基金管理人应提前1个工作日在至少一种指定媒体刊登基金重新开放基金转换的公告,并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益情况。
如果发生暂停的时间超过两周,暂停期间,基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次;当连续暂停时间超过两个月时,可对重复刊登暂停公告的频率进行调整。暂停结束,重新开放基金转换时,基金管理人应提前3个工作日在至少一种指定媒体上连续刊登基金重新开放基金转换的公告,并在重新开放基金转换日公告最新的基金收益的情况。

十一、基金的费用

(一)与基金运作有关的费用
1、费用种类
(1)基金管理人的管理费;
(2)基金托管人的托管费;
(3)基金的证券交易费用;
(4)基金合同生效以后的信息披露费用;
(5)基金份额持有人大会费用;
(6)基金合同生效以后与基金相关的会计师费和律师费;
(7)按照国家有关规定可以列入的其他费用。
上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定。
2、费率水平、计提标准和支付方式
(1)基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.5%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,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,基金托管人复核后于次月首日起五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
(2)基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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,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五个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
(3)本条第1款第(3)至第(7)项费用由基金管理人和基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,列入当期基金费用。
3、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。
4、基金管理人和基金托管人可协商酌情调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会,但应报经中国证监会批准。基金管理人必须最迟于新的费率实施日前三个工作日在至少一种指定媒体上刊登公告。
(二)与基金销售有关的费用
本基金的申购费、赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式请详见本招募说明书"八、基金份额的申购与赎回"中的"(六)基金的申购费和赎回费"中的相关规定。本基金与公司管理的其它基金间的转换费率、计算公式、转换程序请详见本招募说明书"九、与基金管理人管理的其他基金转换"中的相关规定。

十二、基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。基金管理人有权根据基金份额持有人的需要和市场的变化,增加或变更服务项目及内容。主要服务内容如下:
(一)资料寄送
投资人更改个人信息资料,请及时到原开立华宝兴业基金账户的销售网点更改。
在从销售机构获取准确的客户地址和邮编的前提下,基金管理人将负责寄送以下资料:
1、基金投资人对账单
基金投资人对账单包括季度对账单与年度对账单。在每季度结束后的15个工作日内向该季度有交易的基金份额持有人以书面或电子文件形式寄送,年度对账单在每年度结束后15个工作日内对本基金的所有份额持有人以书面或电子文件形式寄送(通过中国银行首次购买本基金管理人旗下基金的基金份额持有人除外)。
2、其他相关的信息资料
(二)红利再投资
本基金收益分配时,基金份额持有人可以选择将所获红利再投资于本基金,登记注册机构将其所获红利按分红实施日前一日的基金份额净值自动转为基金份额。红利再投资免收申购费用。
(三)定期定额投资计划
1、定义
本基金的"定期定额投资计划"是指投资人可通过本基金管理人指定的销售机构提交申请,约定每月扣款时间、扣款金额,由指定的销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。投资者在办理本业务的同时,仍然可以进行日常申购、赎回业务。
2、办理时间
本业务申请受理时间为开放式基金法定开放日9:30-15:00
3、办理场所
目前,我公司直销e网金、中国银行、招商银行、中国工商银行、中国建设银行、中国农业银行、民生银行、交通银行、中信银行、平安银行、上海浦东发展银行、兴业银行、广发银行、江苏银行、华夏银行、渤海银行、国泰君安证券、中信建投证券、海通证券、招商证券、中国银河证券、东吴证券、兴业证券、光大证券、平安证券、国信证券、安信证券、华宝证券、齐鲁证券、华福证券、江海证券、德邦证券、华安证券、东北证券、中信证券、申银万国证券已开通本基金的定期定额投资业务。其中,中国建设银行只接受个人投资者的申请。
本公司新增其他销售机构开办此业务时,将另行公告。
4、申请方式 4、申请方式
(1)凡申请办理本业务的投资者,须先开立本公司开放式基金账户(已开户者除外),具体开户程序应遵循销售机构的相关规定。
(2)已开立本公司开放式基金账户的投资者,请到销售机构的各营业网点申请办理此项业务,具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定。
5、扣款日期
投资者应按照销售机构的业务规则,与销售机构约定每月固定扣款日期,该扣款日期视为申购申请日(T日);若遇约定的固定扣款日期为非基金申购开放日,则下一基金申购开放日为实际扣款日(T日)。
6、扣款金额
投资者应与销售机构就申请开办本业务约定每月固定扣款(申购)金额具体最低扣款金额以各销售机构为准。投资者通过本公司直销e网金办理本业务时,每期扣款金额最低不少于人民币200元(含申购费)。
7、扣款方式
(1)销售机构将按照投资者申请时所约定的每月固定扣款日和扣款金额扣款。若遇非基金申购开放日,则顺延至下一基金申购开放日办理;
(2)投资者须指定一个有效资金账户作为每月固定扣款账户,并且该账户必须为投资者从事基金交易时的指定账户;
(3)投资者指定账户内资金余额不足将会导致相应月份扣款(申购)不成功。请投资者于每月约定扣款日前在指定账户内按约定存足资金,以保证本业务申请的成功受理。同时,投资者指定的有关账户应无冻结、挂失等情况。若因投资者原因造成连续3期扣款(申购)不成功,则视为投资者自动终止定期定额投资业务。
8、申购费率
如无另行规定(详细情况请参见各销售机构相关业务公告),定期定额申购费率及计费方式等同于正常的申购业务。
9、交易确认
以每月实际扣款日(T日)的基金份额净值为基准计算申购份额。基金份额确认日为T+1日,投资者可在T+2日到销售机构各销售网点查询基金申购确认情况。
10、本业务的变更和终止
(1)投资者变更每月扣款金额、扣款日期、扣款账户等信息,须到原销售网点申请办理业务变更手续,具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定;
(2)投资者终止本业务,须到销售机构申请办理业务终止手续,具体办理程序应遵循各销售机构的相关规定;
(3)本业务变更和终止的生效日应遵循各销售机构的具体规定。
(四)在线服务
基金管理人利用自己的网站(www.fsfund.com)为基金投资人提供网上查询、网上资讯服务。目前,基金管理人已经开始提供网上交易服务。
(五)资讯服务
1、投资人如果想了解申购与赎回的交易情况、基金账户份额、基金产品与服务等信息,可拨打华宝兴业基金管理有限公司如下电话:
电话呼叫中心:4007005588、021—38924558
直销柜台电话:021-38505888-301或302、38505731、38505732
传真:021-50499663、50499667、50988055
2、互联网站
公司网址:www.fsfund.com
电子信箱:fsf@fsfund.com
(六)客户投诉和建议处理
投资人可以通过基金管理人提供的呼叫中心自动语音留言、呼叫中心人工座席、书信、电子邮件、传真等渠道对基金管理人和销售机构所提供的服务进行投诉或提出建议。投资人还可以通过代销机构的服务电话对该代销机构提供的服务进行投诉。

十三、《招募说明书》更新部分的说明

根据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称《基金法》)、《证券投资基金运作管理办法》(以下简称《运作办法》)、《证券投资基金销售管理办法》(以下简称《销售办法》)、《证券投资基金信息披露管理办法》(以下简称《信息披露办法》)及其他有关规定,华宝兴业基金管理有限公司对《华宝兴业动力组合股票型证券投资基金招募说明书》作如下更新:
1、"三、基金管理人"部分更新了基金管理人的相关信息。
2、"四、基金托管人"部分更新了基金托管人的相关信息。
3、"五、相关服务机构"部分更新了"一、基金份额发售机构"中代销机构的相关信息。
4、"九、与基金管理人管理的其他基金转换"部分更新了办理转换业务的销售机构和本基金与其他基金转换的相关内容。
5、"十、基金的投资"部分更新了截至2012年9月30日的基金的投资组合报告。
6、"十一、基金的业绩"部分更新了截至2012年9月30日的基金业绩数据。
7、"二十二、基金托管协议内容摘要"更新了基金管理人的住所。
8、"二十四、其他应披露事项"部分,对本报告期内的相关公告作了信息披露。
上述内容仅为摘要,须与本《招募说明书》后面所载之详细资料一并阅读。

华宝兴业基金管理有限公司
2012年12月25日

(上接D30版)

联系人:刘毅
电话 0755-82023442
传真 0755-82026539
网址 www.cjis.cn
客服电话 400 600 8008
(84)中山证券有限责任公司
注册地址: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
电话:(0755)82943755
传真:(0755)82940511
客户服务电话:4001022011
网址:www.zszq.com.cn
(85)红塔证券股份有限公司
注册地址:云南省昆明市北京路155号附1号
办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦7-11楼
法定代表人:况雨林
电话:(0871)3577930
传真:(0871)3578827
客户服务电话:(0871)3577930
网址:www.hongtazq.com
(86)日信证券有限责任公司
注册地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
办公地址:呼和浩特市新城区锡林南路18号
法定代表人:孔佑杰
电话:(0471)6292587
传真:(0471)6292477?
客户服务电话:(010)88086830、(0471)6292465
网址:www.rxzq.com.cn
(87)江海证券有限公司
注册地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
办公地址:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:(0451)82336863
传真:(0451)82287211
客户服务电话:40066-62288
网址:www.jhzq.com.cn
(88)华宝证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号环球金融中心57层
法定代表人:陈林
电话:(021)50122107
传真:(021)50122078
客户服务电话:4008209898
网址:www.cnhbstock.com
(89)厦门证券有限公司
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
办公地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼
法定代表人:傅毅辉
电话:(0952)5161642
传真:(0952)5161140
客户服务电话:(0952)5163588
网址:www.xmzq.cn
(90)爱建证券有限责任公司
注册地址:上海市南京西路758号23楼
办公地址:上海市南京西路758号
法定代表人:郭林
电话:(021)32229888
传真:(021)62878701
客户服务电话:(021)63340678
网址:www.ajzq.com
(91)英大证券有限责任公司
注册地址:深圳市福田区深南中路华能大厦三十、三十一层
办公地址: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
电话:(0755)83007041/83007166
传真:(0755)83007034
客户服务电话:4008-698-698、(0755)26982993
网址:www.ydsc.com.cn
(92)华融证券股份有限公司
注册地址: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
法定代表人:宋德清
电话:(010)58568007
传真:(010)58568062
客户服务电话:(010)58568162
网址:www.hrsec.com.cn
(93)财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:石家庄市桥西区自强路35号庄家金融大厦24层
法定代表人:翟建强
电话:(0311)86028442
传真:(0311)66006244
客户服务电话:4006128888
网址:www.s10000.com
(94)天风证券有限责任公司
注册地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
办公地址:湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦四楼
法定代表人:余磊
电话:(027)87618889
传真:(027)87618863
客户服务电话:(027)87618882/(028)86711410/(028)86712334
网址:www.tfzq.com
(95)中天证券有限责任公司
注册地址:沈阳市和平区光荣街23号甲
办公地址:沈阳市和平区光荣街23号甲
法定代表人:李学琦
电话:(024)23266917
传真:(024)23255606
客户服务电话:4006180315
网址:www.stockren.com
(96)大通证券股份有限公司
注册地址:大连市中山区人民路24号
办公地址:大连市沙河口区会展路129号大连期货大厦39层
法定代表人:张智河
电话:(0411)39673301
传真:(0411)39673219
客户服务电话:4008-169-169
网址:www.estock.com.cn
(97)天相投资顾问有限公司
注册地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座4层
法定代表人:林义相
电话:(010)66045608
传真:(010)66045500
客户服务电话:(010)66045678
网址:www.txsec.com/jijin.txsec.com
(98)财富里昂证券有限责任公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
办公地址:上海市浦东新区世纪大道100号 环球金融中心9楼
法定代表人:罗浩
电话:021-38784818
传真:021-68775878
联系人:倪丹
客户服务电话:68777877、021-38784818
公司网站:www.cf-clsa.com
(99)财通证券有限责任公司
注册地址:杭州杭大路15 号嘉华国际商务中心
办公地址:杭州杭大路15 号嘉华国际商务中心
法定代表人:沈继宁
客服电话:0571-96336(浙江),40086-96336(全国)
网址:www.ctsec.com
(100)浙商银行股份有限公司
注册地址:杭州市庆春路288号
办公地址:杭州市庆春路288号
法定代表人:张达洋
电话:(0571)87659009、87659816
传真:(0571)87659826
客户服务电话:95527
(二)注册登记机构
名称:华安基金管理有限公司
住所:上海市浦东新区世纪大道8号上海国金中心二期31层、32层
法定代表人:李勍
电话:(021)38969999
传真:(021)33627962
联系人:赵良
客户服务中心电话:40088-50099
(三)律师事务所和经办律师
名称:通力律师事务所
住所: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)31358600
联系人:秦悦民
经办律师:秦悦民、王利民
(四)会计师事务所和经办注册会计师
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1318号星展银行大厦6楼
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
联系电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办会计师:汪棣、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称:华安行业轮动股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式。

六、基金的投资目标

本基金注重把握行业轮动规律,力求通过行业优化配置,对强势行业的龙头企业和具有估值优势、成长潜力的股票进行重点投资,获取超额收益,实现基金资产的长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括国内依法公开发行上市的股票、债券、货币市场工具、资产支持证券、权证及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。
本基金股票投资占基金资产的比例范围为60%~95%;债券、权证、资产支持证券、货币市场工具及国家证券监管机构允许基金投资的其他金融工具占基金资产的比例范围为5~40%,其中权证投资占基金资产净值的比例范围为0~3%,现金以及到期日在1年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
此外,如法律法规或中国证监会允许基金投资其他品种的,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入本基金的投资范围。

八、基金的投资策略

(一)投资策略
本基金将采用自上而下和自下而上相结合的方法优化行业配置,构建投资组合,并在投资流程中采用公司开发的多因子模型等数量工具进行支持,使其更为科学和客观。
1、资产配置策略
本基金将通过对宏观经济、国家政策等可能影响证券市场的重要因素的研究和预测,利用公司研究开发的多因子动态资产配置模型、基于投资时钟理论的资产配置模型等数量工具,分析和比较股票、债券等市场和不同金融工具的风险收益特征,估计各子资产类的相关性矩阵,并以此为依据,对基金整体资产配置比例进行确定。同时,本基金将定期,或由于宏观经济重大变化不定期地进行资产配置比例调整,以保持基金资产配置的有效性。本基金的股票投资比例为基金资产净值的60%-95%。
2、股票投资策略
本基金的股票资产投资采取行业轮动策略。所谓行业轮动投资策略是指,在宏观分析和个股选择的基础上强调行业的动态优化配置。通过超配不同时期的相对强势行业,获得超越市场平均水平的收益。
(1)行业配置
本基金将基于GICS二级行业分类标准,采用自上而下和自下而上相结合的行业配置方法构建投资组合。所谓自上而下的行业配置是指,通过深入分析宏观经济指标和不同行业自身的周期变化以及在国民经济中所处的位置,确定本基金重点投资的行业,并对行业发展进行预测,以期把握今后一段时间内行业轮动的特征。所谓自下而上的行业配置是指,从上市公司的业绩、估值和市场表现出发,寻找行业中的轮动规律。
本基金采用基本面分析与定量分析相结合的方法,把握以下几种类型的行业轮动周期。
●估值回复型行业轮动。本基金将利用分类行业模型和公司有关研究部门的分析结果提供决策支持,动态地建立起一个包含所有行业的评估系统,数量化地分析各行业与整体经济变动的相关性及各行业自身的周期性,判断和预测行业的相对价值,以及不同行业之间的估值水平差异。A股市场的历史显现出了低估值效应的存在,因此如果追求长期的轮动效果,选择绝对估值或者相对估值较低的行业进行超配是一种不错的选择。
●业绩驱动型行业轮动。行业内个股的基本面信息仍然是决定行业整体表现的重要因素。基金经理根据EPS增长率、ROE等公司财务指标和研究部门提供的公司基本面信息对行业整体的景气程度和业绩表现进行总体把握,识别不同时期的强势行业,把握业绩驱动下的行业轮动特征。
●动量反转型行业轮动。尽管A股市场在个股层面不存在显著的动量效应和反转效应,但根据历史数据的实证分析却发现,行业层面在一个月的周期内表现出显著的动量效应,即前期收益率较高的行业组合在一个月内继续表现强势。行业层面在六个月的周期内表现出显著的反转效应,即前期收益率高的行业组合在六个月后开始走弱。基金经理可根据金融工程部对动量组合和反转组合的测算,把握动量和反转型行业轮动。
(2)个股选择
本基金股票资产以A股市场基本面良好的上市公司为投资对象,基金经理将基于行业配置的要求,对A股市场的股票进行分类和筛选,选择各行业龙头企业和价值被低估的企业作为重点关注对象。对重点公司建立财务模型,预测其未来几年的经营情况和财务状况,在此基础上对公司股票进行估值,以决定是否纳入本基金的投资范围。
●行业龙头企业。行业龙头企业,一般指在该行业里股本、市值、规模、市场占有率居前的代表性企业。这些企业由于规模巨大,市场占有率高,所以其自身发展对全行业有重大影响,往往引领全行业的发展方向和兴衰。
●成长性企业。成长性企业是指那些在较长时期内,具有持续挖掘未利用资源的能力、不同程度地表现出整体扩张的态势、未来发展预期良好的企业。成长型企业具有高增长性、企业活力和适应性、稳定性的特点,该类企业能够为投资者带来可预期收益。
●价值低估企业。基金经理充分利用华安开发的各类股票估价模型和研究部门的研究分析结果,考察影响市场和股票价格变动的诸多因素,综合判断企业的内在价值。如果企业股票的市场价格因为某种原因没能反映其真实价值或潜在价值,则视为价值低估企业。
(3)组合构建
在组合构建的过程中,基金经理着重行业的优化配置,对以下几个方面加以考虑:
●行业间的相关性矩阵。基金经理通过行业间的相关性矩阵分析,在超配强势行业的同时尽可能降低组合风险。
●买卖时机和操作周期。基金经理根据数量分析小组的模型分析和自身判断,把握合适的市场时机和行业的周期性拐点,在预期的操作周期内完成投资组合的构建。
3、债券投资策略
本基金可投资于国债、金融债、企业债和可转换债券等债券品种,基金经理通过对收益率、流动性、信用风险和风险溢价等因素的综合评估,合理分配固定收益类证券组合中投资于国债、金融债、企业债、短期金融工具等产品的比例,构造债券组合。
在选择国债品种中,本产品将重点分析国债品种所蕴含的利率风险和流动性风险,根据利率预测模型构造最佳期限结构的国债组合;在选择金融债、企业债品种时,本基金将重点分析债券的市场风险以及发行人的资信品质。资信品质主要考察发行机构及担保机构的财务结构安全性、历史违约/担保记录等。本基金还将关注可转债价格与其所对应股票价格的相对变化,综合考虑可转债的市场流动性等因素,决定投资可转债的品种和比例,捕捉其套利机会。
4、权证投资策略
本基金在实现权证投资时,将通过对权证标的证券基本面的研究,结合权证定价模型寻求其合理估值水平,谨慎地进行投资,以追求较为稳定的收益。
5、资产支持证券投资策略
本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格遵守法律法规和基金合同基础上,通过信用研究和流动性管理,选择经风险调整后相对价值较高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。
6、其他衍生工具投资策略
本基金将密切跟踪国内各种衍生产品的动向,一旦有新的产品推出市场,将在届时相应法律法规的框架内,制订符合本基金投资目标的投资策略,同时结合对衍生工具的研究,在充分考虑衍生产品风险和收益特征的前提下,谨慎进行投资。
7、基金建仓期
本基金的建仓期不超过6个月。
(二)投资限制
1、禁止用本基金财产从事以下行为
(1)承销证券;
(2)向他人贷款或者提供担保;
(3)从事承担无限责任的投资;
(4)买卖其他基金份额,但是国务院另有规定的除外;
(5)向基金管理人、基金托管人出资或者买卖基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券;
(6)买卖与基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券;
(7)从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动;
(8)依照法律、行政法规有关法律法规规定,由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。
2、基金投资组合比例限制
(1)本基金持有一家上市公司的股票,其市值不超过基金资产净值的10%;
(2)本基金持有一家公司发行的债券不超过基金资产净值的10%;
(3)本基金与基金管理人管理的其他基金持有一家公司发行的证券总和,不超过该证券的10%;
(4)本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;
(5)本基金在任何交易日买入权证的总金额,不超过上一交易日基金资产净值的0.5%,基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%,基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%。法律法规或中国证监会另有规定的,遵从其规定;
(6)现金和到期日不超过1年的政府债券不低于基金资产净值的5%;
(7)本基金持有的全部资产支持证券,其市值不得超过基金资产净值的20%;
(8)本基金持有的同一(指同一信用级别)资产支持证券的比例,不得超过该资产支持证券规模的10%;
(9)本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出;
(10)本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券,不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%;
(11)基金财产参与股票发行申购,本基金所申报的金额不超过基金总资产,本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量;
(12)本基金不得违反《基金合同》关于投资范围和投资比例的约定;
(13)相关法律法规以及监管部门规定的其他限制。
3、若将来法律法规或中国证监会的相关规定发生修改或变更,致使本款前述约定的投资禁止行为和投资组合比例限制被修改或取消,基金管理人在依法履行相应程序后,本基金可相应调整禁止行为和投资限制规定。
(三)基金的融资融券
本基金可以按照国家的有关法律法规规定进行融资、融券。

九、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准=80%×沪深300指数收益率+20%×中国债券总指数收益率
沪深300指数是由中证指数公司开发的中国A股市场统一指数,它的样本选自沪深两个证券市场,覆盖了大部分流通市值,其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的主流投资股票,能够反映A股市场总体发展趋势,具有权威性,适合作为本基金股票投资业绩比较基准。
中国债券总指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制的中国债券指数。该指数同时覆盖了上海证券交易所、银行间以及银行柜台债券市场上的主要固定收益类证券,具有广泛的市场代表性,能够反映债券市场总体走势,适合作为本基金的债券投资业绩比较基准。
如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出,或有更科学客观的权重比例适用于本基金时,本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则,对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致,并在更新的招募说明书中列示。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金,基金的风险与预期收益都要高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金,属于证券投资基金中较高风险、较高收益的品种。

十一、基金投资组合报告

1. 重要提示
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。
基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2012年10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、误导性陈述或者重大遗漏。
本投资组合报告所载数据截至2012年9月30日。
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	600,484,140.44	83.97
	其中:股票	600,484,140.44	83.97
2	固定收益投资	29,013,000.00	4.06
	其中:债券	29,013,000.00	4.06
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	20,000,150.00	2.80
	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	63,955,786.20	8.94
6	其他各项资产	1,669,855.84	0.23
7	合计	715,122,932.48	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	6,706,000.00	0.97
B	采掘业	17,697,571.12	2.56
C	制造业	259,445,228.08	37.60
C0	食品、饮料	17,206,000.00	2.49
C1	纺织、服装、皮毛	1,753,440.00	0.25
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	19,851,871.97	2.88
C5	电子	42,955,810.28	6.23
C6	金属、非金属	8,029,790.47	1.16
C7	机械、设备、仪表	101,522,273.98	14.71
C8	医药、生物制品	68,126,041.38	9.87
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,510,000.00	0.51
F	交通运输、仓储业	8,560,000.00	1.24
G	信息技术业	27,044,605.90	3.92
H	批发和零售贸易	39,273,022.48	5.69
I	金融、保险业	47,867,193.40	6.94
J	房地产业	124,789,015.26	18.08
K	社会服务业	41,686,594.20	6.04
L	传播与文化产业	23,904,910.00	3.46
M	综合类	-	-
	合计	600,484,140.44	87.02

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	000002	万科A	4,000,000	33,720,000.00	4.89
2	600276	恒瑞医药	981,018	29,734,655.58	4.31
3	600048	保利地产	2,500,000	26,900,000.00	3.90
4	600383	金地集团	5,000,000	25,150,000.00	3.64
5	000538	云南白药	363,339	22,599,685.80	3.28
6	601318	中国平安	500,000	20,970,000.00	3.04
7	601601	中国太保	1,002,580	20,282,193.40	2.94
8	600519	贵州茅台	70,000	17,206,000.00	2.49
9	000069	华侨城A	3,000,000	16,800,000.00	2.43
10	600741	华域汽车	1,768,866	16,768,849.68	2.43

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	29,013,000.00	4.20
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	29,013,000.00	4.20

5 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	1101096	11央票96	300,000	29,013,000.00	4.20

6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。
7 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。
8 投资组合报告附注
8.1 本报告期内,本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、处罚的情况。
8.2 本基金投资前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。
8.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	727,852.63
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	67,500.00
4	应收利息	830,340.16
5	应收申购款	44,163.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,669,855.84

8.4 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。
8.5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。

十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责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。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。
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。
(一)基金净值表现
历史各时间段基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较
(截至时间2012年6月30日)

阶段	净值增长率①	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
2012年1月1日至2012年6月30日	5.24%	1.23%	4.11%	1.06%	1.13%	0.17%
2011年1月1日至2011年12月31日	-25.09%	1.15%	-19.51%	1.04%	-5.58%	0.11%
自基金成立(2010年5月11日)至2010年12月31日	14.46%	1.18%	6.98%	1.32%	7.48%	-0.14%

基金的过往业绩并不预示其未来表现。

十三、费用概览

(一)与基金运作有关的费用
1、基金管理人的管理费
基金管理人的基金管理费按基金资产净值的1.5%年费率计提。
在通常情况下,基金管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。计算方法如下:
H=E×1.5%÷当年天数
H 为每日应计提的基金管理费
E 为前一日基金资产净值
基金管理费每日计提,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。
2、基金托管人的基金托管费
基金托管人的基金托管费按基金资产净值的0.25%年费率计提。
在通常情况下,基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%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,按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。
(二)与基金销售有关的费用
1、申购费用
本基金申购费率最高不超过1.5%,且随申购金额的增加而递减。投资者在一天之内如果有多笔申购,适用费率按单笔分别计算。申购费率如下表所示:

单笔申购金额(M)	申购费率
M<100万	1.5%
100万≤M<300万	1.2%
300万≤M<500万	0.8%
M≥500万	每笔1000元

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。
2、赎回费用
本基金的赎回费率最高不超过赎回总金额的0.5%,按持有期递减。本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担,其中不低于25%的部分归入基金财产。具体费率如下:

持有期限(Y)	赎回费率
Y<1年	0.5%
1年≤Y<2年	0.25%
Y≥2年	0

注:1年为365天,2年为730天,依此类推。
3、转换费
基金转换的总费用包括转出基金的赎回费和申购补差费。
转出基金赎回费=转出份额×转出基金当日基金份额净值×转出基金赎回费率
转出金额=转出份额×(转出基金当日基金份额净值-转出基金赎回费
基金转换申购补差费按转入与转出基金之间申购费的差额计算收取,具体计算公式如下:
基金转换申购补差费=max[(转入基金的申购费-转出基金的申购费),0],即转入基金申购费减去转出基金申购费,如为负数则取0
转入金额 = 转出金额—基金转换申购补差费
转入份额 = 转入金额÷转入基金当日基金份额净值
转入份额的计算结果四舍五入保留到小数点后两位。
其中:
转入基金的申购费=[转出金额-转出金额÷(1+转入基金的申购费率)]或转入基金固定收费金额
转出基金的申购费=[转出金额-转出金额÷(1+转出基金的申购费率)]或转出基金固定收费金额
注1:转入份额的计算结果四舍五入,保留到小数点后两位,由此产生的误差计入基金资产。
注2:本基金暂未开通后端收费模式的基金转换业务。
注3:关于转换费用的其它相关条款请详见公司网站的有关临时公告。
(三)其他费用
1、因基金的证券交易或结算而产生的费用(包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、权证交易的结算费及其他类似性质的费用等);
2、基金合同生效以后的信息披露费用;
3、基金份额持有人大会费用;
4、基金合同生效以后的会计师费和律师费;
5、基金资产的资金汇划费用;
6、按照国家有关法律法规规定可以列入的其他费用。
上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规定时从其规定;由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定,按费用支出金额支付,列入或摊入当期基金费用。
(四)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。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。
(五)税收
本基金运作过程中涉及的各纳税主体,依照国家法律法规的规定履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《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》及其他有关法律法规的要求,结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

章节	主要更新内容
三、基金管理人	更新了基金管理人相关信息。
四、基金托管人	更新了基金托管人的相关信息。
五、相关服务机构	更新了部分直销机构和代销机构的信息; 更新了注册登记机构相关信息。
八、基金份额的申购、赎回与转换	对"(一)日常申购、赎回与转换的场所"中部分直销机构进行了更新。
九、基金的投资	更新了本基金最近一期投资组合报告的内容。
十、基金的业绩	对基金合同生效以来的业绩进行了更新。
二十一、对基金投资人的服务	对整章内容进行了更新;
二十二、其他应披露事项	披露了自2012年5月11日至2012年11月11日期间本基金的公告信息。

华安基金管理有限公司
二〇一二年十二月二十五日