（上接D34版）

④）组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资进行日常监督。绩效与风险评估小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析，并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和绩效与风险评估小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行反思，对基金投资组合不断进行调整和优化。

（六）收益率比较基准

本基金的业绩比较基准为：三年期银行定期存款税后收益率。

本基金选择三年期银行定期存款收益率作为业绩比较基准的原因如下：

本基金是保本型基金产品，保本周期为三年，保本但不保证收益率。以三年期银行定期存款税后收益率作为本基金的业绩比较基准，能够使本基金保本受益人理性判断本基金产品的风险收益特征，合理地衡量比较本基金保本保证的有效性。

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，本基金管理人可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，但不需要召开基金份额持有人大会。

（七）风险收益特征

本基金是一只保本混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险和预期收益都比较低的品种。

（八）投资限制

1、组合限制

本基金的投资组合将遵循以下限制：

1、股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、权证和可转换债券等权益类资产合并计算的投资比例为基金资产的0-30%；债券等固定收益类金融工具占基金资产的比例为65%-100%；

自本基金成立起的六个月内，或自新的保本周期的集中申购期末起的六个月内，股票等风险资产的投资比例上限不超过基金资产净值的10%；

2、权证投资比例为基金资产净值的0-3%；

3、债券投资比例不低于基金资产净值的65%；

4、现金以及到期日不超过1年的政府债券合计不低于基金资产净值的5%；

5、本基金投资的债券的信用等级须为AAA级；

6、持有的债券剩余期限不超过保本周期的剩余期限（债券的到期日早于保本周期的到期日）；

7、本基金不投资资产支持证券；

8、本基金不投资地方政府债券；

9、持有一家上市公司的股票，其市值不得超过基金资产净值的10%；

10、本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的10%；

11、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%；

12、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；

13、本基金财产参与股票发行申购，所申报的金额不得超过本基金的总资产，所申报的股票数量不得超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

14、相关法律法规以及监管部门规定的其它投资限制。

本基金投资流通受限证券，将根据中国证监会相关规定，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

如果法律法规对本基金合同约定投资组合比例限制进行变更的，以变更后的规定为准。法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，则本基金投资不再受相关限制。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

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）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

⑥）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门另有规定时从其规定。

三、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

四、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

五、基金投资组合报告（截止2012年9月30日）

本投资组合报告已经基金托管人复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中所列财务数据未经审计。

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	58,969,651.67	6.69
	其中：股票	58,969,651.67	6.69
2	固定收益投资	798,595,946.30	90.54
	其中：债券	798,595,946.30	90.54
	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	12,334,588.13	1.40
6	其他资产	12,088,704.30	1.37
7	合计	881,988,890.40	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	35,777,650.56	5.38
C0	食品、饮料	8,962,458.56	1.35
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	10,787,007.00	1.62
C8	医药、生物制品	16,028,185.00	2.41
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	23,192,001.11	3.48
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	58,969,651.67	8.86

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	002230	科大讯飞	400,000	11,368,000.00	1.71
2	002385	大北农	419,984	8,962,458.56	1.35
3	600750	江中药业	409,500	8,284,185.00	1.24
4	000423	东阿阿胶	200,000	7,744,000.00	1.16
5	300188	美亚柏科	286,207	7,014,933.57	1.05
6	600038	哈飞股份	350,000	5,397,000.00	0.81
7	300024	机器人	229,362	5,390,007.00	0.81
8	002308	威创股份	449,866	4,809,067.54	0.72

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	90,284,000.00	13.57
	其中：政策性金融债	90,284,000.00	13.57
4	企业债券	662,774,238.00	99.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	45,537,708.30	6.84
8	其他	-	-
9	合计	798,595,946.30	120.00

在以上债券资产久期、期限和类属配置的基础上，本基金根据债券市场收益率数据，运用利率模型对单个债券进行估值分析，并结合债券的信用评级、流动性、息票率、税赋、提前偿还和赎回等因素，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

本基金还将深入分析公司债券、企业债券等发行人所处行业发展前景、发展状况、市场地位、财务状况、管理水平和债务水平等因素，并结合内部信用评价模型进一步评价债券发行人的信用风险。为控制基金债券投资的信用风险，本基金投资的企业债券需经国内评估机构进行信用评估，要求其信用评级为投资级以上。如果债券获得主管机构的豁免评级，本基金根据对债券发行人的信用风险分析，决定是否将该债券纳入基金的投资范围。

③）动态增强策略

在以上债券投资策略的基础上，本基金还将根据债券市场的动态变化，采取多种灵活策略，获取超额收益，主要包括：

1）骑乘策略

骑乘策略是指当收益率曲线相对陡峭时，买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着债券剩余期限缩短，债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，获得资本利得收益。

2）息差策略

息差策略是指通过不断正回购融资并持续买入债券的操作，只要回购资金成本低于债券收益率，就可以达到杠杆放大的套利目标。

本基金将根据对市场回购利率走势的判断，适当地选择杠杆比率，谨慎地实施息差策略，提高投资组合的收益水平。

④）可转换债券的投资管理

可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金在对可转换公司债券条款和发行债券公司基本面进行深入分析研究的基础上，利用可转换公司债券定价模型进行估值分析，投资具有较高安全边际（债券剩余本息之和与该可转换公司债券价格的差）和良好流动性的可转换公司债券，获取稳健的投资回报。

为保持债券基金的收益风险特征，本基金可转换公司债券投资不超过基金资产净值的20%。

⑤）资持证券投资策略

本基金通过对资产支持证券的资产池的资产特征进行分析，估计资产违约风险和提前偿付风险，并根据资产证券化的收益结构安排，模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流过程，利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估值。本基金投资资产支持证券时，还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性，控制资产支持证券投资的风险，获取较高的投资收益。

3、股票投资策略

①）新股申购策略

在股票发行市场上，股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价差，从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行（IPO）股票及增发新股的上市公司基本面，根据股票市场整体定价水平，估计新股上市交易的合理价格，同时参考一级市场资金供求关系，制定相应的新股申购策略。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票，将根据其市场价格相对于其合理内在价值的高低，确定继续持有或者卖出。

②）个股精选策略

本基金将适当参与股票二级市场投资，增强基金资产收益。本基金股票投资主要采取自下而上的方式，精选蓝筹类的上市公司，构建投资组合。

本基金所指的蓝筹股是指市值比较大、成交活跃、业绩优良、管理规范、财务稳健、在行业内占有重要支配地位的公司股票。在确定了备选股票的蓝筹特性的基础上，本基金分别从“成长”和“价值”两个方面对备选的股票进行选择，精选出具有较高投资价值的蓝筹股作为重点投资对象。

本基金使用的成长股评价指标，包括但不限于预期当年的营业收入增长率、营业利润增长率、过往的营业收入增长率、营业利润增长率等指标。本基金应用上述指标，选择成长特征鲜明的股票作为深入研究的对象，重点考察上市公司在中短期经营业绩增长的持续性。主要投资估值处于合理水平或被低估的优质成长股作为投资对象。

本基金使用的价值股评价指标，包括但不限于市净率、预期股息收益率、市销率、预期市盈率等指标。从本基金应用上述指标选择价值特征鲜明的股票作为深入研究的对象。然后，本基金通过行业研究、上市公司调研、财务报表分析、国内外同业比较等方法，从中选择基本面较好的优质价值股票作为投资对象。

4、权证投资策略

本基金采用数量化期权定价公式对权证价值进行计算，并结合行业研究员对权证标的证券的估值分析结果，选择具有良好流动性和较高投资价值的权证进行投资。采用的策略包括但不限于下列策略或策略组合：

①）本基金采取现金套利策略，兑现部分标的证券的投资收益，并通过购买该证券认购权证的方式，保留未来股票上涨所带来的获利空间。

②）本基金根据权证与标的证券的内在价值联系，合理配置权证与标的证券的投资比例，构建权证与标的证券的避险组合，控制投资组合的下跌风险。同时，本基金积极发现可能存在的套利机会，构建权证与标的证券的套利组合，获取较高的投资收益。

（四）投资决策依据和投资程序

1、投资决策依据

①）国家有关法律、法规和基金合同的有关规定；

②）国内外宏观经济发展状况、宏观经济政策导向、微观经济运行环境和证券市场发展态势；

③）投资资产的预期收益率及风险水平等。

2、投资决策程序

①）研究与分析

本基金管理人内设研究部，通过对宏观经济状况、货币政策和证券市场情况的分析，制定投资策略和投资建议。

本基金管理人内设绩效与风险评估小组，运用风险模型及监测指标对市场风险实施监控。市场部根据每日基金申购赎回的数据，提供分析报告，供基金经理参考。

②）构建投资组合

投资决策委员会在基金合同规定的投资框架下，决定基金资产配置方案，并审批重大单项投资决定。

基金经理在投资决策委员会的授权下，参考研究部和绩效与风险评估小组的研究分析，制定基金的投资策略，在其权限范围内进行基金的日常投资组合管理工作。

③）交易

基金经理制定具体的操作计划并通过交易系统或书面指令形式向中央交易室发出交易指令。中央交易室依据投资指令具体执行买卖操作，并将指令的执行情况反馈给基金经理。

④）组合监控与调整

基金经理负责向投资决策委员会汇报基金投资执行情况。监察部对基金投资进行日常监督。绩效与风险评估小组定期对基金投资进行绩效评估和风险分析，并通过监察部呈报给合规审查与风险控制委员会及督察长办公室、投资决策委员会、基金经理及相关人员。在监察部和绩效与风险评估小组提供的绩效评估和风险分析报告的基础上，基金经理定期对证券市场变化和基金投资阶段成果和经验进行反思，对基金投资组合不断进行调整和优化。

（五）业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：中信标普国债指数收益率＊85%+沪深300指数收益率＊10%+银行活期存款税后收益率＊5%。

中信标普国债指数是由全球著名指数提供商标准普尔和中信证券共同设立的独立合资公司中信标普指数信息服务有限公司提供。中信标普国债样本涵盖了上海证券交易所交易的国债品种，交易所的国债交易连续，反映了市场利率的变化，能够标示出利率市场的整体收益风险水平。

沪深300指数是在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的成份股指数。沪深300指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性，能够充分反映A股市场整体走势。

若未来市场发生变化导致此业绩比较基准不再适用或有更加适合的业绩比较基准，基金管理人有权根据市场发展状况及本基金的投资范围和投资策略，调整本基金的业绩比较基准，并报中国证监会备案。

（六）风险收益特征

本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和预期收益水平高于货币市场基金和中短期债券基金，低于混合型基金和股票型基金。

（七）投资限制

1、本基金通过分散投资降低基金资产的非系统性风险，同时保持基金资产良好的流动性。本基金的投资组合遵循下列规定：

①）本基金持有一家上市公司的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票），其市值不超过基金资产净值的10%；

②）本基金投资于同一家公司发行的债券的比例合计不得超过基金资产净值的10%；

③）本基金与由基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

④）本基金投资于债券类资产的比例不低于基金资产的80%；投资于股票、权证等权益类证券的比例不高于基金资产的20%；持有现金或到期日在一年之内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%；

⑤）在全国银行间市场进行债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%；

⑥）本基金投资可转换公司债券的比例不超过基金资产净值的20%；

⑦）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%；

⑧）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

⑨）同一基金管理人管理的全部证券投资基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过各类资产支持证券合计规模的10%；

⑩）本基金持有的全部资产支持证券，市值不超过本基金资产净值的20%；

⑪）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上（含BBB）的债券或资产支持证券。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；

⑫）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%，本基金持有的全部权证，其市值不得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%；

⑬）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，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。

本基金投资流通受限证券，将根据中国证监会相关规定，制订严格的投资决策流程和风险控制制度，防范流动性风险、法律风险和操作风险等各种风险。

如法律法规或监管部门取消上述限制性规定，本基金将不受上述规定的限制。法律法规或监管部门对上述比例限制另有规定的，本基金将从其规定。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。

基金管理人应当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。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

2、禁止行为

为维护基金份额持有人的合法权益，本基金禁止从事下列行为：

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，但法律法规或监管部门另有规定的除外；

⑤）向其基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；

⑥）买卖与其基金管理人、基金托管人有控股关系的股东或者与其基金管理人、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、行政法规有关规定，由国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

法律法规或监管部门另有规定时从其规定。

三、基金管理人代表基金行使股东权利的处理原则及方法

1、基金管理人按照国家有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金份额持有人的利益；

2、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；

3、有利于基金财产的安全与增值；

4、不通过关联交易为自身、雇员、授权代理人或任何存在利害关系的第三人牟取任何不当利益。

四、基金的融资、融券

本基金可以按照国家的有关规定进行融资、融券。

五、基金投资组合报告（截止2012年9月30日）

本投资组合报告已经基金托管人复核，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。本报告中所列财务数据未经审计。

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	58,969,651.67	6.69
	其中：股票	58,969,651.67	6.69
2	固定收益投资	798,595,946.30	90.54
	其中：债券	798,595,946.30	90.54
	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	12,334,588.13	1.40
6	其他资产	12,088,704.30	1.37
7	合计	881,988,890.40	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	35,777,650.56	5.38
C0	食品、饮料	8,962,458.56	1.35
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	-	-
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	10,787,007.00	1.62
C8	医药、生物制品	16,028,185.00	2.41
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	23,192,001.11	3.48
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	58,969,651.67	8.86

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	002230	科大讯飞	400,000	11,368,000.00	1.71
2	002385	大北农	419,984	8,962,458.56	1.35
3	600750	江中药业	409,500	8,284,185.00	1.24
4	000423	东阿阿胶	200,000	7,744,000.00	1.16
5	300188	美亚柏科	286,207	7,014,933.57	1.05
6	600038	哈飞股份	350,000	5,397,000.00	0.81
7	300024	机器人	229,362	5,390,007.00	0.81
8	002308	威创股份	449,866	4,809,067.54	0.72

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	90,284,000.00	13.57
	其中：政策性金融债	90,284,000.00	13.57
4	企业债券	662,774,238.00	99.59
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	45,537,708.30	6.84
8	其他	-	-
9	合计	798,595,946.30	120.00

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	126014	08国电债	758,840	71,596,554.00	10.76
2	126011	08石化债	750,000	71,587,500.00	10.76
3	088023	08晋煤债1	700,000	71,162,000.00	10.69
4	098027	09津城投2	700,000	69,489,000.00	10.44
5	122092	11大秦01	626,060	63,476,223.40	9.54

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出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

②）报告期内本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

③）其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	13,152.81
2	应收证券清算款	1,832,811.70
3	应收股利	-
4	应收利息	10,235,913.59
5	应收申购款	6,826.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,088,704.30

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	113001	中行转债	31,706,836.80	4.76

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。

六、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，投资人申购基金时应认证阅读本招募说明书。有关业绩数据经托管人复核。

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
2011-5-31至2011-12-31	1.50%	0.09%	2.84%	0.01%	-1.34%	0.08%
2012-1-1至2012-6-30	3.35%	0.08%	2.34%	0.02%	1.01%	0.06%
2012-1-1至2012-9-30	3.45%	0.11%	3.52%	0.01%	-0.07%	0.10%

注：本基金合同于2011年5月31日生效。

第九节 基金的费用

（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；

②）基金托管人的托管费；

③）基金财产拨划支付的银行费用；

④）基金合同生效后的基金信息披露费用；

⑤）基金份额持有人大会费用；

⑥）基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；

⑦）基金的证券交易费用；

⑧）依法可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年管理费率÷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，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

2、基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.2%年费率计提。计算方法如下：

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

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，经基金托管人复核后于次月首日起5个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

到期选择期及过渡期内，本基金不计提管理费和托管费。

若保本周期到期后，本基金不符合保本基金存续条件，基金份额持有人将所持有本基金份额转为变更后的“银河强化收益债券型证券投资基金”的基金份额，管理费按前一日基金资产净值的0.7%的年费率计提，托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。计算方法同上，此项调整无需召开基金份额持有人大会。

3、保证费：0.2%，保证费用由基金管理人从基金管理费收入中列支。

4、除管理费和托管费之外的基金费用，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）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。基金管理人必须最迟于新的费率实施日2日前在指定媒体上刊登公告。

第十节 对招募说明书更新部分的说明

银河保本混合型证券投资基金本次更新招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关法规及《银河保本混合型证券投资基金基金合同》进行更新编写，更新的内容主要包括以下几部分：

1、第四节 基金托管人”根据实际情况进行了更新。

2、第六节 相关服务机构”2、场外代销机构增加了（4）兴业银行股份有限公司，（5）东莞农村商业银行股份有限公司，（6）平安银行股份有限公司，其他情况根据实际情况进行更新。

3、第十三节 基金的投资”更新了“基金投资组合报告”，本报告截止日为2012年9月30日，该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但未经审计；更新了“基金的业绩”，对基金成立以来至2012年9月30日的基金业绩表现进行了披露。该部分内容均按有关规定编制，并经基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

4、第二十七节 其他应披露事项”中列示了本报告期内本基金及本基金管理公司在指定报纸上披露的临时报告。

银河基金管理有限公司

二〇一三年一月十一日

证券代码：600503　证券简称：华丽家族　公告编号：临2013-006

华丽家族股份有限公司
关于公司股东减持公司股份的公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

2013年1月10日，本公司分别接到控股股东上海南江（集团）有限公司（以下简称“南江集团”）和股东暂暂投资有限公司（简称“暂暂投资”）的通知，具体内容如下：

1、2012年1月10日，南江集团通过上海证券交易所大宗交易系统累计减持所持有的本公司股份56,000,000股，成交价格为4.59元，占公司总股本的4.92%。

2、2012年1月10日，暂暂投资通过上海证券交易所大宗交易系统减持所持有的本公司股份953,800股，成交价格为4.59元，占公司总股本的0.08%。

截止本公告日，南江集团仍持有本公司164,732,014股股份，占公司总股本的14.46%；暂暂投资仍持有本公司56,499,808股股份，占本公司总股本4.96%。

按照有关规定，南江集团和暂暂投资委托本公司代为履行公告义务。

特此公告。

华丽家族股份有限公司董事会

二〇一三年一月十日

证券代码：600503　证券简称：华丽家族　公告编号：临2013-007

华丽家族股份有限公司
公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。

2013年1月10日，本公司接到控股股东上海南江（集团）有限公司（以下简称“南江集团”）的通知，具体内容如下：

南江集团于2012年9月3日与中国银河证券股份有限公司（以下简称“银河证券”）签订约定购回式证券交易客户协议，原约定购回期限为182天，经与银河证券签订约定购回式证券交易延期购回申请书，现约定购回期限为365天。

按照有关规定，南江集团委托本公司代为履行公告义务。

特此公告。

华丽家族股份有限公司董事会

二〇一三年一月十日

华丽家族股份有限公司
简式权益变动报告书

上市公司名称：华丽家族股份有限公司

股票上市地点：上海证券交易所

股票简称：华丽家族

股票代码：600503

信息披露义务人：上海南江（集团）有限公司

暂暂投资有限公司

注册地址：上海市闸北区天目中路380号401室

拉萨市金珠西路189号426室

通讯地址：上海市虹桥路2272号3楼K座

拉萨市金珠西路189号426室

联系电话：021-62366236

0891-6868469

邮政编码：200336

850030

股份变动性质：减少

签署日期：二〇一三年一月十日

信息披露义务人声明

1、信息披露义务人依据《中华人民共和国公司法》（简称“公司法”）、《中华人民共和国证券法》（简称“证券法”）、《上市公司收购管理办法》（简称“收购办法”）、《公开发行证券公司信息披露内容与格式准则第15号——权益变动报告书》（简称“15号准则”）及相关的法律、法规编制本报告书。

2、信息披露义务人签署本报告已获得必要的授权和批准，其履行亦不违反信息披露义务人章程或内部规则中的任何条款，或与之相冲突。

3、依据《证券法》、《收购办法》规定，本报告书已全面披露信息披露义务人在华丽家族股份有限公司中拥有权益的股份变动情况。

截至本报告书签署之日，除本报告书披露的信息外，信息披露义务人没有通过任何其他方式增加或减少其在华丽家族股份有限公司中拥有权益的股份。

4、本次权益变动是根据本报告所载明的资料进行的。信息披露义务人没有委托或者授权其他任何人提供未在本报告书中列载的信息和对本报告书做出任何解释或者说明。

第一节　释义

在本报告书中，除非文中另有所指，下列词语具有如下涵义：

华丽家族、上市公司	指 华丽家族股份有限公司
信息披露义务人、南江集团及暂暂投资	指 上海南江（集团）有限公司及暂暂投资有限公司
本次股份变动	指 2013年1月10日上海南江（集团）有限公司及暂暂投资有限公司通过上海证券交易所证券大宗交易系统累减持华丽家族56,953,800股股份的权益变动行为。
本报告书	指 华丽家族股份有限公司简式权益变动报告书
元	指 人民币元

第二节　信息披露义务人介绍

一、信息披露义务人的基本情况

南江集团：

（一）名称：上海南江（集团）有限公司

（二）注册地址：上海市闸北区天目中路380号401室

（三）住所：上海市虹桥路2272号3楼K座

（四）法人代表：王伟林

（五）注册资本：人民币陆千万元

（六）注册号码：310000000022010

（七）经济性质：有限责任公司（国内合资）

（八）主要股东：王伟林　出资比例　90%

刘雅娟　出资比例　10%

（九）主营业务：实业投资，科技服务，投资管理，室内设计，物业管理，国内贸易（上述经营范围涉及许可证经营的凭许可证经营）。

（十）成立日期：一九九三年七月十六日

（十一）邮编：200336

（十二）通讯地址：上海市虹桥路2272号3楼K座

（十三）联系电话：021-62366236

暂暂投资：

（一）名称：暂暂投资有限公司

（二）注册地址：拉萨市金珠西路189号426室

（三）住所：拉萨市金珠西路189号426室

（四）法定代表人：王伟林

（五）注册资本：6000万元

（六）注册号码：54000020006393

（七）经济性质：有限责任公司（自然人投资或控股）

（八）主要股东：王伟林　出资比例　90%

刘雅娟　出资比例　10%

（九）主要经营范围：许可经营范围：投资管理（凭行业许可部门有效资质证经营）。一般经营项目：投资管理咨询；企业管理与咨询；商务咨询；市场营销策划；企业形象策划；展览展示服务；会务服务。（上述范围中，国家法律、行政法规和国务院决定规定必须报经批准的，凭许可证在有效期内经营）

（十）成立日期：二〇一一年十二月二十一日

（十一）邮编：850030

（十二）通讯地址：拉萨市金珠西路189号426室

（十三）联系电话：0891-6868469

二、信息披露义务人董事及其主要负责人的基本情况：

姓名	职务	国籍	居住地	其他国家或地区居留权
王伟林	执行董事	中国	上海市	无
刘雅娟	监事