（上接D26版）

（74）中信建投证券限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：张佑君
开放式基金咨询电话：4008888108
开放式基金业务传真：（010）65182261
公司网站：中信建投证券网 www.csc108.com
（75）中信金通证券有限责任公司
公司注册地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
公司办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法人代表：沈强
邮政编码：310052
联系人：丁思聪
联系电话：0571-96598
公司网站：www.bigsun.com.cn
（76）中信证券股份有限公司
住址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦A层
法定代表人：王东明
电话：010-84588888
传真：010-84865560
联系人：陈忠
公司网址：www.ecitic.com
（77）中原证券股份有限公司
注册地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号
法定代表人：石保上
联系人：程月艳、耿铭
联系电话：0371—65585670
联系传真：0371—65585665
客服电话：967218（郑州市外客户需要加拨区号）、400-813-9666
网址：www.ccnew.com
（78）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 邮编：100140
办公地址：北京市西城区金融街5号新盛大厦B座4层 邮编：100140
法定代表人：林义相
联系电话：010-66045608
客服电话：010-66045678
传真：010-66045500
联系人：林爽
天相基金网网址：http://jijin.txsec.com
基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。
（二）注册登记机构
名称：汇添富基金管理有限公司
住所：上海市黄浦区大沽路288号6幢538室
办公地址：上海市富城路99号震旦国际大楼21楼
法定代表人：桂水发
电话：（021）28932888
传真：（021）28932998
联系人：王小练
（三）律师事务所和经办律师
名称：上海市通力律师事务所
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
经办律师：吕红、黎明
联系人：吕红
（四）会计师事务所和经办注册会计师
名称：安永华明会计师事务所
法定代表人：葛明
住所：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
办公地址：北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼16层
邮政编码：100738
公司电话：010）58153000
公司传真：010）58188298
签章会计师：徐艳、汤骏
业务联系人：汤骏

四、基金的名称

本基金名称：汇添富医药保健股票型证券投资基金。

五、基金的类型

本基金为契约型开放式股票型基金。

六、基金的投资目标

本基金采用自下而上的投资方法，精选医药保健行业的优质上市公司，在科学严格管理风险的前提下，谋求基金资产的中长期稳健增值。

七、基金的投资方向

本基金的投资范围为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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规或中国证监会以后允许基金投资其他品种，本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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的60%—95%；债券资产、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的5%—40%，其中，基金持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%，基金保留的现金或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%。

本基金将沪深两市中从事医药保健行业的上市公司定义为医药保健行业上市公司，具体包括以下两类公司：①主营业务从事医药保健行业（涵盖医药原料、化学原料药及制剂、医药中间体、中药材、中药饮片、中成药、抗生素、生物制品、生化药品、放射性药品、医疗器械、卫生材料、制药机械、药用包装材料、医药商业及医疗服务等）的公司；②当前非主营业务提供的产品或服务隶属于医药保健行业，且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的公司。

本基金以医药保健行业上市公司为股票主要投资对象，投资于医药保健行业上市公司股票的资产占股票资产的比例不低于80%。

八、基金的投资策略

（一）投资策略

本基金为股票型基金。股票投资的主要策略包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略用于挖掘医药保健行业中具有长期持续增长模式、估值水平相对合理的优质上市公司。

1、资产配置策略

本基金综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素（其中，基本面因素包括国民生产总值、居民消费价格指数、工业增加值、失业率水平、固定资产投资总量、发电量等宏观经济统计数据；政策面因素包括存款准备金率、存贷款利率、再贴现率、公开市场操作等货币政策、政府购买总量、转移支付水平以及税收政策等财务政策；市场面因素包括市场参与者情绪、市场资金供求变化、市场PE与历史平均水平的偏离程度等），结合全球宏观经济形势，研判国内经济的发展趋势，并在严格控制投资组合风险的前提下，确定或调整投资组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他品种的投资比例。

2、个股精选策略

首先，按照本基金有关医药保健行业上市公司的定义以及本基金管理人投资管理制度要求和股票投资限制，针对沪深两市医药保健行业的全部上市公司，剔除其中不符合投资要求的股票（包括但不限于法律法规或公司制度明确禁止投资的股票、涉及重大案件和诉讼的股票等），筛选得到的公司组成本基金的初选股票库。初选股票库将不定期地更新，动态纳入符合本基金有关定义并符合投资要求的医药保健行业上市公司。

其次，在初选股票库的基础上，本基金管理人采取定性分析的方法，结合医药保健行业的特点，分别从内生增长（即通过技术进步、自身经营、垄断优势等方面来促进业绩的增长）和外延增长（即通过诸如整体上市、并购重组等方式实现公司经营规模的扩张和竞争力的提升）两方面进行深入分析，评估备选公司的行业特征、经营状况、财务数据、业绩驱动因素等，从中选择具有核心竞争优势和长期持续增长模式的公司，组成本基金的精选股票库。具体如下：

① 内生增长分析

1）技术进步——从产品创新、服务创新、技术引进和技术创新等方面分析备选公司在医药保健行业中的优势和增长潜力。

2）自身经营——从管理体制、组织结构、营销方式、业务流程、成本控制、品牌、企业文化等方面研判是否有利于备选公司经营效率的提高。

3）垄断优势——从技术壁垒、政策壁垒、资源壁垒等方面研判备选公司是否可以获得高于医药保健行业平均水平的利润并实现低成本扩张。

② 外延增长分析

1）整体上市——发掘医药保健行业中可能整体上市的备选公司（包括集团公司将其主要资产和业务整体改制为股份公司进行上市，或将相关资产通过合适方式全部注入到旗下上市公司等），研判其是否可以借机实现公司经营规模扩张、业绩增长和估值溢价。

2）并购重组——密切跟踪医药保健行业中可能发生的并购（包括横向并购、产业链上下游之间的纵向并购、横向纵向结合或无直接关系的混合并购）、战略参股（指上市公司引进具有高级经营管理经验或财务管理能力的外资战略伙伴）、剥离（指为集中力量做大做强主业而将企业的一部分次要或亏损经营或无关投资性资产出售给第三方）等事件，研判备选公司是否可以借机在管理、资金、产品研发、质量控制、营销能力等方面提升竞争力。

然后，在精选股票库中的基础上，本基金管理人采取定量分析的方法，从内在价值、相对价值、收购价值等方面，考察市盈增长比率（PEG）、市净率（PB）、企业价值/息税前利润（EV/EBIT）、企业价值/息税、折旧、摊销前利润（EV/EBITDA）、自由现金流贴现（DCF）等一系列估值指标，给出股票综合评级，从中选择估值水平相对合理的公司，组成本基金的核心股票库。

最后，基金经理按照本基金的投资决策程序，审慎精选，权衡风险收益特征后，根据二级市场波动情况构建股票组合并动态调整。

3、债券投资策略

本基金的债券投资综合考虑收益性、风险性和流动性，在深入分析宏观经济、货币政策以及市场结构的基础上，灵活运用各种消极和积极策略。

消极债券投资的目标是在满足现金管理需要的基础上为基金资产提供稳定的收益。本基金主要通过利率免疫策略来进行消极债券投资。利率免疫策略就是构造一个恰当的债券组合，使得利率变动导致的价格波动风险与再投资风险相互抵消。这样无论市场利率如何变化，债券组合都能获得一个比较确定的收益率。

积极债券投资的目标是利用市场定价的无效率来获得低风险甚至是无风险的超额收益。本基金的积极债券投资主要基于对利率期限结构的研究。利率期限结构描述了债券市场的平均收益率水平以及不同期限债券之间的收益率差别，它决定于三个要素：货币市场利率、均衡真实利率和预期通货膨胀率。在深入分析利率期限结构的基础上，本基金将运用利率预期策略、收益率曲线追踪策略进行积极投资。

本基金也将从债券市场的结构变化中寻求积极投资的机会。国内债券市场正处于发展阶段，交易制度、债券品种体系和投资者结构也在逐步完善，这些结构变化会产生低风险甚至无风险的套利机会。本基金将借助经济理论和金融分析方法努力把握市场结构变化所带来的影响，并在此基础上寻求低风险甚至无风险的套利机会，主要通过跨市场套利策略和跨品种套利策略来完成。

4、权证投资策略

本基金将权证看作是辅助性投资工具，其投资原则为优化基金资产的风险收益特征，有利于基金资产增值，有利于加强基金风险控制。本基金将在权证理论定价模型的基础上，综合考虑权证标的证券的基本面趋势、权证的市场供求关系以及交易制度设计等多种因素，对权证进行合理定价。本基金权证主要投资策略为低成本避险和合理杠杆操作。

（二）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国内外宏观经济形势及对中国证券市场的影响；

③国家货币政策、产业政策以及证券市场政策；

④行业发展现状及前景；

⑤上市公司基本面及成长前景；

⑥股票、债券等类别资产的预期收益率及风险水平。

2、投资决策机制

本基金实行投资决策团队制，强调团队合作，充分发挥集体智慧。本基金管理人将投资和研究职能整合，设立了投资研究部，策略分析师、行业分析师、金融工程小组和基金经理立足本职工作，充分发挥主观能动性，渗透到投资研究的关键环节，群策群力，为基金份额持有人谋取中、长期稳定的较高投资回报。

3、投资决策程序

本基金具体的投资决策机制与流程为：

①策略分析师就宏观、政策、投资主题、市场环境提交策略报告并讨论；行业研究员就行业发展趋势和行业组合的估值比较，召开会议讨论确定行业评级；

②基金经理在策略会议的基础之上提出资产配置的建议；

③投资决策委员会审议基金经理提交的资产配置建议，并确定资产配置比例的范围；

④投资研究部提交股票库，在此基础上，基金经理、行业研究员决定核心股票库名单；

⑤基金经理在考虑资产配置的情况下，经过风险收益的权衡，决定投资组合方案；

⑥投资总监审核投资组合方案后，交由基金经理实施；

⑦集中交易室执行交易指令；

⑧金融工程小组进行全程风险评估和绩效分析。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：

中证医药卫生指数 × 80% ＋ 上证国债指数 × 20%

选择该业绩基准，是基于以下因素：

1、中证医药卫生指数和上证国债指数合理、透明；

2、中证医药卫生指数和上证国债指数有较高的知名度和市场影响力；

3、中证医药卫生指数由中证指数有限公司编制，成份股包括中证800指数全部样本股（含沪深300指数和中证500指数的成份股）中属于医药卫生行业的上市公司，可以较好地反映沪深两市医药保健领域上市公司股票的整体表现；

4、中证医药卫生指数有一定市场覆盖率，不易被操纵；

5、基于本基金的投资范围和投资比例限制，选用该业绩比较基准能够忠实反映本基金的风险收益特征。

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，本基金管理人在履行适当程序后，可以变更业绩比较基准并及时公告。

十、基金的风险收益特征

本基金为股票型基金，属于证券投资基金中较高预期风险较高预期收益的品种，其预期风险收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。

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2011年7月18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。

本报告期自2011年4月1日起至6月30日止。

投资组合报告

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	2,767,767,515.91	76.22
	其中：股票	2,767,767,515.91	76.22
2	固定收益投资	49,805,000.00	1.37
	其中：债券	49,805,000.00	1.37
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	400,001,080.00	11.01
	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	294,396,222.55	8.11
6	其他资产	119,548,601.83	3.29
7	合计	3,631,518,420.29	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	2,570,102,630.53	70.93
C0	食品、饮料	25,799,401.44	0.71
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	71,702,375.70	1.98
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	131,259,879.36	3.62
C8	医药、生物制品	2,341,340,974.03	64.61
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	57,151,259.28	1.58
H	批发和零售贸易	107,054,414.46	2.95
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	33,459,211.64	0.92
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	2,767,767,515.91	76.38

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	600079	人福医药	7,885,019	173,943,519.14	4.80
2	002007	华兰生物	4,857,562	164,865,654.28	4.55
3	000423	东阿阿胶	3,354,467	138,405,308.42	3.82
4	000538	云南白药	2,094,065	119,529,230.20	3.30
5	600518	康美药业	8,999,926	118,439,026.16	3.27
6	300039	上海凯宝	4,581,508	114,354,439.68	3.16
7	002038	双鹭药业	2,693,220	101,669,055.00	2.81
8	002223	鱼跃医疗	3,720,062	91,253,120.86	2.52
9	600535	天士力	2,210,047	90,899,233.11	2.51
10	600276	恒瑞医药	2,990,954	89,638,891.38	2.47

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	49,805,000.00	1.37
	其中：政策性金融债	49,805,000.00	1.37
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	49,805,000.00	1.37

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	100231	10国开31	500,000	49,805,000.00	1.37

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 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或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,582,013.41
2	应收证券清算款	115,757,883.55
3	应收股利	-
4	应收利息	1,958,932.83
5	应收申购款	249,772.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	119,548,601.83

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。

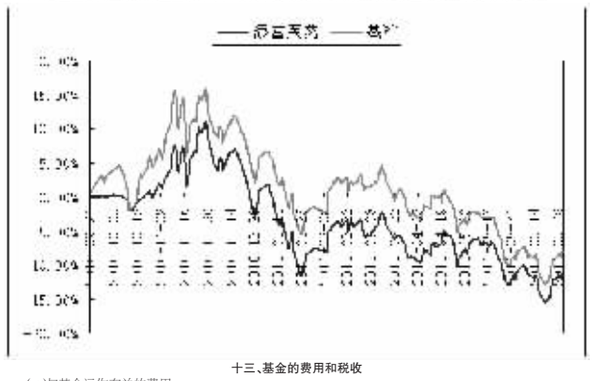
十二、基金的业绩

本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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

（一）本基金份额净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表：

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）
2010年9月21日（基金合同生效日）至2010年12月31日	1.00%	1.40%	5.85%	1.70%	-4.85%	-0.30%
2011年1月1日至2011年6月30日	-12.28%	1.14%	-12.96%	1.14%	0.68%	0.00%
2010年9月21日（基金合同生效日）至2011年6月30日	-11.40%	1.24%	-8.10%	1.37%	-3.30%	-0.13%

（二）自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较图



十三、基金的费用和税收

（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（基金合同）生效后与基金相关的信息披露费用；

④（基金合同）生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

⑤基金份额持有人大会费用；

⑥基金的证券交易费用；

⑦基金的银行汇划费用；

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。

本基金终止清算时所发生费用，按实际支出额从基金财产总值中扣除。

2、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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H=E×1.50%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前2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、公休假等，支付日期顺延。

②基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）基金费用的种类”中第3-7项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

①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；

②基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

③（基金合同）生效前的相关费用，包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等费用；

④其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

4、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

5、基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

（二）与基金销售有关的费用

1、申购费用

基金申购费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章“基金的申购与赎回”相应内容。

2、赎回费用

基金赎回费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章“基金的申购与赎回”相应内容。

3、转换费用

基金转换费的费率水平、计算公式、收取方式和使用方式参见本招募说明书正文第八章“基金的申购与赎回”相应内容。

十四、对招募说明书更新部分的说明

一、重要提示”部分：

更新招募说明书所载内容截止日及有关财务数据和净值表现的截止日。

二、三、基金管理人”部分：

更新了主要人员情况。

三、四、基金托管人”部分：

1、更新了基金托管人基本情况。

2、更新了主要人员情况。

3、更新了基金托管业务经营情况。

4、更新了基金托管人的内部控制制度。

四、五、相关服务机构”部分：

更新了基金份额发售机构的相关信息。

五、九、基金的投资”部分：

更新了基金投资组合报告。

六、十、基金的业绩”部分：

更新了基金业绩数据。

七、二十二、其他应披露事项”部分：

更新了2011年3月22日至2011年9月21期间涉及基金的相关公告。

汇添富基金管理有限公司
2011年11月4日

（上接D28版）

（94）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：0592-5161642
传真：0592-5161140
客户服务电话：0592-5163588
网址：www.xmzq.cn
（95）爱建证券有限责任公司
注册地址：上海市南京西路758号24楼
办公地址：上海市南京西路758号博爱大厦20层-25层
法定代表人：张雄华
电话：（021）32229888
传真：（021）62878701
客户服务电话：（021）63340678
网址：www.ajzq.com
（96）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：赵文宏
电话：（0755）83007042-83007166
传真：（0755）83007034
客户服务电话：4008-698-698
网址：www.ydsc.com.cn
（97）华融证券股份有限公司
注册地址：北京市西城区 月坛北街26号
办公地址：北京市西城区 月坛北街26号
法定代表人：丁之锁
电话：（010）58568007
传真：（010）58568062
客户服务电话：（010）58568118
网址：www.hrsec.com.cn
（98）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
（99）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
网址：www.tfzq.com
（100）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
（101）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：大连市中山区延安路1号保嘉大厦15-16层
法定代表人：于宏民
电话：0411-39673301
传真：0411-39673219
客户服务电话：4008-169-169
网址：www.daton.com.cn
（102）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5号新盛大厦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.cn或jijin.txsec.com
（二）基金注册与过户登记人
名称：华安基金管理有限公司
注册地址：上海市浦东新区浦东南路360号，新上海国际大厦38楼
法定代表人：李勤
电话：021）38969999
传真：021）33627990
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
电话：021）23238888
传真：021）23238800
联系人：金毅
经办注册会计师：马颖媲、金毅

六、基金的名称

本基金名称：华安创新证券投资基金。

七、基金的类型

本基金类型：契约型开放式。

八、基金的投资目标

基金管理人将以分散投资风险，提高基金资产的安全性，并积极追求投资收益的稳定增长为目标，以诚信原则及专业经营方式，将本基金投资于具有良好流动性的金融工具，主要包括国内依法公开发行、上市的股票、债券以及经中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具。

本基金的投资原则：

1.本基金遵循诚信稳健原则，高度重视基金资产的安全性，力求更好地降低投资风险。

2.本基金主要投资于在中国境内上市的创新类上市公司的股票和债券，以获取资本利得为主要投资目标。

3.本基金将根据市场变化，灵活选择一定比例的短期投资，在防范风险的前提下，力求增加基金的收益。

4.在严格遵守《基金法》、《试点办法》、《基金合同》等有关规定的前提下，基金管理人可根据具体情况，不断调整投资组合，提高投资组合的回报率，但基金的股票资产中至少有80%属于华安创新证券投资基金名称所显示的投资内容。

九、基金的投资方向

本基金主要投资创新类上市公司以实现基金的投资收益，通过建立科学合理的投资组合，为投资者降低和分散投资风险，提高基金资产的安全性。

这里的创新是指科技创新、管理创新和制度创新等方面。创新类上市公司包括高新技术产业创新公司和传统产业创新公司。

高新技术产业创新公司主要集中在信息技术、生物医药和新材料等高新技术产业等领域，包括电子信息及网络技术、生物技术及新医药、光机电一体化、航空航天技术、海洋技术、新材料、新能源等领域内主业突出的上市公司。

传统产业类型的上市公司中，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效益的上市公司也属于本基金的主要投资范围。

本基金在选择上市公司时主要考虑以下因素：公司创新能力强，主营业务市场空间大，财务状况良好，具有相当竞争优势等。

本基金的投资组合将通过持有基金管理人确认的并符合法律规定的一定比例的高流动性资产，如国债和现金，从而保持基金资产良好的流动性。

十、基金的投资决策

（一）决策依据

1.国家有关法律、法规和《基金合同》的有关规定；

2.国内国际宏观经济环境；

3.国家货币政策、利率走势及通货膨胀预期；

4.国家产业政策；

5.各地区、各行业发展状况；

6.上市公司研究；

7.证券市场走势。

（二）投资流程

1.投资决策委员会会议形成由参加会议成员签字的书面决议，确定本基金总体资产分配和投资策略。投资决策委员会定期召开会议，由公司总经理或指定人员召集。如需做出及时重大决策或基金经理提议，可临时召开投资决策委员会会议。

2.基金经理设计和调整投资组合。设计和调整投资组合需要考虑的基本因素包括：每日基金申购和赎回净现金流量；《基金合同》的投资限制和比例限制；研究员的投资建议；基金经理的独立判断；风险分析小组的建议等。

3.基金经理向集中交易室下达投资指令。交易员收到基金投资指令后，按时间优先、价格优先、综合平衡、比例分配原则完成指令。

4.风险分析小组对开放式基金投资组合进行评估，向基金经理提出调整建议。

5.监察稽核部对投资程序进行稽查并出具稽查报告。

（三）基金投资限制

基金管理人应依据有关法令及《基金合同》规定，运作管理本基金：

1.本基金投资组合应遵循下列规定：

① 本基金投资于股票、债券的比例，不低于本基金资产总值的80%；

② 本基金持有1家上市公司的股票，不超过本基金资产净值的10%；

③ 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有1家公司发行的证券的总和，不超过该证券的10%；

④ 本基金投资于国家债券的比例不低于本基金资产净值的20%；

⑤ 本基金股票资产中至少有80%属于本基金名称所显示的投资内容；

⑥ 中国证监会的其它比例限制。

2.禁止用本基金资产从事以下行为：

① 投资于其他证券投资基金；

② 以基金的名义使用不属于基金名下的资金买卖证券；

③ 动用银行信贷资金从事基金投资；

④ 将基金资产用于担保、资金拆借或者贷款；

⑤ 从事证券信用交易；

⑥ 以基金资产进行房地产投资；

⑦ 从事可能使基金资产承担无限责任的投资；

⑧ 将基金资产投资于与基金托管人或者基金管理人有利害关系的公司发行的证券；

⑨ 当时有效的法律、法规、规章、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

十一、基金的业绩比较基准

基金整体业绩比较基准=75%×中信标普300指数收益率+25%×中信标普国债指数收益率（中信国债指数于2006年4月12日起更名为中信标普国债指数）。

当上述比较基准中参照的指数不再有效或被取消后，或基金管理人认为该等参照的指数收益率无法合理衡量本基金整体业绩时，基金管理人有权对上述基金整体业绩比较基准进行调整并公告。

十二、基金的风险收益特征

本基金的风险收益特征：无。

十三、基金的投资组合报告

（一）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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2011年8月22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2011年6月30日。

（一）基金投资组合报告

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	4,833,655,935.55	66.16
	其中：股票	4,833,655,935.55	66.16
2	固定收益投资	1,656,960,130.70	22.68
	其中：债券	1,656,960,130.70	22.68
	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	786,958,361.00	10.77
6	其他各项资产	28,228,244.75	0.39
7	合计	7,305,802,672.00	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	196,987,356.34	2.70
C	制造业	3,768,946,491.89	51.73
C0	食品、饮料	-	-
C1	纺织、服装、皮毛	168,514,365.39	2.31
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	12,408,758.25	0.17
C4	石油、化学、塑胶、塑料	1,063,492,095.89	14.60
C5	电子	164,050,538.36	2.25
C6	金属、非金属	809,514,681.49	11.11
C7	机械、设备、仪表	1,416,537,373.80	19.44
C8	医药、生物制品	134,428,678.71	1.85
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	-	-
E	建筑业	197,930,452.61	2.72
F	交通运输、仓储业	70,584,609.76	0.97
G	信息技术业	425,582,853.75	5.84
H	批发和零售贸易	128,066,371.20	1.76
I	金融、保险业	13,434,000.00	0.18
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	32,123,800.00	0.44
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	-	-
	合计	4,833,655,935.55	66.35

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	000422	湖北宜化	15,000,000	313,950,000.00	4.31
2	000581	威孚高科	6,800,000	262,140,000.00	3.60
3	600426	华鲁恒升	12,700,000	214,630,000.00	2.95
4	600585	海螺水泥	7,723,459	214,403,221.84	2.94
5	600582	天地科技	8,799,800	194,827,572.00	2.67
6	000012	南玻A	11,428,000	188,562,000.00	2.59
7	002152	广电运通	6,000,000	184,980,000.00	2.54
8	002123	荣信股份	7,600,000	173,128,000.00	2.38
9	600741	华域汽车	15,508,046	172,604,551.98	2.37
10	600143	金发科技	10,000,000	164,600,000.00	2.26

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	227,374,116.30	3.12
2	央行票据	600,306,000.00	8.24
3	金融债券	661,478,000.00	9.08
	其中：政策性金融债	661,478,000.00	9.08
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	20,100,000.00	0.28
6	中期票据	-	-
7	可转债	147,702,014.40	2.03
8	其他	-	-
9	合计	1,656,960,130.70	22.74

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