

(上港B306)
联系人: 于洋
联系电话: 021-63258888
传真: 021-63234173
客户服务电话: 021-962506或408888666
网址: www.dhq.com.cn
6) 华信证券有限责任公司
注册地址: 福州市五四路157号新天地大厦7、8层
办公地址: 福州市五四路157号新天地大厦7层501室
法定代表人: 黄真
邮政编码: 350003
联系人: 陈琳
联系电话: 0591-87386323
总务传真: 0591-87386310
联系人: 陈琳
联系电话: 0591-87386323 (福建省外语语种0591)。
公司网址: www.hxjq.com.cn
C. 第三中介机构
1) 长城基金销售有限公司
注册地址: 深圳市罗湖区深南东路304号发展银行大厦25楼J单元
法定代表人: 林锋
联系电话: 40067-888788
传真: 0755-82087988
联系人: 陈静
网址: www.cgsw.com, www.jinmoo.com
2) 诺安正行(上海)基金销售有限公司
办公地址: 上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心8楼801室
法定代表人: 李庆
联系电话: 400-821-5399
传真: 021-50687777
网址: www.nobankfund.com
3) 杭州米家基金销售有限公司
注册地址: 浙江省杭州市滨江区长河路588号恒华大厦12楼
法定代表人: 陈柏
联系电话: 0571-56666112
联系人: 王楠
网址: www.miafund.com
4) 江苏银行股份有限公司
办公地址: 北京市西城区金融大街5号新盛大厦4层
法定代表人: 林义相
联系电话: 010-66406678
传真: 010-66405227
联系人: 王颖
网址: www.jsbnc.com
5) 上海良信基金销售有限公司
办公地址: 上海市浦东新区浦东南路437号招商银行大厦16层
法定代表人: 张俊伟
联系电话: 400-089-1289
联系人: 邵文婧
电话: 021-58786788-8201
网址: www.liangxinfund.com
6) 东方财富证券股份有限公司
办公地址: 上海市浦东新区峨山路1188号东方财富大厦906-906室
法定代表人: 陈宏
联系电话: 400-700-9665
传真: 021-50528989
联系人: 李芳
电话: 021-58786788-8201
网址: www.eastmoney.com
7) 北京国信基金销售有限公司
办公地址: 北京市朝阳区望京东路2号国信大厦10层
法定代表人: 闫喆
联系电话: 010-6202 0888 转8882
联系人: 高静
联系电话: 400-888-6661
8) 上海天天基金销售有限公司
住所: 上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址: 上海市徐汇区龙田路195号文鼎10楼
法定代表人: 其实
联系电话: 020-87999927
网址: www.123456.com.cn
基金管理人可根据有关法律法规要求, 根据实情, 选择其他符合要求的机构代理销售本基金或变更上述代销机构, 并提前公告。

法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具或品种, 基金管理人可在履行适当程序后, 将其纳入投资范围。法律法规和中国证监会允许基金投资品种的比例限制, 基金管理人可相应调整本基金的投资比例上限规定, 不需经基金份额持有人大会审议。

八、基金的投资策略

(一) 投资策略
本基金的投资策略分为两个层次, 第一层次是“自上而下”的资产配置策略, 第二层次是“自下而上”的选股策略, 主要投资于具有竞争力比较优势和持续增长潜力的自主创新类上市公司中价值相对被低估的股票。在充分控制投资风险的基础上, 通过积极主动的投资管理, 为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

1. 资产配置策略
本基金主要根据宏观经济、政策环境、利率走势、市场技术指标、市场资金构成及相关性情况, 运用定性定量相结合的分析手段, 对证券市场所处的系统风险以及未来一段时期内各大类资产的风险和预期收益进行分析评估, 并据此制定本基金资产、债券、现金类资产之间的配置比例, 跟踪策略和调整策略。

2. 股票投资策略
本基金主要投资于自主创新类上市公司, 所投资的自主创新类上市公司包括两类: 高新技术产业创新类上市公司和传统产业转型升级类上市公司。本基金重点投资于具有核心技术、商业模式领先、业绩优良、估值合理的股票。在充分控制投资风险的基础上, 通过积极主动的投资管理, 为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。

3. 债券投资策略
本基金的投资策略采用久期控制下的主动投资策略, 本基金风险收益相匹配、流动性管理的原则确定债券各类资产的配置比例, 在严格控制上, 本基金综合运用利率预期、收益率曲线估值、信用等因素分析, 流动性估值等方法来评估各个券的投资价值。

4. 权证投资策略
本基金权证投资将遵循避险投资策略, 权证投资策略主要为有利于基金资产增值, 有利于加强基金风险控制。本基金权证投资中将针对证券的基本面进行研究, 同时综合考虑权证定价模型、市场供求关系、交易制度设计等多种因素对权证进行定价, 主要运用的投资策略为: 杠杆交易策略、对冲保值组合投资策略、买入跨式投资策略、DELTAT 对冲策略等。

(二) 风险控制策略
1) 风险控制策略
(1) 国家有关法律、法规和基金合同的相关规定;
(2) 国家宏观经济政策、金融政策、货币政策、财政政策、利率政策、汇率政策、证券市场政策、产业政策等;
(3) 货币政策的变动;
(4) 利率变动与通货膨胀预期;
(5) 地区及行业突发事件;
(6) 上市公司价值变化;
(7) 国际及国内著名研究机构的研究报告。

2) 风险管理
本基金的投资主要参照以下流程进行运作, 在有效控制投资风险的前提下, 为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值:
(1) 行业研究小组的研究员通过自身研究以及借助外部研究机构的研究成果, 形成宏观、策略方面的研究报告, 为基金资产配置提供决策支持;
(2) 投资决策委员会依据基金管理人提供的研究报告建议投资策略原则与方向, 即确定股票、债券以及现金等大类资产之间的配置比例, 确定基金资产分配的规模和未来资产配置策略;

(3) 基金管理人根据研究报告和行业研究小组的研究成果, 再结合行业研究小组的投资策略报告以及自己对市场判断的, 确定行业配置比例及个股、行业、构建股票投资组合, 再通过Barr Alpha 风险管理系统优化分析以及基金管理人的风险控制小组进一步调整策略;

(4) 基金管理人根据资产配置策略和基金资产的流动性基础上, 构建投资组合;
(5) 交易室按有关交易规则执行交易指令, 并将有关信息反馈给基金经理;
(6) 公司风险控制研究员负责对基金投资组合进行风险监控, 风险预警以及投资组合评估;
(7) 公司风险控制研究员负责定期或不定期向投资决策委员会、投资决策、基金管理人提供基金业绩评估报告, 基金管理小组对于投资决策委员会和风险管理小组认为具有较大风险的投资品种及时改进方案, 并必须在规定的时间内向投资决策小组汇报;

(8) 监察稽核部对投资流程的合法合规性进行审核。

九、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
本基金的投资范围以内沪深300指数为业绩比较基准, 沪深300指数选择我国最具规模、流动性较强、基本面良好的1000只上市公司股票作为样本, 充分反映了A股市场的行业构成, 涵盖了沪深A股市场的总体趋势, 同时该指数还具有编制方法透明、样本调整规则清晰等特点, 是目前市场上较有影响力的股票业绩比较基准。

中证综合债指数的选择债券的信用级别覆盖全面, 期限构成宽泛, 能较好地反映我国债券市场的整体价格变动趋势, 因此选择该指数作为衡量基金业绩的基准。如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准出现, 或者市场上出现更加适合用于本基金业绩比较的业绩比较基准, 本基金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。

十、基金的风险收益特征
本基金属于股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十一、基金的投资组合报告(未审计)
本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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 已于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值增长率和投资组合报告等内容, 保证本报告真实、准确、完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告中所列财务数据截至2013年3月31日(未经审计)。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	448,121,086.03	77.40
2	固定收益投资	448,121,086.02	77.40
3	固定收益投资	3,155,356.80	0.54
4	其中: 债券	3,155,356.80	0.54
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	其他资产	—	—
10	合计	578,973,082.35	100.00

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	采矿业	—	—
C	制造业	271,380,168.80	47.33
D	电力、热力、燃气及供水和供应业	11,672,103.00	2.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	22,239,653.78	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	14,341,881.44	2.50
J	金融业	102,428,024.66	17.86
K	房地产业	8,177,600.00	1.43
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	17,882,457.34	3.12
S	综合	—	—
	合计	448,121,086.02	78.16

本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预示其未来表现, 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。
1. 本基金基金合同生效以来的投资组合比例情况如下表所示(本报告所载数据未经审计):

成立时间	净值增长率	标准差		收益排名	业绩比较基准收益	1-3	2-4
		率1	标准差2				
2008年10月10日至2008年12月31日	1.60%	0.17%	-5.45%	2.28%	7.05%	-	-2.11%
2009年1月1日至2009年12月31日	70.14%	1.76%	67.59%	1.54%	2.55%	0.22%	-
2010年1月1日至2010年12月31日	-7.38%	1.62%	-8.46%	1.19%	1.08%	0.43%	-
2011年1月1日至2011年12月31日	-31.28%	1.36%	-18.00%	0.98%	-13.28%	0.38%	-
2012年1月1日至2012年12月31日	11.21%	0.95%	6.95%	0.96%	4.20%	-0.01%	-
2013年1月1日至2013年3月31日	3.87%	1.44%	-0.37%	1.17%	4.24%	0.27%	-
自基金合同生效至2013年3月31日	27.16%	1.42%	26.73%	1.27%	0.37%	0.15%	-

2. 本基金合同生效以来基金资产净值增长率, 并同期业绩比较基准的变动情况进行比较:
基金合同生效以来基金资产净值增长率与同期业绩比较基准收益变动对比图(未审计)



注: 本基金基金合同生效以来基金资产净值增长率, 并同期业绩比较基准的变动情况进行比较:
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预示其未来表现, 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。

十二、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
本基金的投资范围以内沪深300指数为业绩比较基准, 沪深300指数选择我国最具规模、流动性较强、基本面良好的1000只上市公司股票作为样本, 充分反映了A股市场的行业构成, 涵盖了沪深A股市场的总体趋势, 同时该指数还具有编制方法透明、样本调整规则清晰等特点, 是目前市场上较有影响力的股票业绩比较基准。

中证综合债指数的选择债券的信用级别覆盖全面, 期限构成宽泛, 能较好地反映我国债券市场的整体价格变动趋势, 因此选择该指数作为衡量基金业绩的基准。如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准出现, 或者市场上出现更加适合用于本基金业绩比较的业绩比较基准, 本基金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。

十三、基金的风险收益特征
本基金属于股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十四、基金的投资组合报告(未审计)
本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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 已于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值增长率和投资组合报告等内容, 保证本报告真实、准确、完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告中所列财务数据截至2013年3月31日(未经审计)。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	448,121,086.03	77.40
2	固定收益投资	448,121,086.02	77.40
3	固定收益投资	3,155,356.80	0.54
4	其中: 债券	3,155,356.80	0.54
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	其他资产	—	—
10	合计	578,973,082.35	100.00

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	采矿业	—	—
C	制造业	271,380,168.80	47.33
D	电力、热力、燃气及供水和供应业	11,672,103.00	2.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	22,239,653.78	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	14,341,881.44	2.50
J	金融业	102,428,024.66	17.86
K	房地产业	8,177,600.00	1.43
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	17,882,457.34	3.12
S	综合	—	—
	合计	448,121,086.02	78.16

本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预示其未来表现, 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。

十四、基金的投资组合报告(未审计)
本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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 已于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值增长率和投资组合报告等内容, 保证本报告真实、准确、完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告中所列财务数据截至2013年3月31日(未经审计)。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	448,121,086.03	77.40
2	固定收益投资	448,121,086.02	77.40
3	固定收益投资	3,155,356.80	0.54
4	其中: 债券	3,155,356.80	0.54
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	其他资产	—	—
10	合计	578,973,082.35	100.00

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	采矿业	—	—
C	制造业	271,380,168.80	47.33
D	电力、热力、燃气及供水和供应业	11,672,103.00	2.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	22,239,653.78	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	14,341,881.44	2.50
J	金融业	102,428,024.66	17.86
K	房地产业	8,177,600.00	1.43
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	17,882,457.34	3.12
S	综合	—	—
	合计	448,121,086.02	78.16

本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预示其未来表现, 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。

十五、基金的业绩比较基准
本基金的业绩比较基准为: 沪深300指数收益率×75%+中证综合债指数收益率×25%
本基金的投资范围以内沪深300指数为业绩比较基准, 沪深300指数选择我国最具规模、流动性较强、基本面良好的1000只上市公司股票作为样本, 充分反映了A股市场的行业构成, 涵盖了沪深A股市场的总体趋势, 同时该指数还具有编制方法透明、样本调整规则清晰等特点, 是目前市场上较有影响力的股票业绩比较基准。

中证综合债指数的选择债券的信用级别覆盖全面, 期限构成宽泛, 能较好地反映我国债券市场的整体价格变动趋势, 因此选择该指数作为衡量基金业绩的基准。如果今后法律法规发生变化, 或者有更权威、更能为市场普遍接受的业绩比较基准出现, 或者市场上出现更加适合用于本基金业绩比较的业绩比较基准, 本基金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。

十六、基金的风险收益特征
本基金属于股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

十七、基金的投资组合报告(未审计)
本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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 已于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值增长率和投资组合报告等内容, 保证本报告真实、准确、完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告中所列财务数据截至2013年3月31日(未经审计)。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	448,121,086.03	77.40
2	固定收益投资	448,121,086.02	77.40
3	固定收益投资	3,155,356.80	0.54
4	其中: 债券	3,155,356.80	0.54
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产	—	—
8	其中: 买断式回购的买入返售金融资产	—	—
9	其他资产	—	—
10	合计	578,973,082.35	100.00

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	采矿业	—	—
C	制造业	271,380,168.80	47.33
D	电力、热力、燃气及供水和供应业	11,672,103.00	2.04
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	22,239,653.78	3.88
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息技术、软件和信息技术服务业	14,341,881.44	2.50
J	金融业	102,428,024.66	17.86
K	房地产业	8,177,600.00	1.43
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	17,882,457.34	3.12
S	综合	—	—
	合计	448,121,086.02	78.16

本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预示其未来表现, 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。

十六、基金的投资组合报告(未审计)
本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。
本基金的托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定, 已于2013年4月17日复核了本报告中的财务指标、净值增长率和投资组合报告等内容, 保证本报告真实、准确、完整, 不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。
本报告中所列财务数据截至2013年3月31日(未经审计)。

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	448,121,086.03	77.40
2	固定收益投资	448,121,086.02	77.40
3	固定收益投资	3,155,356.80	0.54
4	其中: 债券	3,155,356.80	0.54
5	资产支持证券	—	—
6	金融衍生品投资	—	—
7	买入返售金融资产		